**上投摩根亚太优势混合型证券投资基金**

**2021年第2季度报告**

**2021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：中国工商银行股份有限公司**

**报告送出日期：二〇二一年七月二十一日**

# §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2021年7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2021年4月1日起至6月30日止。

# §2 基金产品概况

|  |  |
| --- | --- |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,315,055,548.82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，同时采取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 | 本基金为区域性混合型证券投资基金，基金投资风险收益水平低于股票型基金，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混合型基金。 |
| 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 | JPMORGAN ASSET MANAGEMENT (ASIA PACIFIC) LIMITED |
| 境外投资顾问中文名称 | 摩根资产管理(亚太)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(2021年4月1日-2021年6月30日) |
| 1.本期已实现收益 | 1,227,428,616.08 |
| 2.本期利润 | 3,013,430.79 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0009 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,636,659,472.99 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0970 |

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 | 0.09% | 0.97% | 1.67% | 0.69% | -1.58% | 0.28% |
| 过去六个月 | 0.09% | 1.41% | 4.79% | 1.00% | -4.70% | 0.41% |
| 过去一年 | 27.26% | 1.32% | 24.61% | 0.99% | 2.65% | 0.33% |
| 过去三年 | 41.91% | 1.30% | 26.92% | 1.16% | 14.99% | 0.14% |
| 过去五年 | 91.45% | 1.14% | 64.77% | 1.01% | 26.68% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.70% | 1.35% | 8.11% | 1.33% | 1.59% | 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**

上投摩根亚太优势混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2007年10月22日至2021年6月30日）



注：本基金合同生效日为2007年10月22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、投资董事 | 2008-03-08 | - | 17年（金融领域从业经验28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。 |
| 张淑婉 | 本基金基金经理 | 2016-12-16 | 2021-06-01 | 30年 | 张淑婉女士，台湾大学财务金融研究所MBA，自1987年9月至1989年2月，在东盟成衣股份有限公司担任研究部专员；自1989年3月至1991年8月，在富隆证券股份有限公司担任投行部专员；自1993年3月至1998年1月，在光华证券投资信托股份有限公司担任研究部副理；自1998年2月至2006年7月，在摩根富林明证券信托股份有限公司担任副总经理；自2007年11月至2009年8月，在德意志亚洲资产管理公司担任副总经理；自2009年9月至2014年6月，在嘉实国际资产管理公司担任副总经理；自2014年7月至2016年8月，在上投摩根资产管理（香港）有限公司担任投资总监。自2016年9月起加入上投摩根基金管理有限公司，自2016年12月至2021年5月同时担任上投摩根亚太优势混合型证券投资基金基金经理及上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金基金经理，自2017年12月至2021年6月同时担任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2018年6月至2021年6月同时担任上投摩根香港精选港股通混合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。

**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 |
| Ayaz Ebrahim | 摩根资产管理(亚太)董事总经理，投资经理，位于香港的新兴市场和亚太地区（EMAP）股票团队中亚太地区团队的联席主管，以及亚太资产配置委员会主席 | 31年 | Ayaz Ebrahim，董事总经理，任投资经理兼位于香港的新兴市场和亚太地区（EMAP）股票团队中亚太地区团队的联席主管。他还担任亚太资产配置委员会主席。在2015年9月加入摩根资产管理公司之前，Ayaz曾在东方汇理资产管理香港有限公司任职，在该公司担任亚洲（除日本外）股票团队的首席投资官（CIO）和副首席执行官（CEO）超过五年。在此之前，Ayaz曾担任汇丰银行全球资产管理公司和德意志资产管理公司的亚太区首席投资官（CIO）。从1991年到2002年，他在CréditAgricole资产管理公司（香港）（现更名为东方汇理资产管理香港有限公司）工作，曾任投资经理、亚洲首席投资官（CIO）。Ayaz拥有英国东英吉利大学的民法博士学位（DCL）和会计理学学士学位（荣誉学位）。 |
| Julian Wong | 摩根资产管理(亚太) 副总裁，新兴市场和亚太地区（EMAP）股票团队中亚太股票的产品分析师 | 11年 | Julian Wong，副总裁，是新兴市场和亚太地区（EMAP）股票团队中亚太股票的产品分析师。他常驻香港，于2014年加入公司，担任EMAP股票团队的初级投资专家。在此之前，Julian是德勤（Deloitte）的管理顾问，并曾在施罗德投资管理公司（Schroder Investment Management）工作。Julian拥有香港大学信息系统和金融专业的工商管理学士学位。他还是特许金融分析师。 |

**4.3管理人对报告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、《上投摩根亚太优势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 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**

继去年年初至今年2月期间经历了非常强劲的走势后，亚洲股市一度在过去几个月里回吐了部分涨幅，但自5月下旬开始再次反弹。成长型股票自2月份以来一直引领下跌，5月份的逆转帮助亚洲市场再次走高。尽管如此，由于中国成长型股票自2月份以来已经修正了20%以上，估值现在看起来更有吸引力。我们认为，投资者对中国政策收紧的担忧过头了，中国和其他亚洲股市的长期前景依然有吸引力。

