

上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金

[2013]第四季度报告

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高级管理人员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、完整性和及时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。

本基金自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	上投摩根健康品质生活股票
基金主代码	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2月1日
报告期末基金份额总额	168,842,835.00份
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，力争把握经济结构调整和消费升级所带来的投资机会。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从宏观层面出发，采用定量分析和定性分析相结合的手段，综合宏观经济、环境、宏观经济政策、产业结构、行业景气度、证券市场的走势和流动性的综合分析，进行资产配置。	
影响资产配置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通胀周期的影响下，业绩增长、利率水平、通胀预期等因素的变化，流动性驱动主要是体现为货币市场环境变化的影响，具体包括汇率变动、流动性结构变动等。随着各类资产风险收益特征的相对变化，本基金将适时动态地调整股票、债券和货币工具市场的投资比例。	
2. 股票投资策略 人类的需求主要来自于两方面：一是延长生命长度，提升健康水平；二是拓展生命的宽度，提高生活质量。随着居民收入水平的提升，城镇化进程的推进以及社会保障体制的完善，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要求会逐步提升。同时，人们对相关产品和服务的需求的增长，将推动提供此类产品和服务的上市公司的快速成长。本基金将围绕健康生活与品质生活两大主题，重点关注有利于提升民众健康水平以及物质生活和精神生活的行业和个股。	
3. 债券投资策略 本基金是一只主动投资的股票型基金，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，属于主要类型为混合型基金。本基金的风险和预期收益可能高于全场股票型基金，也高于纯债型基金，债券收益率和货币市场基金，属于较低风险，较高等预期收益率的产品。	
4. 货币市场工具投资策略 本基金的货币市场工具投资主要通过申购新股、新股增发、股票回购、现金分红、定期定额投资、短期融资券、回购协议、逆回购、同业存单、短期国债、货币基金、银行存款、货币市场基金、货币型理财产品、货币型基金、货币型基金等品种。	
5. 其他投资策略 本基金不参与二级市场股票买卖，但可以参与一级市场股票的发行定价。	
6. 报告期内基金的业绩表现 本基金在报告期内实现了较高的收益，超额收益显著，超越基准指数。	
7. 风险揭示 本基金的业绩表现并不代表未来表现。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。	
本基金自2013年10月1日起至2013年12月31日止。	

注:本期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份额时所发生的费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投费、基金转换费等),也不反映持有人认购或交易基金份额后所取得的盈亏。

3.2 报告期内基金的业绩表现

3.2.1 报告期内基金的业绩表现

3.2.2 报告期内基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3 报告期内基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年2月1日至2013年12月31日)



注:本基金建仓期自2012年2月1日至2012年7月31日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。本基金合同生效日为2012年2月1日,报告期截至日为2012年2月1日至2013年12月31日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人(或基金经理小组)简介

姓名 职务 在任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

姓名	职务	在任日期	离任日期	说明
董红波	本基金基金经理	2012-2-1	-	11年 管理硕士,曾任银行总行资产管理部总经理及总行公司金融部总经理,现担任本公司副总经理兼首席投资官。从事金融行业工作11年,具有丰富的投资经验。

注: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.董事波先生为本基金基金经理,其任职日期同上。

3.本基金基金经理的任职资格符合《证券投资基金法》及中国证监会规定的有关法律法规。

4.2 管理人报酬

4.2.1 基金管理人报酬

4.2.2 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金管理费

4.2.3 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.4 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.5 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.6 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.7 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.8 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.9 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.10 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.11 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.12 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.13 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.14 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.15 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.16 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.17 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.18 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.19 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.20 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.21 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.22 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.23 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.24 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.25 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.26 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.27 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.28 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.29 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.30 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.31 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.32 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.33 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.34 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.35 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.36 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.37 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.38 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.39 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.40 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.41 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.42 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.43 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.44 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.45 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.46 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.47 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.48 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.49 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.50 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.51 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.52 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.53 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.54 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.55 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.56 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.57 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.58 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.59 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.60 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.61 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.62 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.63 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.64 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.65 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.66 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.67 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.68 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.69 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.70 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.71 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.72 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.73 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.74 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.75 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.76 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.77 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.78 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费

4.2.79 基金管理人根据有关规定从基金财产中计提的基金销售服务费