

# 上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

## 2022 年中期报告

### 2022 年 6 月 30 日

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十一日

## 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。本中期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 2022 年 8 月 30 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	40
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	40
7.4 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	41
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	52
7.8 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	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	52
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	52
7.11 本报告期投资基金情况	52
7.12 投资组合报告附注	53

<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	54
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	54
<b>10 重大事件揭示</b> .....	54
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	60
<b>12 备查文件目录</b> .....	60
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## 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混合型证券投资基金
基金简称	上投摩根全球新兴市场混合(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	45,532,642.05 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于新兴市场以及在其他证券市场交易的新兴市场企业，通过深入挖掘新兴市场企业的投资价值，努力实现基金资产稳健增值。
投资策略	<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速增长成果，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>1、股票投资策略</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> <p>2、固定收益类投资策略</p> <p>本基金将根据风险防御及现金替代性管理的需要，适度进行债券投资。本基金在对新兴市场中不同国家和地区宏观经济发展情况、财政政策、货币政策、以及利率走势进行分析的基础上，综合考查利率风险、信用和流动性风险对债券内在价值的影响，构建固定收益类投资组合，以追求长期低波动率的稳健回报。</p> <p>3、其他投资策略：包括衍生品投资策略。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：MSCI 新兴市场股票指数（总回报）
风险收益特征	<p>本基金是混合型证券投资基金，预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。</p> <p>根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和相关销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销</p>

	售机构提供的评级结果为准。
--	---------------

### 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	邹树波	李申
	联系电话	021-38794888	021-60637102
	电子邮箱	services@cifm.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-4888	021-60637111
传真		021-20628400	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 富城路99号震旦国际大楼25楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 富城路99号震旦国际大楼25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		陈兵	田国立

### 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, U.S.A.
办公地址		60 Victoria Embankment London, EC4Y0JP, England	383 Madison Avenue, New York, NY 10179-0001
邮政编码		-	-

### 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cifm.com">http://www.cifm.com</a>
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	上投摩根基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区富城路99号 震旦国际大楼25楼

### 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022年1月1日至2022年6月30日）
本期已实现收益	-3,043,500.02
本期利润	-7,685,954.70
加权平均基金份额本期利润	-0.1698
本期加权平均净值利润率	-16.55%
本期基金份额净值增长率	-15.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	-2,767,145.75
期末可供分配基金份额利润	-0.0608
期末基金资产净值	42,973,638.53
期末基金份额净值	0.9438
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	2.63%

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-7.66%	1.09%	-6.44%	1.23%	-1.22%	-0.14%
过去三个月	-5.68%	1.23%	-7.35%	1.39%	1.67%	-0.16%
过去六个月	-15.30%	1.44%	-14.50%	1.43%	-0.80%	0.01%
过去一年	-25.09%	1.20%	-24.37%	1.18%	-0.72%	0.02%
过去三年	2.33%	1.36%	-7.39%	1.25%	9.72%	0.11%
自基金合同生效起至今	2.63%	1.20%	-9.56%	1.07%	12.19%	0.13%

##### 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混合型证券投资基金  
 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 2022 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为 2011 年 1 月 30 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 2022 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有八十四只，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、上投摩根阿尔法混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋混合型证券投资基金、上投摩根内需动力混合型证券投资基金、上投摩根

亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘混合型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选混合型证券投资基金、上投摩根智选 30 混合型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添盈货币市场基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根安全战略股票型证券投资基金、上投摩根卓越制造股票型证券投资基金、上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根智慧互联股票型证券投资基金、上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根新兴服务股票型证券投资基金、上投摩根医疗健康股票型证券投资基金、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)、上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、上投摩根全球多元配置证券投资基金(QDII)、上投摩根安丰回报混合型证券投资基金、上投摩根安通回报混合型证券投资基金、上投摩根优选多因子股票型证券投资基金、上投摩根丰瑞债券型证券投资基金、上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根安隆回报混合型证券投资基金、上投摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)、上投摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、上投摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、上投摩根安裕回报混合型证券投资基金、上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金(QDII)、上投摩根核心精选股票型证券投资基金、上投摩根动力精选混合型证券投资基金、上投摩根领先优选混合型证券投资基金、上投摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)、上投摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、上投摩根瑞益纯债债券型证券投资基金、上投摩根慧选成长股票型证券投资基金、上投摩根瑞泰 38 个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根锦程稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、上投摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根研究驱动股票型证券投资基金、上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上投摩根瑞盛 87 个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根慧见两年持有期混合型证券投资基金、上投摩根远见两年持有期混合型证券投资基金、上投摩根安享回报一年持有期债券型证券投资基金、

上投摩根优势成长混合型证券投资基金、上投摩根行业睿选股票型证券投资基金、上投摩根安荣回报混合型证券投资基金、上投摩根中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、上投摩根景气甄选混合型证券投资基金、上投摩根均衡优选混合型证券投资基金、上投摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、上投摩根月月盈 30 天滚动持有发起式短债债券型证券投资基金、上投摩根全景优势股票型证券投资基金、上投摩根鑫睿优选一年持有期混合型证券投资基金、上投摩根沃享远见一年持有期混合型证券投资基金、上投摩根博睿均衡一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、上投摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金。

#### 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		
张军	投资董事、本基金基金经理	2021-06-01	-	18 年（金融领域从业经验 29 年）	基金经理张军先生，毕业于上海复旦大学。曾担任上海国际信托有限公司国际业务部经理，交易部经理。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。
--	--	--	--	--	---

