上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

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:二〇一六年三月三十日

§1 重要提示

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。本年度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2016年3月29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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年6月2日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	上投摩根动态多因子混合
基金主代码	001219
交易代码	001219
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月2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	1,177,272,125.52份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上,采用量化投资对基金资产进行积极管理,力争获取超越业绩基准的投资收益。
投资策略	本基金采用数量化选股模型驱动的选股策略进行个股选择,并结合适当的资产配置策略搭建基金投资组合。 在资产配置过程中,本基金将从多角度综合评估各个行业的投资价值,对基金资产在行业间分配进行安排,同时将采用多种数量化的投资方法控制净值大幅回撤风险,改善投资组合的风险收益特征。 在股票投资过程中,本基金将保持通过动态多因子模型选股构建股票投资组合的投资策略,强调投资纪律,降低随意性投资带来的风险,力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金产品,预期风险和收益水平高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于较高风险收益水平的基金产品。

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	胡迪	田青
	联系电话	021-38794888	010-67595096
	电子邮箱	services@cifm.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-4888	010-67595096
传真		021-20628400	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cifm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年6月2日(基金合同生效日)至2015年12月31日
本期已实现收益	-273,724,616.23
本期利润	-221,338,189.84
加权平均基金份额本期利润	-0.1708
本期基金份额净值增长率	-11.30%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1770
期末基金资产净值	1,043,690,687.18
期末基金份额净值	0.887

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,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

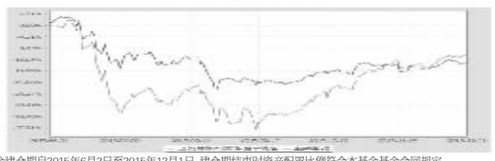
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	32.78%	1.41%	10.84%	1.00%	21.94%	0.41%
过去六个月	6.48%	2.24%	-8.47%	1.61%	14.95%	0.63%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-11.30%	2.41%	-14.38%	1.67%	3.08%	0.74%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%

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

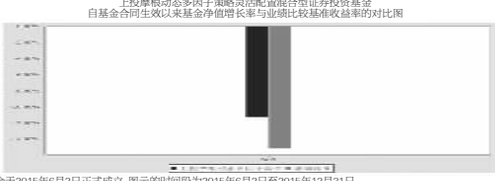
上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年6月2日至2015年12月31日)



注:本基金建仓期自2015年6月2日至2015年12月1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2015年6月2日,图示时间段为2015年6月2日至2015年12月31日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金于2015年6月2日正式成立,图示的时间段为2015年6月2日至2015年12月31日。
合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况
本基金过去三年未进行利润分配。

§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2015年12月底,公司管理的基金共有四十七只,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、上投摩根新兴动力混合型证券投资基金、上投摩根分红添利债券型证券投资基金、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、上投摩根轮动添利债券型证券投资基金、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、上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金、上投摩根岁岁金定期开放债券型证券投资基金、上投摩根红利回报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、上投摩根安心回报混合型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根信息产业混合型证券投资基金、上投摩根优质企业股票型证券投资基金、上投摩根信息传输主题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、上投摩根双添利债券型证券投资基金、上投摩根稳健增利债券型证券投资基金、上投摩根新趋势股票型证券投资基金、上投摩根策略精选股票型证券投资基金、上投摩根多维动力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、上投摩根智享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和上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
黄栋	本基金基金经理、量化投资部总监	2015-06-02	-	11年	上海财经大学经济学硕士;2005年至2010年先后在东方证券、工银瑞信基金从事金融工程研究工作;2010年7月起加入上投摩根基金管理有限公司,主要负责金融工程研究方面的工作。2012年9月起担任上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金基金经理,2013年7月起同时担任上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2015年6月起同时担任上投摩根动态多因子策略灵活配置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. 黄栋先生为本基金首任基金经理,其任职日期指本基金基金合同生效之日。
3. 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 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。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、《上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金合同》的规定。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。

本报告期内中国证监会上海监管局对公司进行了常规全面现场检查,就公司内部控制提出了相应改进意见并采取责令改正的行政监管措施,公司已经按照要求完成了改进工作。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理人公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求,制订了《上投摩根基金管理有限公司公平交易制度》,规范了公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动,同时涵盖了授权、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各个环节,以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

