

# 上投摩根内需动力混合型证券投资基金

## [2015]第三季度报告

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:二〇一五年十月二十六日

§ 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。

基金托管人和中国工商银行业务部门根据公司与基金托管人签署的基金合同规定，于2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核结果不存在虚假记载、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。

本基金的基本名称自2015年7月21日起变更为“上投摩根内需动力股票型证券投资基金”更名为“上投摩根内需动力混合型证券投资基金”。该变更不涉及基金份额持有人权利义务关系的变化，亦不涉及投资目标、投资范围、净值表现及投资策略等内容，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告期对基金财产未进行审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,371,798,964.00	77.94
其中: 股票			
141,347,506.46	4.61		
141,347,506.46	4.61		
债券			
货币市场基金			
权证及其他			
贵金属投资			
金融衍生品投资			
买入返售金融资产			
其中: 实质性持有的买入返售金融资产			
银行存款和结算备付金合计	515,074,488.15	16.79	
其他各项资产	38,628,432.85	1.26	
合计	3,096,484,391.52	100.00	

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -143,813,798.03

2.本期利润 -1,279,219,740.18

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0546

4.期末基金份额净值 2,973,267,942.61

5.期末基金份额净值 1.1862

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,本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

基金本期应收利息不包含持有人认购或申购基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投费、基金转换费等),计入申购或赎回时基金资产净值予以列示。

3.2 基金的表决权

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益率比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差值(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -28.89% 3.93% -22.46% 2.07% -6.44% 1.26%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化图与其同期基准收益率变化图

(2007年4月13日至2015年9月30日)

注:本基金合同生效日为2007年4月13日,图示时间段为2007年4月13日至2015年9月30日。

本基金建仓期自2007年4月13日至2007年10月12日,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间 证券从业年限 说明

杜猛 本基金基金经理、投资一部投资总监 2014-12-19 - 12年 南开大学经济学学士,先后就职于中国银河证券、中信证券,担任过研究所研究员、项目经理、高级分析师,现任基金经理。2007年7月起加入上投摩根基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理,2013年6月起担任基金经理,2013年6月起至2014年2月担任上投摩根动力配置基金和上投摩根动力平衡基金基金经理,2014年2月起至2015年3月担任上投摩根内需动力混合型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期即聘任日期或指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。  
2.证券从业的含义见《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作的整体情况的说明

报告期内,本公司继续贯彻执行《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,严格执行防范利益输送的内部控制制度,通过部门和人员相结合的方式进行交易执行和监控分析,以确保公司管理的不同投资组合在授权范围内公平交易,从而最大限度地降低交易成本,提高整体投资绩效。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易执行的情况

报告期内,本公司严格执行《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,严格执行防范利益输送的内部控制制度,通过部门和人员相结合的方式进行交易执行和监控分析,以确保公司管理的不同投资组合在授权范围内公平交易,从而最大限度地降低交易成本,提高整体投资绩效。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,通过对不同时间点交易价格和交易量的分析,未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.3.3 投资组合类别的同日反向交易情况

报告期内,所有投资组合类别的同日反向交易均遵循了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根内需动力混合型证券投资基金基金合同》的规定,基金经理对个股和投资组合的比例如符合基金合同的规定。

4.4 报告期内基金管理人的业绩表现

本报告期内本基金份额净值增长率为-28.89%,同期业绩比较基准收益率为-22.45%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -2,689,269.02

2.本期利润 -7,490,550.45

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0546

4.期末基金份额净值 27,076,119.45

5.期末基金份额净值 1.1862

注:本基金在收取申购款项时扣除申购费用,收入部分扣除收入后,净额部分归入基金资产,本报告期无此项目。

本基金在支付赎回款项时扣除赎回费用,收入部分扣除收入后,净额部分归入基金资产,本报告期无此项目。

本基金在申购赎回时扣除申购赎回费用,收入部分扣除收入后,净额部分归入基金资产,本报告期无此项目。

本基金