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。

#### 4.1.3 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	4,412,777,137.48	2008-03-08
	私募资产管理计划	1	128,676,156.00	2021-07-09
	其他组合	-	-	-
	合计	10	4,541,453,293.48	

#### 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	摩根资产管理(英国)董事总经理，位于伦敦的新兴市场和亚太地区（EMAP）股票团队的负责人	19 年	Anuj Arora，董事总经理，是位于伦敦的新兴市场和亚太地区（EMAP）股票团队的负责人。自 2006 年加入公司以来，负责管理全球新兴市场多元策略，并监督 EMAP 股票团队中与量化策略有关的所有研究，包括资产配置和风险管理。此前，Anuj 是芝加哥梅斯洛金融公司的定量分析师和 Birkelbach Investment Securities 的分析师。他拥有伊利诺伊理工学院金融学硕士学位。
Harold Yu	摩根资产管理(英国)副总裁，产品分析师	10 年	Harold Yu，特许金融分析师，副总裁，是一位产品分析师，负责位于伦敦的新兴市

		<p>场和亚太地区（EMAP）股票团队的全球新兴市场核心策略。他于 2014 年 2 月加入公司，在此之前，在英杰华投资从事股票衍生品业务。Harold 于 2011 年获得了格林内尔学院（Grinnell College）数学和经济学学士学位并于 2013 年获得康奈尔大学金融工程专业的硕士学位。Harold 拥有金融风险管理师（FRM）证书，并且是特许金融分析师。</p>
--	--	---

#### 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混合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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于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、交易方向等的抽样分析，未发现存在异常交易行为。

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形：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

彭博数据显示 MSCI 新兴市场股指在 2022 年上半年下跌接近 15%，跌幅小于成熟市场股指。基金在报告期内的业绩受到俄罗斯市场的影响，跑输业绩基准。

驱动下跌的因素包括：俄乌冲突、美联储加息以及中国疫情扩散等。市场参与者采取保守措施，规避风险，使得风险资产价格下跌。另外，美元升值也是加息和避险情绪共同作用的结果，新兴市场货币整体对美元贬值。

市场现在预计，到明年初美国、英国和欧洲的利率将分别上升至 3.4%、3% 和 1.6%。预期利率上升也导致了股票估值的下降，以及对增长前景的担忧。由于各国央行寻求对抗通胀，价格上涨和借贷成本上升对消费者的挤压，对经济衰退的担忧已经上升。

报告期间也出现了让投资人情绪好转的事件：1) 中国政府努力缓解经济增长放缓; 2) 中国防疫政策不再趋紧以及减少行动限制，逐步恢复正常生活; 3) 美国总统拜登正在考虑取消对中国进口商品的一些关税。4) 美国国债收益率突破 3.0% 后，逐渐修正回落。

### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期全球新兴市场份额净值增长率为:-15.30%，同期业绩比较基准收益率为:0.00%。

## 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，新兴市场相比历史上受到冲击的情况，这次准备得较好。缩减量化宽松和提高美国利率仍可能导致美元走强和全球流动性减少，这可能会影响一些更加依赖外部融资的新兴市场。尽管对经济衰退的担忧正在加剧，但分析师的普遍预测是今年和明年公司利润都将实现正增长。因此，由于市盈率对大多数市场来说已经看起来很便宜，因此这里的主要风险是，如果公司收益相对于预期令人失望，或者仍然相对昂贵的股票的估值是否继续进一步下降。

虽然风险仍然存在，但市场已经下跌了很长一段路。因此，即使我们最终陷入衰退，现在卖出股票并在以后以更便宜的价格买回股票，也需要能够以一种很少有专业投资者能够做到的方式对市场底部进行判断。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责,根据相关的法律法规规定、基金合同的约定,制定了内部控制措施,对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制,目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会,并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人,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。基金经理参加估值委员会会议,参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金实际运作情况,本基金以 2021 年 12 月 31 日为收益分配基准日,于 2022 年 1 月 20 日实施收益分配,每 10 份基金份额派发红利 0.989 元,合计发放红利 4,319,268.66 元。

符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内,本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况,出现该情况的时间范围为 2022 年 02 月 21 日至 2022 年 06 月 30 日。

基金管理人拟调整本基金运作方式,加大营销力度,提升基金规模,方案已报监管机关。

## 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,发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人,基金管理人在合理期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。报告期内,本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	3,450,683.83	5,565,533.20
结算备付金		17.17	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	39,438,812.96	48,054,775.76
其中：股票投资		39,438,812.96	48,054,775.76
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		312,152.29	68,422.29
应收申购款		115,836.09	48,775.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	156.62
<b>资产总计</b>		<b>43,317,502.34</b>	<b>53,737,663.67</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2.79	3.04
应付赎回款		133,561.22	286,062.82

应付管理人报酬		65,892.22	81,219.54
应付托管费		12,812.41	15,792.70
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	131,595.17	110,656.06
<b>负债合计</b>		<b>343,863.81</b>	<b>493,734.16</b>
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.7	45,532,642.05	43,942,748.38
未分配利润	6.4.7.8	-2,559,003.52	9,301,181.13
<b>净资产合计</b>		<b>42,973,638.53</b>	<b>53,243,929.51</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>43,317,502.34</b>	<b>53,737,663.67</b>