公司执行日上而下的三级投权体系,依次为投资决策委员会、投资总监、经理人在其授权范围内自主决策,投资决策委员会和投资总监均不得干预其授权范围内的投资活动。公司已建立客观的研究方法,严禁利用内幕信息作为投资依据,各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立集中交易制度,执行公平交易分配:对于交易所市场投资活动,不同投资组合在实现同一企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为税收收益。债券投资在持有期间应按税前利息率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动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。

7.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人按额实托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站(www.cifm.com)的年度报告正文。

8.4报告期内股票投资组合的情况

8.4.1累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002350	北京科锐	46,934,908.61	4.50
2	600629	华建集团	46,790,958.27	4.48
3	002618	丹邦科技	46,622,141.08	4.47
4	300354	东华测试	46,580,907.77	4.46
5	000728	国元证券	45,933,198.55	4.40
6	300139	晓程科技	45,437,081.08	4.35
7	601958	金钼股份	44,940,410.82	4.31
8	002469	三维工程	44,876,276.06	4.30
9	002595	豪迈科技	42,383,678.31	4.06
10	300235	方直科技	40,634,382.11	3.89
11	000798	中水渔业	40,583,115.91	3.89
12	000686	东北证券	40,077,900.74	3.84
13	600419	天润乳业	38,887,783.02	3.73
14	600459	贵研铂业	38,830,046.16	3.72
15	300224	正海磁材	38,816,768.01	3.72
16	300270	中威电子	38,529,717.64	3.69
17	300107	建新股份	38,264,686.81	3.67
18	300050	世纪鼎利	37,965,966.54	3.64
19	300179	四方达	37,875,228.85	3.63
20	002107	沃华医药	37,746,442.05	3.62
21	002700	新疆浩源	37,579,810.21	3.60
22	300200	高盟新材	37,496,634.89	3.59
23	002495	佳隆股份	37,180,014.24	3.56
24	000413	东旭光电	37,047,539.94	3.55
25	300023	宝德股份	36,828,074.92	3.53
26	002673	西部证券	36,784,589.06	3.52
27	600837	海通证券	35,850,135.98	3.43
28	000776	广发证券	35,704,046.46	3.42
29	601377	兴业证券	35,646,773.49	3.42
30	000045	深纺织A	35,544,363.45	3.41
31	000975	银泰资源	35,518,335.42	3.40
32	600030	中信证券	35,505,612.52	3.40
33	601788	光大证券	35,477,124.41	3.40
34	002681	奋达科技	35,069,898.05	3.36
35	000712	锦龙股份	34,827,329.87	3.34
36	300302	同有科技	34,090,830.54	3.27
37	300079	数码视讯	33,798,488.93	3.24
38	603000	人民网	33,629,904.10	3.22
39	002337	赛象科技	33,568,297.45	3.22
40	300308	中际装备	33,393,684.72	3.20
41	300072	三聚环保	33,119,823.73	3.17
42	002227	奥特迅	33,084,663.45	3.17
43	002487	大金重工	32,920,128.14	3.15
44	002079	苏州固锝	32,754,924.66	3.14
45	002399	海普瑞	32,656,820.11	3.13
46	300077	国民技术	32,559,025.80	3.12
47	000507	珠海港	32,265,470.59	3.09
48	600233	大杨创世	31,990,374.09	3.07
49	600255	鑫科材料	31,988,930.26	3.06
50	601928	凤凰传媒	31,847,906.30	3.05
51	300316	晶盛机电	31,637,107.89	3.03
52	300380	安硕信息	31,626,233.96	3.03
53	300033	同花顺	31,544,240.38	3.02
54	300346	南大光电	30,914,151.00	2.96
55	300137	先河环保	30,763,936.88	2.95
56	002555	三七互娱	30,600,999.02	2.93
57	300246	宝莱特	29,495,813.68	2.83
58	600829	人民同泰	29,261,597.57	2.80
59	300338	开元仪器	28,822,332.30	2.76
60	300250	初灵信息	28,054,707.92	2.69
61	300248	新开普	26,741,047.12	2.56
62	300163	先锋新材	25,588,986.87	2.45
63	300311	任子行	25,278,515.01	2.42
64	300324	旋极信息	25,009,715.47	2.40
65	300053	欧比特	24,977,084.26	2.39
66	300348	长亮科技	24,433,464.93	2.34
67	600847	万里股份	24,303,941.71	2.33
68	300002	神州泰岳	24,199,795.70	2.32
69	002320	海峡股份	24,012,176.21	2.30
70	300199	翰宇药业	23,935,187.19	2.29
71	300352	北信源	23,861,210.03	2.29
72	600297	广汇汽车	23,829,550.75	2.28
73	300359	全通教育	23,811,287.09	2.28
74	300313	天山生物	23,727,032.85	2.27
75	600298	安琪酵母	22,359,766.61	2.14
76	002104	恒宝股份	20,952,649.50	2.01

