

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:二〇一三年三月二十九日
§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的准确性、完整性、及时性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认。

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2013年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

基金托管人并不表示其未尽到本报告所载内容的义务,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本年度报告摘要披露信息日期为2013年3月29日,投资人欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日基金合同生效之日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称:上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金

基金简称:上投摩根健康品质生活股票

基金代码:377150

交易代码:377150

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2012年3月1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

报告期末基金资产总额:146,478,675.36份

基金合同存续期:不定期

2.2 基金产品说明

本基金主要投资于有利于提升居民健康水平和生活品质的行业及公司,力图把握经济结构调整和消费升级带来的投资机会,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

1. 资产配置策略

本基金对大类资产的配置是宏观层面上的,采用定性分析和定量分析相结合的手段,综合宏观经济、宏观经济政策、政策产业、行业景气度、证券市场走势及流动性的分析,积极进行大类资产配置。

影响资产收益的关键驱动因素主要包括基本面和流动性,基本面驱动,主要指在经济周期和市场周期影响下,业绩增长、利率环境、通胀预期等因素的变动,流动性的驱动主要是为货币政策环境变动的影响,具体包括利率、汇率、流动性、机构变动等,随着各大资产收益率特征的相对变化,本基金将适时动态地调整股票、债券和货币市场工具的投资比例。

2. 风险收益特征

人类的健康投资主要来自于两方面,一是延长生命长度,提升健康水平;二是拓展生命的宽度,提高居民收入水平的提升,城镇化进程的推进以及社会保障体系的完善,居民的各方面需求将逐步释放,尤其是对于身体健康和生活品质的追求将逐步提高,由此带来对相关产品和服务的需求的增加,并进而提供此类产品和服务的上市公司成长空间。本基金将围绕健康生活与品质生活这两个大主题,重点关注如何提升居民健康水平与生活质量与生活品质的行业和个股。

3. 托管人

本报告期内,本托管人根据证券投资基金法及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

3.1 托管人对年度报告中财务信息等的准确、完整和完整性的说明

本报告中的财务数据、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、财务报告、托管协议等在托管人处备置,投资人可以查阅。

3.2 托管人对年度报告中本基金管理人投资运作监督情况的说明

本报告期,本托管人对基金管理人的投资运作监督情况未发现异常。

3.3 托管人对年度报告中基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%。

本基金合同生效以来基金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

上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图

2012年2月1日至2012年12月31日

上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图

2012年2月1日至2012年12月31日