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值：0.9438，基金份额总额：45,532,642.05 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-7,114,274.33</b>	<b>-1,193,568.77</b>
1.利息收入		4,599.88	13,396.38
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,599.88	13,396.38
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,583,072.25	11,069,002.67
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,465,386.24	10,572,564.76
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	882,313.99	496,437.91
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-4,642,454.68	-12,399,215.00

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		99,767.75	78,869.33
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	6,884.97	44,377.85
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>571,680.37</b>	<b>1,088,100.98</b>
1. 管理人报酬		416,193.69	602,838.62
2. 托管费		80,926.53	117,218.58
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.17	74,560.15	368,043.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-7,685,954.70</b>	<b>-2,281,669.75</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-7,685,954.70</b>	<b>-2,281,669.75</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-7,685,954.70</b>	<b>-2,281,669.75</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	43,942,748.38	-	9,301,181.13	53,243,929.51
二、本期期初净资产（基金净值）	43,942,748.38	-	9,301,181.13	53,243,929.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,589,893.67	-	-11,860,184.65	-10,270,290.98
（一）、综合收益总额	-	-	-7,685,954.70	-7,685,954.70
（二）、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）	1,589,893.67	-	145,038.71	1,734,932.38
其中：1. 基金申购	7,838,059.37	-	315,563.16	8,153,622.53

款				
2.基金赎回款	-6,248,165.70	-	-170,524.45	-6,418,690.15
(三)、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)	-	-	-4,319,268.66	-4,319,268.66
四、本期期末净资产(基金净值)	45,532,642.05	-	-2,559,003.52	42,973,638.53
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	42,574,831.11	-	16,463,924.61	59,038,755.72
二、本期期初净资产(基金净值)	42,574,831.11	-	16,463,924.61	59,038,755.72
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	6,265,740.88	-	1,613,549.69	7,879,290.57
(一)、综合收益总额	-	-	-2,281,669.75	-2,281,669.75
(二)、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)	6,265,740.88	-	3,895,219.44	10,160,960.32
其中: 1.基金申购款	32,486,304.66	-	14,534,538.76	47,020,843.42
2.基金赎回款	-26,220,563.78	-	-10,639,319.32	-36,859,883.10
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	48,840,571.99	-	18,077,474.30	66,918,046.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王大智，主管会计工作负责人：郭海明，会计机构负责人：张璐

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(原名为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 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 21 日公告后更名为上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金。

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混合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 2022 年 8 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)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混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年上半年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下： 1 会计政

策变更的性质、内容和原因 (a) 金融资产和金融负债的分类 金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产 金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具 本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量： 本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益： 本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具 权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债 金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具 本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

(b) 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。 本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。 本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。 于每个资产负债表日，本

基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。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。(c) 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由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。以公允价值计量且其变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息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；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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。

2 当期报表中受影响的项目名称和调整金额 (a) 金融工具 根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果

如下：原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、应收利息、应收股利和应收申购款，金额分别为 5,565,533.20 元、156.62 元、68,422.29 元和 48,775.80 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、其他资产-应收利息、应收股利和应收申购款，金额分别为 5,565,689.82 元、0.00 元、68,422.29 元和 48,775.80 元。原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 48,054,775.76 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 48,054,775.76 元。原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 3.04 元、286,062.82 元、81,219.54 元、15,792.70 元、4,655.22 元和 1,000.84 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 3.04 元、286,062.82 元、81,219.54 元、15,792.70 元、4,655.22 元和 1,000.84 元。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融

业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，在境内暂不征收企业所得税。

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	3,450,683.83
等于：本金	3,450,535.54
加：应计利息	148.29
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	3,450,683.83

注：于 2022 年 6 月 30 日，活期银行存款中包含的外币余额为：美元 193,607.04 元(折合人民币 1,299,374.28 元)，港币 117,876.95 元(折合人民币 100,818.71 元)，新台币 1,856,264.00 元(折合人民币 418,993.06 元)，韩元 1,126.00 元(折合人民币 5.82 元)。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	44,651,462.87	-	39,438,812.96	-5,212,649.91
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
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	44,651,462.87	-	39,438,812.96	-5,212,649.91

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债****6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额**

无余额。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

无余额。

**6.4.7.5 其他资产**

无余额。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	358.05
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,292.46
其中：交易所市场	9,292.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	121,944.66
合计	131,595.17

**6.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	43,942,748.38	43,942,748.38
本期申购	7,838,059.37	7,838,059.37
本期赎回（以“-”号填列）	-6,248,165.70	-6,248,165.70
本期末	45,532,642.05	45,532,642.05

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.7.8 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	4,826,301.05	4,474,880.08	9,301,181.13
本期利润	-3,043,500.02	-4,642,454.68	-7,685,954.70
本期基金份额交易产生的变动数	-230,678.12	375,716.83	145,038.71
其中：基金申购款	-1,171,320.35	1,486,883.51	315,563.16
基金赎回款	940,642.23	-1,111,166.68	-170,524.45
本期已分配利润	-4,319,268.66	-	-4,319,268.66
本期末	-2,767,145.75	208,142.23	-2,559,003.52

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,736.73
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	863.15
其他	-
合计	4,599.88

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	20,910,405.62
减：卖出股票成本总额	24,276,495.93
减：交易费用	99,295.93
买卖股票差价收入	-3,465,386.24

#### 6.4.7.11 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

无。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

无。

## 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	882,313.99
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	882,313.99