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。

8.4.2累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000728	国元证券	42,532,876.15	4.08
2	300139	晓程科技	41,997,829.35	4.02
3	601958	金钼股份	40,769,759.76	3.91
4	002618	丹邦科技	40,674,484.56	3.90
5	002595	豪迈科技	38,572,612.50	3.70
6	300354	东华测试	38,501,582.93	3.69
7	002107	沃华医药	36,386,910.77	3.49
8	002673	西部证券	35,883,691.02	3.44
9	000686	东北证券	35,822,048.91	3.43
10	600459	贵研铂业	34,982,556.59	3.35
11	600419	天润乳业	33,245,603.59	3.19
12	300235	方直科技	33,054,474.33	3.17
13	000413	东旭光电	32,871,618.40	3.15
14	600030	中信证券	32,382,111.08	3.10
15	000776	广发证券	32,347,761.62	3.10
16	600837	海通证券	32,328,850.48	3.10
17	601377	兴业证券	32,273,187.61	3.09
18	600629	华建集团	32,202,267.14	3.09
19	601788	光大证券	31,966,314.42	3.06
20	000712	锦龙股份	31,793,782.45	3.05
21	300079	数码视讯	31,380,632.49	3.01
22	000798	中水渔业	30,444,443.60	2.92
23	002681	奋达科技	30,081,031.24	2.88
24	000975	银泰资源	29,920,076.58	2.87
25	000507	珠海港	29,881,557.52	2.86
26	300072	三聚环保	29,874,511.09	2.86
27	002350	北京科锐	29,435,424.53	2.82
28	300023	宝德股份	29,430,342.80	2.82
29	002469	三维工程	29,342,622.98	2.81
30	002495	佳隆股份	29,038,345.03	2.78
31	600829	人民同泰	28,844,331.18	2.76
32	002700	新疆浩源	28,604,942.39	2.74
33	002337	赛象科技	28,337,239.11	2.72
34	300302	同有科技	28,306,042.90	2.71
35	300137	先河环保	28,258,273.65	2.71
36	300107	建新股份	28,041,918.42	2.69
37	002487	大金重工	28,032,559.33	2.69
38	600233	大杨创世	28,000,487.82	2.68
39	002555	三七互娱	27,806,076.16	2.66
40	300077	国民技术	27,527,486.41	2.64
41	300380	安硕信息	27,243,738.64	2.61
42	300308	中际装备	27,084,711.78	2.60
43	601928	凤凰传媒	27,048,292.86	2.59
44	300179	四方达	26,669,224.14	2.56
45	300224	正海磁材	26,396,323.41	2.53
46	300270	中威电子	26,323,222.84	2.52
47	000045	深纺织A	26,281,824.08	2.52
48	300050	世纪鼎利	26,021,915.76	2.49
49	600255	鑫科材料	25,981,975.90	2.49
50	300200	高盟新材	25,891,869.26	2.48
51	300316	晶盛机电	25,397,462.98	2.43
52	002399	海普瑞	25,328,074.51	2.43
53	000541	佛山照明	25,295,308.66	2.42
54	603000	人民网	25,281,115.02	2.42
55	300346	南大光电	24,567,381.20	2.35
56	300246	宝莱特	23,899,587.47	2.29
57	002079	苏州固锝	23,881,981.80	2.29
58	002104	恒宝股份	23,639,226.45	2.26
59	300359	全通教育	23,474,191.78	2.25
60	300033	同花顺	23,147,099.50	2.22
61	002227	奥特迅	22,482,572.92	2.15
62	000915	山大华特	22,249,692.28	2.13
63	000848	承德露露	21,746,558.60	2.08
64	601801	皖新传媒	21,476,637.91	2.06
65	600557	康缘药业	21,406,824.92	2.05
66	002152	广电运通	21,333,774.28	2.04
67	300338	开元仪器	20,993,745.21	2.01