报告期内的经济数据非常强劲，但在今年年初已经强劲之后，市场表现相对平淡。目前正在推出的疫苗计划，正使许多经济体得以逐步重新开放，再加上大量财政支持，尤其是在英国和美国，正支持经济活动大幅反弹。然而，市场在5月份受到了限制，因为市场担心通胀，可能迫使各国央行过早地结束增长的反弹。由于美联储官员一直发言淡化通胀压力，强调对待加息与否会保持耐心，股市在6月有所反弹。

亚洲的增长正处于一个震荡的上升周期，而且可能会在出口和国内需求方面变得更加广泛。疫苗的支点在前面,一些经济体可能会在第三季度突破50%以上接种率，从而使消费支出能够迎头赶上。在科技超级周期中芯片短缺给东北亚带来了好处，更好的复原力支持消费。在东南亚和印度,不断上升的感染病例和更严格的政府限制可能会拖累近期国内需求。我们预计新加坡和中国台湾将成为该地区增长的领头羊,而泰国和菲律宾可能会落后。通货膨胀的驱动因素可能会从供应方转向需求驱动方,但仍大致处于央行的目标范围内。尽管通胀不断上升，但中国政府在实现政策正常化时，仍将坚持“不急转弯”的承诺。在韩国方面，强劲的出口和消费应该会支撑经济增长的上行周期，但央行很可能会保持政策利率不变，印度的第二波疫情浪潮应该会放缓近期的增长，但中期的上升周期和政策的规范化保持不变。世界范围内关于疫苗效力的数据仍然基本上是积极的，在那些疫苗推广进展足以保护最脆弱年龄组的国家，住院率较低。印度悲惨的健康危机突出了在全球迅速推出疫苗的必要性。到目前为止，印度注射了超过1.9亿种疫苗，仅落后于美国和中国迄今提供的疫苗总数。这一进展，再加上相对年轻的人口，带来了希望，印度最严重的健康危机可能会在几个月内结束。印度尼西亚的债务货币化和经常账户赤字导致的通胀上升可能考验货币政策的可信度。澳大利亚的经济复苏仍在继续，央行的指引应在7月初变得不那么温和。

展望后市，今年下半年的经济前景看上去是光明的，特别是那些在疫苗推广方面遥遥领先的国家。随着越来越多的国家加大接种疫苗的力度，经济复苏应该会扩大。问题不在于增长是否会强劲，而在于它将有多强劲。市场的担忧在于各国央行将如何应对经济增长可能出现的进一步增长的意外。投资者尤其担心，如果事实证明通胀确实是持续性的，而非暂时性的，那么各国央行可能不得不迅速提高利率，以减缓经济过热的速度。这种担忧造成了一些市场波动。然而，我们认为，在通胀温和上升的环境下，股市应该表现良好，因为不断上升的销售往往会抵消更高的投入价格，而当需求强劲时，更高的投入价格可以转嫁给消费者。在股市中寻找既能从周期性反弹中受益，又能从债券收益率上升中受益的领域。

整体而言，股市今年开局强劲，我们相信经济和股市的前景依然乐观。以美国和中国为首的全球企业利润正在迅速恢复。我们认为，利润将继续强劲增长，并超过预期，尽管我们需要警惕税收和通胀上升，因为这将是应对疫情的潜在成本。由于利润大幅增长，今年股市实现了强劲回报，但高估值削弱了投资人的热情。近期投机活动有所缓和，这是一个比较健康的迹象。但便宜股票和昂贵股票之间的差距仍然非常大，这表明存在大量的选股机会。

当然，市场已经认识到这一利好消息的大部分。全球市场的高估值大大缓和了我们的回报预期。除了股票和固定收益之间的比较之外，估值指标都比较高。通胀的发展和央行在这一事件中的反应速度将是需要关注的关键问题。

本报告期亚太优势份额净值增长率为: 0.09%，同期业绩比较基准收益率为: 1.67%。

**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 | 3,334,416,402.85 | 90.70 |
|  | 其中：普通股 | 3,183,530,378.77 | 86.60 |
|  | 存托凭证 | 150,886,024.08 | 4.10 |
|  | 优先股 | - | - |
|  | 房地产信托 | - | - |
| 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 | 330,794,090.50 | 9.00 |
| 8 | 其他各项资产 | 10,919,907.10 | 0.30 |
| 9 | 合计 | 3,676,130,400.45 | 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（％） |
| 中国香港 | 1,286,276,987.94 | 35.37 |
| 中国台湾 | 497,269,341.99 | 13.67 |
| 韩国 | 493,062,622.73 | 13.56 |
| 澳大利亚 | 375,864,639.73 | 10.34 |
| 印度 | 252,112,679.37 | 6.93 |
| 美国 | 174,900,364.95 | 4.81 |
| 印度尼西亚 | 121,147,183.98 | 3.33 |
| 新加坡 | 80,674,634.21 | 2.22 |
| 泰国 | 53,107,947.95 | 1.46 |
| 合计 | 3,334,416,402.85 | 91.69 |