## 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-4,642,454.68
——股票投资	-4,642,454.68
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-4,642,454.68

## 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	6,884.97
合计	6,884.97

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。

## 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	39,671.58

证券出借违约金	-
其他	7,615.49
合计	74,560.15

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上投摩根基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
摩根大通银行(JPMorgan & Chase Bank, N.A.)	境外资产托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

###### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

###### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	416,193.69	602,838.62
其中：支付销售机构的客户维护费	132,530.21	190,892.39

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.8% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	80,926.53	117,218.58

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

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	1,632,460.46	3,736.41	10,439,088.73	13,396.38
摩根大通银行	1,818,223.37	0.32	4,344,624.50	-

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。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明****6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用**

本基金本报告期内未持有基金管理人以及管理人关联方所管理的基金。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2022-01-19	-	2022-01-18	0.989	2,488,186.08	1,831,082.58	4,319,268.66	-
合计	-	-	-	0.989	2,488,186.08	1,831,082.58	4,319,268.66	-

#### 6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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，定期或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；风险管理部负责建立并完善公司市场风险、流动性风险、信用风险管理框架，运用系统化分析工具对以上进行分析和识别，提升公司风险科技水平。运营风险管理部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。投资准则管理部负责执行和管控投资准则，通过设立投资准则、事前管控、事后管控，保障基金投资运作符合法规、合同及公司内部要求。

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。

#### 6.4.13.2 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，因而与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。

### 6.4.13.3 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。

于 2022 年 6 月 30 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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### **6.4.13.4 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。

##### **6.4.13.4.1 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等。

#### 6.4.13.4.2 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	(其他主要 币种) 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	1,299,374.28	100,818.71	-	418,998.88	1,819,191.87
交易性金融资产	7,403,114.93	15,365,809.28	-	16,669,888.75	39,438,812.96
应收股利	28,877.20	14,221.60	-	125,830.04	168,928.84
<b>资产合计</b>	<b>8,731,366.41</b>	<b>15,480,849.59</b>	<b>-</b>	<b>17,214,717.67</b>	<b>41,426,933.67</b>
以外币计价的负债					
负债合计	-	-	-	-	-
<b>资产负债表</b>	<b>8,731,366.41</b>	<b>15,480,849.59</b>	<b>-</b>	<b>17,214,717.67</b>	<b>41,426,933.67</b>

项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
项目	美元 折合人民币	港币 折合人民币	(其他主要 币种) 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	3,527,347.67	96,398.05	-	840,357.43	4,464,103.15
交易性金融资产	12,568,056.41	15,814,860.76	-	19,671,858.59	48,054,775.76
应收股利	55,831.76	-	-	1,533.28	57,365.04
<b>资产合计</b>	<b>16,151,235.84</b>	<b>15,911,258.81</b>	<b>-</b>	<b>20,513,749.30</b>	<b>52,576,243.95</b>
以外币计价的负债					
负债合计	-	-	-	-	-
<b>资产负债表 外汇风险敞 口净额</b>	<b>16,151,235.84</b>	<b>15,911,258.81</b>	<b>-</b>	<b>20,513,749.30</b>	<b>52,576,243.95</b>

## 6.4.13.4.2.2 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	增加约 207	增加约 263
	所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 207	减少约 263

## 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	39,438,812.96	91.77	48,054,775.76	90.25
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	39,438,812.96	91.77	48,054,775.76	90.25

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 221	增加约 334
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 221	减少约 334

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	39,438,812.96	48,054,775.76
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	39,438,812.96	48,054,775.76

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及

限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	39,438,812.96	91.05
	其中：普通股	31,879,216.97	73.59
	存托凭证	7,559,595.99	17.45
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
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	3,450,701.00	7.97
8	其他各项资产	427,988.38	0.99
9	合计	43,317,502.34	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	15,365,809.28	35.76
韩国	6,010,619.73	13.99
美国	5,770,002.79	13.43
巴西	2,150,196.43	5.00
中国台湾	2,091,668.13	4.87
英国	2,080,405.18	4.84
南非	1,853,066.42	4.31
墨西哥	1,138,667.23	2.65
俄罗斯	858,916.14	2.00
泰国	548,026.48	1.28
印度尼西亚	462,100.00	1.08
波兰	372,466.29	0.87
马来西亚	358,470.23	0.83
捷克	156,493.48	0.36
匈牙利	129,874.57	0.30
智利	92,030.58	0.21
合计	39,438,812.96	91.77

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定，ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
商业银行	4,599,112.65	10.70
石油、天然气与消费用燃料	4,308,008.35	10.02
半导体产品与设备	4,257,015.15	9.91
电脑与外围设备	2,690,854.19	6.26
互动媒体与服务III	2,485,534.55	5.78
互联网与售货目录零售	2,325,510.22	5.41
保险	2,015,658.75	4.69
金属与采矿	1,944,538.14	4.52

汽车	1,614,157.02	3.76
房地产管理和开发	1,406,070.78	3.27
食品与主要用品零售III	1,139,361.02	2.65
无线电信业务	1,099,772.05	2.56
娱乐	949,001.60	2.21
资本市场	825,995.83	1.92
综合金融服务	821,566.34	1.91
食品	746,822.80	1.74
化学制品	701,438.16	1.63
家庭耐用消费品	665,875.70	1.55
海运III	567,510.70	1.32
燃气公用事业	562,219.65	1.31
电力公用事业	501,915.60	1.17
生命科学工具和服务	491,277.27	1.14
建筑材料	465,276.52	1.08
电子设备、仪器和元件	390,032.92	0.91
纺织品、服装与奢侈品	358,211.60	0.83
饮料	340,127.26	0.79
建筑与工程	306,962.76	0.71
综合电信业务	252,282.87	0.59
交通基本设施	155,844.19	0.36
信息技术服务	128,079.08	0.30
工业集团企业	115,828.51	0.27
航空公司III	105,049.45	0.24
专营零售	101,901.28	0.24
合计	39,438,812.96	91.77