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。

8.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	5,580,850,662.75
卖出股票的收入(成交)总额	4,846,581,640.56

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。

8.5期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

8.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

8.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

8.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12投资组合报告附注

8.12.1本基金投资的陕西宝光真空电器股份有限公司(以下简称"宝光股份",股票代码600379)收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(陕证调查字2015009号):因涉嫌违反证券法律法规,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证券监督管理委员会决定对公司立案调查。

对上述股票投资决策程序的说明:本基金采用数量化选股模型驱动的选股策略进行个股选择,并结合适当的资产配置策略搭建基金投资组合。本基金系通过基金管理人建立的动态多因子模型进行股票选择并据此构建股票投资组合。动态多因子模型在实际运行过程中将定期或不定期地进行修正,优化股票投资组合。前述动态多因子策略量化模型分成数据报取及处理、因子检验、股票筛选、组合构建等主要流程,每一环节都经过严格的定量分析。本基金对宝光股份的投资系严格按照前述动态多因子模型来进行的,本报告期内,本基金对宝光股份的投资未违反前述原则。

除上述股票外,本基金投资的其余前九名证券的发行主体本期未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。

8.12.2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。

8.12.3 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	2,208,795.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	123,362.13
5	应收申购款	34,159.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,366,316.30

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600578	京能电力	6,848,781.00	0.66	筹划重大事项
2	002201	九鼎新材	9,729,277.00	0.93	筹划重大事项
3	002320	海峡股份	6,810,083.73	0.65	筹划重大事项
4	002567	唐人神	8,708,088.00	0.83	筹划重大事项
5	300349	金卡股份	8,944,862.50	0.86	筹划重大事项
6	600379	宝光股份	8,477,696.00	0.81	筹划重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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 持有份额	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
22,539	52,232.67	2,728,026.30	0.23%	1,174,544,099.22	99.77%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	281,491.90	0.0239%

9.3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	10-50

§10开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年6月2日)基金份额总额	1,495,774,270.35
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	63,421,048.69
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	381,923,193.52
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,177,272,125.52

§11 重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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:
本公司于2015年1月17日发布公告:因个人原因,冯刚先生自2015年1月15日起不再担任本公司副总经理。
本公司于2015年12月2日发布公告:因个人原因,陈星德先生自2015年11月30日起不再担任本公司副总经理。
基金托管人:
本基金托管人2015年1月4日发布任免通知,聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人2015年9月18日发布任免通知,解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
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。

11.4 基金投资策略的改变
报告期内无基金投资策略的改变。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况
普华永道中天会计师事务所本年度第一次为本基金提供审计服务,报告年度应支付给聘任普华永道中天会计师事务所的报酬为100,000元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
11.7.1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 成交金额	股票交易 占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	应支付该券商的佣金 占当期佣金总量的比例	备注
上海证券	1	5,107,138,254.66	48.98%	4,704,423.92	49.02%	-
招商证券	1	2,248,826,462.15	21.57%	2,062,516.97	21.49%	-
广发证券	1	1,975,851,670.09	18.95%	1,824,532.45	19.01%	-
海通证券	1	1,005,088,591.65	9.64%	920,192.26	9.59%	-
华创证券	1	90,527,324.76	0.87%	84,307.58	0.88%	-

注:1. 上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。
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. 本基金于2015年6月2日正式成立,以上均为本期新增席位,无注销席位。

11.7.2 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 成交金额	债券交易 占当期债券成交总额的比例	回购交易 成交金额	回购交易 占当期回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	权证交易 占当期权证成交总额的比例
上海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	100,000,000.00	100.00%	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一六年三月三十日