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（％） |
| 商业银行 | 390,007,511.22 | 10.72 |
| 半导体产品与设备 | 324,351,484.18 | 8.92 |
| 互联网与售货目录零售 | 322,991,023.13 | 8.88 |
| 互动媒体与服务Ⅲ | 272,484,136.43 | 7.49 |
| 电脑与外围设备 | 255,017,962.25 | 7.01 |
| 保险 | 199,553,044.90 | 5.49 |
| 纺织品、服装与奢侈品 | 142,691,845.71 | 3.92 |
| 资本市场 | 136,214,970.29 | 3.75 |
| 生物科技 | 122,859,486.79 | 3.38 |
| 酒店、餐馆与休闲 | 118,145,329.64 | 3.25 |
| 房地产管理和开发 | 115,670,477.89 | 3.18 |
| 生命科学工具和服务 | 86,554,043.30 | 2.38 |
| 食品与主要用品零售Ⅲ | 71,840,857.33 | 1.98 |
| 石油、天然气与消费用燃料 | 61,237,710.62 | 1.68 |
| 金属与采矿 | 57,076,084.96 | 1.57 |
| 娱乐 | 56,464,548.48 | 1.55 |
| 机械制造 | 53,942,559.54 | 1.48 |
| 专业服务 | 50,843,080.07 | 1.40 |
| 交通基本设施 | 45,254,622.56 | 1.24 |
| 建筑与工程 | 43,849,311.20 | 1.21 |
| 汽车 | 43,022,041.58 | 1.18 |
| 饮料 | 41,764,716.25 | 1.15 |
| 商业服务与商业用品Ⅲ | 39,416,349.19 | 1.08 |
| 综合电信业务 | 36,510,179.61 | 1.00 |
| 家庭耐用消费品 | 34,907,947.32 | 0.96 |
| 股权房地产投资信托 （REITs） | 32,207,330.46 | 0.89 |
| 软件 | 29,818,418.88 | 0.82 |
| 汽车零配件 | 27,599,101.18 | 0.76 |
| 个人用品 | 27,523,049.10 | 0.76 |
| 建筑材料 | 27,279,462.41 | 0.75 |
| 电子设备、仪器和元件 | 25,220,647.74 | 0.69 |
| 贸易公司与经销商Ⅲ | 23,012,324.65 | 0.63 |
| 互助储蓄银行与抵押信贷 | 19,084,743.99 | 0.52 |
| 合计 | 3,334,416,402.85 | 91.69 |

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 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 台积电 | 2330 | 台湾证券交易所 | 中国台湾 | 1,810,000.00 | 249,697,790.73 | 6.87 |
| 2 | Tencent Holdings Ltd | 腾讯控股 | 00700 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 487,200.00 | 236,747,395.58 | 6.51 |
| 3 | Alibaba Group Hldg Ltd | 阿里巴巴-SW | 09988 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 1,209,700.00 | 221,444,778.72 | 6.09 |
| 4 | Samsung Electronics Co Ltd | 三星电子 | 005930 | 韩国证券期货交易所 | 韩国 | 461,889.00 | 213,822,869.66 | 5.88 |
| 5 | AIA Group Ltd | 友邦保险 | 01299 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 1,541,200.00 | 123,751,763.66 | 3.40 |
| 6 | Wuxi Biologics (Cayman) Inc | 药明生物 | 02269 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 731,000.00 | 86,554,043.30 | 2.38 |
| 7 | Yum China Holdings Inc | 百胜中国 | YUMC | 纽约证券交易所 | 美国 | 180,200.00 | 77,122,288.82 | 2.12 |
| 8 | HDFC Bank Ltd | HDFC银行 | HDFCB IN | 印度国家证券交易所 | 印度 | 581,976.00 | 75,764,018.93 | 2.08 |
| 9 | Meituan Dianping | 美团-W | 03690 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 281,100.00 | 74,940,819.24 | 2.06 |
| 10 | SK Hynix Inc | SK海力士 | 000660 | 韩国证券期货交易所 | 韩国 | 102,070.00 | 74,653,693.45 | 2.05 |

**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 | - |
| 3 | 应收股利 | 5,692,562.51 |
| 4 | 应收利息 | 11,037.56 |
| 5 | 应收申购款 | 488,821.80 |
| 6 | 其他应收款 | 3,637,242.28 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | 1,090,242.95 |
| 9 | 合计 | 10,919,907.10 |

**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 | 3,479,672,695.54 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 18,312,508.73 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 182,929,655.45 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 3,315,055,548.82 |

# §7 备查文件目录

**7.1 备查文件目录**

1. 中国证监会批准上投摩根亚太优势混合型证券投资基金设立的文件；

2. 《上投摩根亚太优势混合型证券投资基金基金合同》；

3. 《上投摩根亚太优势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。

**7.2 存放地点**

基金管理人或基金托管人处。

**7.3 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**

**二〇二一年七月二十一日**