注：行业分类标准：MSCI

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

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	Taiwan Semicond uctor Manufact uring Co Ltd	台积电	TSM US	纽约证 券交易 所	美国	5,306.00	2,911,173.78	6.77
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	0700	香港证 券交易 所	中国香港	8,200.00	2,485,534.55	5.78

3	Samsung Electronic s Co Ltd	三星电子 有限公司	005930 KS	韩国证 券期货 交易所	韩国	6,308.00	1,858,536.77	4.32
4	Reliance Industries Ltd	印度瑞来 斯实业公 司	RIGD LI	伦敦证 券交易 所	英国	3,573.00	1,559,888.08	3.63
5	Alibaba Group Hldg Ltd	阿里巴巴 集团控股 有限公司	9988	香港证 券交易 所	中国香港	14,400.00	1,378,176.43	3.21
6	NetEase Inc	网易	9999	香港证 券交易 所	中国香港	7,700.00	949,001.60	2.21
7	HDFC Bank Ltd	HDFC 银 行有限公 司	HDB US	纽约证 券交易 所	美国	2,307.00	850,956.66	1.98
8	Postal Savings Bank Corp Ltd	邮储银行	1658	香港证 券交易 所	中国香港	146,000.00	777,952.61	1.81
9	Petroleo Brasileiro SA (Petrobras ) Preferenc e	巴西石油 公司	PETR4	圣保罗 证券交 易所	巴西	20,330.00	728,727.94	1.70
10	PICC Property & Casualty Co Ltd	中国财险	2328	香港证 券交易 所	中国香港	104,000.00	725,831.37	1.69
11	Lenovo Group Ltd	联想集团	0992	香港证 券交易 所	中国香港	114,000.00	714,695.53	1.66
12	HAIER SMARTH OME	海尔智家	6690	香港证 券交易 所	中国香港	26,800.00	665,875.70	1.55
13	GF SEC	广发证券	1776	香港证 券交易 所	中国香港	69,200.00	614,349.75	1.43
14	PetroChin a Co Ltd	中国石油 股份	0857	香港证 券交易 所	中国香港	188,000.00	601,369.90	1.40
15	America Movil	美洲电信	AMX US	纽约证 券交易	美国	4,141.00	567,788.67	1.32

	SAB de CV ADR			所				
16	KIA Corp	起亚汽车	000270 KS	韩国证券期货交易所	韩国	1,393.00	556,589.78	1.30
17	SK Hynix Inc	SK 海力士	000660 KS	韩国证券期货交易所	韩国	1,176.00	553,163.26	1.29
18	PTT Exploration & Production Public Co Ltd NVDR	-	PTTEP-R TB	泰国证券交易所	泰国	18,100.00	548,026.48	1.28
19	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	广汽集团	2238	香港证券交易所	中国香港	84,000.00	545,297.24	1.27
20	Meituan Dianping	美团-W	3690	香港证券交易所	中国香港	3,100.00	514,900.32	1.20
21	Firststrand Ltd	-	FSR SJ	南非约翰内斯堡证券交易所	南非	19,583.00	500,366.14	1.16
22	China Vanke Co Ltd	万科企业	2202	香港证券交易所	中国香港	29,200.00	492,495.20	1.15
23	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	药明生物	2269	香港证券交易所	中国香港	8,000.00	491,277.27	1.14
24	Shinhan Financial Group Co Ltd	-	055550 KS	韩国证券期货交易所	韩国	2,546.00	487,586.00	1.13
25	Banco do Brasil SA	-	BBAS3 BZ	圣保罗证券交易所	巴西	11,292.00	483,742.57	1.13
26	Longfor Properties Co Ltd	龙湖集团	0960	香港证券交易所	中国香港	15,000.00	475,326.15	1.11
27	Anhui	海螺水泥	0914	香港证	中国香港	16,000.00	465,276.52	1.08

	Conch Cement Co Ltd			券交易所				
28	Hana Financial Group Inc	-	086790 KS	韩国证券期货交易所	韩国	2,271.00	461,919.70	1.07
29	LUKOIL PJSC	-	LKOH RU	莫斯科证券交易所	俄罗斯	937.00	448,528.07	1.04
30	China Resources Land Ltd	华润置地	1109	香港证券交易所	中国香港	14,000.00	438,249.43	1.02
31	JD.com Inc	京东集团-SW	9618	香港证券交易所	中国香港	2,000.00	432,433.47	1.01
32	Zijin Mining Group Co Ltd	紫金矿业	2899	香港证券交易所	中国香港	52,000.00	427,404.38	0.99
33	Sberbank of Russia PJSC Awaiting Cert	-	SBER RX	莫斯科证券交易所	俄罗斯	26,740.00	410,388.07	0.96
34	Fubon Financial Holding Co Ltd	富邦金	2881	台湾证券交易所	中国台湾	28,000.00	377,943.00	0.88
35	LG Chem Ltd	LG 化学有限公司	051910 KS	韩国证券期货交易所	韩国	141.00	376,074.11	0.88
36	Cathay Financial Holding Co Ltd	国泰金	2882	台湾证券交易所	中国台湾	32,000.00	367,650.24	0.86
37	POSCO Hldgs Inc	-	005490 KS	韩国证券期货交易所	韩国	307.00	365,774.92	0.85
38	Bosideng Intl Holdings Ltd	波司登	3998	香港证券交易所	中国香港	86,000.00	358,211.60	0.83
39	Anglo American plc (UK	英美资源集团	AAL	伦敦证券交易所	英国	1,405.00	336,335.75	0.78

	Listing)							
40	Walmart de Mexico SA de CV	-	WALMEX* MM	墨西哥证券交易所	墨西哥	14,554.00	335,650.27	0.78
41	Chailease Holding Co Ltd	F-中租	5871 TT	台湾证券交易所	中国台湾	6,825.00	321,200.20	0.75
42	China Railway Group Ltd	中国中铁	0390	香港证券交易所	中国香港	74,000.00	306,962.76	0.71
43	Tata Motors Ltd ADR	-	TTM US	纽约证券交易所	美国	1,742.00	302,452.87	0.70
44	China Hongqiao Group Ltd	中国宏桥	1378	香港证券交易所	中国香港	39,500.00	299,662.88	0.70
45	Credicorp Ltd (US Listing)	-	BAP US	纽约证券交易所	美国	356.00	286,495.97	0.67
46	Capitec Bank Holdings Ltd	-	CPI SJ	南非约翰内斯堡证券交易所	南非	320.00	259,845.42	0.60
47	Petronas Chemicals Group Bhd	-	PCHEM MK	马来西亚证券有限公司	马来西亚	18,600.00	254,903.77	0.59
48	PT Telkom Indonesia Persero Tbk	-	TLKM IJ	雅加达证券交易所	印度尼西亚	140,000.00	252,282.87	0.59
49	United Microelectronics Corp Ltd	联电	2303	台湾证券交易所	中国台湾	28,000.00	247,432.58	0.58
50	Shoprite Holdings Ltd	-	SHP SJ	南非约翰内斯堡证券交易所	南非	3,050.00	247,249.08	0.58
51	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	-	009150 KS	韩国证券期货交易所	韩国	363.00	244,862.20	0.57
52	Kunlun	昆仑能源	0135	香港证	中国香港	44,000.00	241,978.00	0.56

	Energy Co Ltd			券交易所				
53	S-Oil Corp	-	010950 KS	韩国证券期货交易所	韩国	449.00	241,370.56	0.56
54	Ambev SA ADR	-	ABEV US	纽约证券交易所	美国	13,948.00	234,962.62	0.55
55	Industrial Bank of Korea	-	024110 KS	韩国证券期货交易所	韩国	4,340.00	215,823.30	0.50
56	Want Want China Holdings Ltd	中国旺旺	0151	香港证券交易所	中国香港	37,000.00	215,808.93	0.50
57	COSCO SHIP HOLD	中远海控	1919	香港证券交易所	中国香港	23,000.00	215,600.93	0.50
58	China Int Capita-H	中金公司	3908	香港证券交易所	中国香港	14,800.00	211,646.08	0.49
59	Grupo Financiero Banorte SA	-	GFNORTEO MM	墨西哥证券交易所	墨西哥	5,630.00	210,072.18	0.49
60	PT Astra International Tbk	-	ASII IJ	雅加达证券交易所	印度尼西亚	70,300.00	209,817.13	0.49
61	ASE Ind Hldg Ltd	日月光投控	3711	台湾证券交易所	中国台湾	12,000.00	206,938.69	0.48
62	Novatek Microelectronics Corp Ltd	联咏	3034	台湾证券交易所	中国台湾	3,000.00	204,500.93	0.48
63	Grupo Mexico SAB De CV 'B'	-	GMEXICOB MM	墨西哥证券交易所	墨西哥	7,323.00	202,843.47	0.47
64	Clicks Group Ltd	-	CLS SJ	南非约翰内斯堡证券交易所	南非	1,805.00	202,099.70	0.47
65	BB	-	BBSE3 BZ	圣保罗	巴西	6,002.00	199,966.75	0.47

	Seguridade Participacoes SA			证券交易所				
66	China Resources Gas Group Ltd	华润燃气	1193	香港证券交易所	中国香港	6,000.00	187,564.60	0.44
67	Cia Energetica de Minas Gerais ADR	-	CIG US	纽约证券交易所	美国	13,352.00	181,013.44	0.42
68	MTN Group Ltd	-	MTN SJ	南非约翰内斯堡证券交易所	南非	3,302.00	178,614.01	0.42
69	EDP - Energias do Brasil SA	-	ENBR3 BZ	圣保罗证券交易所	巴西	6,246.00	164,408.68	0.38
70	Sao Martinho SA	-	SMT03 BZ	圣保罗证券交易所	巴西	3,369.00	157,080.95	0.37
71	CEZ as	-	CEZ CP	布拉格证券交易所	捷克	519.00	156,493.48	0.36
72	Bank Pekao SA	-	PEO PW	华沙证券交易所	波兰	1,268.00	154,344.54	0.36
73	BGF Retail Co Ltd/New	-	282330 KS	韩国证券期货交易所	韩国	153.00	149,471.31	0.35
74	LG Innotek Co Ltd	-	011070 KS	韩国证券期货交易所	韩国	82.00	145,170.72	0.34
75	SLC Agricola SA	-	SLCE3 BZ	圣保罗证券交易所	巴西	2,513.00	142,325.76	0.33
76	Nanya Technology Corp	南亚科技	2408	台湾证券交易所	中国台湾	12,000.00	133,805.91	0.31
77	Gold Fields Ltd Sponsored	-	GFI US	纽约证券交易所	美国	2,178.00	133,310.95	0.31

	ADR							
78	SITC Intl Holdings Co Ltd	海丰国际	1308	香港证券交易所	中国香港	7,000.00	132,911.71	0.31
79	Korea Gas Corp	-	036460 KS	韩国证券期货交易所	韩国	649.00	132,677.05	0.31
80	MOL Hungarian Oil & Gas plc	-	MOL HB	布达佩斯股票交易所	匈牙利	2,517.00	129,874.57	0.30
81	Infosys Ltd ADR	-	INFY US	纽约证券交易所	美国	1,031.00	128,079.08	0.30
82	Vodacom Group Ltd	-	VOD SJ	南非约翰内斯堡证券交易所	南非	2,331.00	125,221.03	0.29
83	Sanlam Ltd	-	SLM SJ	南非约翰内斯堡证券交易所	南非	5,630.00	121,941.25	0.28
84	Lite-On Technology Corp	光宝科技	2301	台湾证券交易所	中国台湾	9,000.00	117,621.89	0.27
85	SK Telecom Co Ltd	-	017670 KS	韩国证券期货交易所	韩国	436.00	117,191.05	0.27
86	Porto Seguro SA	-	PSSA3 BZ	圣保罗证券交易所	巴西	5,136.00	117,064.47	0.27
87	Bidvest Group Ltd	-	BVT SJ	南非约翰内斯堡证券交易所	南非	1,349.00	115,828.51	0.27
88	Evergreen Marine Corp	长荣海运	2603	台湾证券交易所	中国台湾	6,000.00	114,574.69	0.27
89	Dino Polska SA	-	DNP PW	华沙证券交易所	波兰	237.00	112,860.08	0.26
90	Airtel Africa PLC	-	AAF	伦敦证券交易所	英国	10,069.00	110,957.29	0.26

91	Powszechny Zakład Ubezpieczenia SA	-	PZU PW	华沙证券交易所	波兰	2,352.00	105,261.67	0.24
92	Arca Continental SAB de CV	-	AC* MM	墨西哥证券交易所	墨西哥	2,386.00	105,164.64	0.24
93	Copa Holdings SA 'A'	科帕控股 (COPA)	CPA	纽约证券交易所	美国	247.00	105,049.45	0.24
94	Pan Ocean Co Ltd (KR Listing)	-	028670 KS	韩国证券期货交易所	韩国	3,401.00	104,423.37	0.24
95	Kuala Lumpur Kepong Bhd	-	KLK MK	马来西亚证券有限公司	马来西亚	3,100.00	103,566.46	0.24
96	Truworths Intl Ltd	-	TRU SJ	南非约翰内斯堡证券交易所	南非	4,910.00	101,901.28	0.24
97	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	-	ASURB MM	墨西哥证券交易所	墨西哥	746.00	98,078.13	0.23
98	Cencosud SA	-	CENCOSUD CI	圣地亚哥证券交易所	智利	10,999.00	92,030.58	0.21
99	Gerdau SA Preferencia	-	GGBR4	圣保罗证券交易所	巴西	3,050.00	87,485.18	0.20
100	Orbia Advance Corp SAB de CV	-	ORBIA* MM	墨西哥证券交易所	墨西哥	4,501.00	70,460.28	0.16
101	Marfrig Global Foods SA	-	MRFG3 BZ	圣保罗证券交易所	巴西	4,465.00	69,394.13	0.16
102	Sibanye Stillwater	-	SBSW US	纽约证券交易所	美国	1,027.00	68,719.30	0.16

	Ltd			所				
103	Gruma SAB de CV 'B'	-	GRUMAB MM	墨西哥证券交易所	墨西哥	792.00	58,632.20	0.14
104	Grupo Aeroportuario del Pacifico SA de CV 'B'	-	GAPB MM	墨西哥证券交易所	墨西哥	620.00	57,766.06	0.13
105	Gazprom PAO ADR Awaiting Cert	-	OGZD LI	伦敦证券交易所	英国	12,871.00	50,222.75	0.12
106	Magnitogorsk Iron & Steel Works GDR	-	MMK LI	伦敦证券交易所	英国	1,684.00	22,604.00	0.05
107	Severstal Cherepovets GDR	-	SVST LI	伦敦证券交易所	英国	985.00	397.31	0.00

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	TSM US	1,013,171.23	1.90
2	NetEase Inc	9999	973,386.93	1.83
3	Samsung Electronics Co Ltd	005930 KS	818,216.97	1.54
4	Tencent Holdings Ltd	H700 HK	800,418.21	1.50
5	PetroChina Co Ltd 'H'	H857 HK	625,034.65	1.17
6	HAIER SMARTHOME	6690	611,300.54	1.15
7	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H'	H2238 HK	558,870.13	1.05
8	Reliance Industries Ltd GDR	RIGD LI	550,724.91	1.03
9	JD.com Inc	9618	540,135.53	1.01

10	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	H2269 HK	529,962.41	1.00
11	Haitian Intl Holdings Ltd	1882 HK	503,327.94	0.95
12	America Movil SAB de CV ADR	AMX US	490,289.44	0.92
13	Anglo American plc (UK Listing)	AAL	454,818.76	0.85
14	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd 'H'	H2318 HK	442,345.53	0.83
15	Zijin Mining Group Co Ltd 'H'	H2899 HK	435,056.08	0.82
16	GF SEC	1776	407,027.29	0.76
17	China Resources Land Ltd	H1109 HK	404,663.65	0.76
18	Postal Savings Bank Corp Ltd 'H'	H1658 HK	357,744.87	0.67
19	China Railway Group Ltd 'H' (H1)	H390 HK	343,427.57	0.65
20	PT Telekomunikasi Indonesia	TLKM IJ	330,762.36	0.62

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Ltd	H700 HK	1,430,274.04	2.69
2	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	TSM US	958,156.54	1.80
3	Meituan Dianping	3690	907,034.85	1.70
4	Infosys Ltd ADR	INFY US	813,114.73	1.53
5	Country Garden Services Hold Shares	6098	753,175.47	1.41
6	ZHONGSHENG HLDG	0881	699,699.66	1.31
7	Alibaba Group Hldg Ltd	9988	670,710.04	1.26
8	Haitian Intl Holdings Ltd	1882 HK	637,630.83	1.20
9	Yuanta Financial Holding Co Ltd	2885 TT	587,213.16	1.10
10	Samsung Electronics Co Ltd	005930 KS	559,575.57	1.05
11	Li Ning Co Ltd	Z2331 HK	526,521.43	0.99
12	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	3669 HK	525,962.06	0.99
13	SK Hynix Inc	000660 KS	508,969.00	0.96
14	GF SEC	1776	462,049.70	0.87
15	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd 'H'	H2318 HK	451,157.85	0.85

16	Mining & Metallurgical Co Norilsk Nickel ADR	MNOD LI	421,529.44	0.79
17	China Resources Beer (Holdings) Co Ltd	H291 HK	389,744.44	0.73
18	Mercadolibre Inc	MELI US	343,088.55	0.64
19	Novatek Microelectronics Corp Ltd	3034	306,455.18	0.58
20	MEIDONG AUTO	1268	283,014.77	0.53

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	20,285,263.62
卖出收入（成交）总额	20,910,405.62

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

### 7.11 本报告期投资基金情况

#### 7.11.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	312,152.29
4	应收利息	-
5	应收申购款	115,836.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	427,988.38

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

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。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额	持有份额	占总份额

			比例		比例
7,404	6,149.74	-	0.00%	45,532,642.05	100.00%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年1月30日）基金份额总额	349,551,403.11
本报告期期初基金份额总额	43,942,748.38
本报告期基金总申购份额	7,838,059.37
减：本报告期基金总赎回份额	6,248,165.70
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	45,532,642.05

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：无。

基金托管人：无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 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的情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人、托管人未受稽查或处罚，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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 Limited	1	19,218,083.31	47.63%	24,565.00	49.51%	-
Citigroup Global Mkts Ltd	1	14,645,697.85	36.30%	18,177.92	36.64%	-
Goldman Sachs Sec	1	3,405,271.83	8.44%	2,975.31	6.00%	-
Instinet Ltd	1	1,913,360.04	4.74%	2,677.11	5.40%	-
Nomura International Limited	1	823,251.86	2.04%	822.69	1.66%	-
Morgan Stanley Corporation	1	345,966.40	0.86%	396.64	0.80%	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Ltd	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
China Int'l Capital Corp HK Secs	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
Masterlink Securities Corp	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
CREDIT SUISSE LIMITED	1	0.00	0.00%	-	0.00%	-
ICBC International Securities Ltd	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
Fubon Securities Company Limited	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
JP Morgan Secs (Asia Pacific) Ltd	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
Merrill Lynch	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

CCB International Securities Limite	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
China Merchants Securities (HK)	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
China Everbright Securities (HK) Li	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
SinoPac Securities Corporation	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
BOCI Securities Limited	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
HSBC Hong Kong	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
Haitong Intl Secs Co Ltd	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 交易单元的选择标准：

- 1) 资本金雄厚,信誉良好。
- 2) 财务状况良好,经营行为规范。
- 3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

5) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 交易单元的选择程序：

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. 本报告期无新增席位，无注销席位。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
UBS Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Mkts Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Sec	-	-	-	-	-	-	-	-
Institut Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura International Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-

China Int'l Capital Corp HK Secs	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Masterlink Securities Corp	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CRE DIT SUISSE LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBC International Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Fubon Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Secs (Asia Pacific) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Merrell Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-	-

CCB Inter natio nal Secur ities Limit e	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Chin a Merc hants Secur ities (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Chin a Ever brigh t Secur ities (HK) Li	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Sino Pac Secur ities Corp oratio n	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BOC I Secur ities Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HSB C Hong Kong	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Haito ng Intl Secs	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Co Ltd								
-----------	--	--	--	--	--	--	--	--

## 10.8 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	上投摩根基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2022-01-05
2	上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	同上	2022-01-11
3	上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金分红公告	同上	2022-01-17
4	上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	同上	2022-01-20
5	上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告	同上	2022-04-13
6	上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	同上	2022-05-05

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

## 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

## 12.3 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.cifm.com](http://www.cifm.com)

上投摩根基金管理有限公司

二〇二二年八月三十一日