上投摩根健康品质生活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。
本基金的基金名称自2015年7月21日起由上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金变更为上投摩根健康品质生活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、投资范围和投资策略的变更，对本基金的投资及基金份额持有人利益无实质性不利影响。
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1月1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	上投摩根健康品质生活混合
基金交易代码	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
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
报告期末基金份额总额	98,836,296.37份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	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，把握基金资产的长期稳定增值。
投资策略	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、产业政策、行业景气度、证券市场走势和流动性的综合分析，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通胀周期影响下，业绩增长、利率环境、通胀预期等因素的变动；流动性驱动主要体现为货币市场环境变动的影响，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、债券和货币市场工具的投资比例。 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；二是拓展生命宽度，提高生活品质。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高，由此带来对相关产品和服务的需求的增加，并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品质生活这两大主题，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质量的行业和个股。

业绩比较基准	沪深300指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，主要投资于有利于提升居民健康水平和生活品质的行业和公司，属于主题类混合型基金，预期风险和收益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、较高预期收益的基金产品。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡斌	王永民
	联系电话	021-38794888	010-66594896
	电子邮箱	service@chinaamc.com	fcid@bank.of.china.com
客户服务电话		400-889-4888	95566
传真		021-20628800	010-66594942

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.chinaamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§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	2014年	2013年
本期已实现收益	-48,125,002.69	8,536,295.49	40,119,526.68
本期利润	-40,194,382.48	41,612,970.38	25,208,102.18
加权平均基金份额本期利润	-0.4286	0.2914	0.1675
本期基金份额净值增长率	-43.98%	31.00%	16.13%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.0793	0.8019	0.2745
期末基金资产净值	213,489,321.26	148,464,277.81	215,185,203.95
期末基金份额净值	2.403	1.669	1.274

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，对期末可供分配利润，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	29.96%	2.02%	14.30%	1.42%	15.66%	0.60%
过去六个月	-4.38%	3.34%	-13.61%	2.28%	9.23%	1.06%
过去一年	43.98%	2.99%	5.66%	2.11%	38.32%	0.88%
过去三年	119.06%	2.03%	42.77%	1.52%	76.28%	0.51%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	140.30%	1.84%	46.29%	1.42%	94.01%	0.42%

注：本基金业绩指标比较基准为：沪深300指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%
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

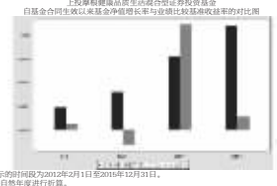
上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金

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（2012年2月1日至2015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，所示时间段为2012年2月1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

上投摩根健康品质生活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：1.本基金合同生效日为2012年2月1日，所示的时间段为2012年2月1日至2015年12月31日。
2.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
本基金自基金合同生效日起未进行过利润分配。

§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6月12日正式成立，公司由上海国际信托投资有限公司（2009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25亿元人民币，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、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根大数据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、上投摩根保证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、上投摩根全球天然资源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、上投摩根稳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低波动精选指数证券投资基金、上投摩根天赋年混合型证券投资基金、上投摩根罗宾汉顶级趋势策略混合型证券投资基金、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、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根优信增利债券型证券投资基金、上投摩根现金管理货币市场基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根天添益货币市场基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根稳进回报混合型证券投资基金、上投摩根安全策略股票型证券投资基金、上投摩根稳健策略股票型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置证券投资基金、上投摩根智慧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）及基金经理勤勉尽责情况

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
戴红波	本基金基金经理	2012-02-01	2015-02-16	12年	管理学硕士，曾任职于中华全国供销合作总社监察局及办公厅、中国平安人寿上海分公司战略发展部，2004年进入摩根基金管理公司，先后担任研究部副经理、摩根资产策略基金经理助理，2007年1月至2008年6月担任摩根资产策略基金经理，2008年7月加入上投摩根基金管理有限公司，2008年3月至2015年2月担任上投摩根中小盘混合型证券投资基金基金经理，2012年2月至2015年2月担任上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金经理，2013年5月至2015年2月担任上投摩根中国优势证券投资基金基金经理。
张飞	本基金基金经理	2015-01-30	-	8年	张飞先生，自2008年5月至2010年5月在东海证券有限责任公司担任研究员，2010年5月至2011年5月在上海玛雅投资有限责任公司担任研究员，自2011年5月起加入上投摩根基金管理有限公司，自2015年1月起担任上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金经理，自2015年10月起，同时担任上投摩根医疗健康股票型证券投资基金基金经理。
乐琪	本基金基金经理	2014-11-17	-	9年	乐琪先生，美国克拉克斯大学硕士研究生，自2007年3月至2010年10月在中银基金管理有限公司担任研究员，自2010年10月起加入上投摩根基金管理有限公司，自2014年11月起担任上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金经理，自2014年12月起担任上投摩根成长动力混合型证券投资基金基金经理，自2015年2月起同时担任中国优势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.戴红波先生为本基金首任基金经理，其任职日期除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、《上投摩根健康品质生活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，同时通盖了授权、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。
公司执行自上而下的三级授权体系，依次为投资决策委员会、投资总监、经理人。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流程，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，执行公平交易程序。对于交易所市场投资活动，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机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易室询价机制，严格的思想交易对于风险并触价格公允性；对于一级市场申购投资行为，遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立中介的价格机制量化对交易结果进行公平分配。
公司制订了《异常交易监控与报告制度》，通过系统和人工相结合的方式进行投资交易行为的监控分析，并执行异常交易行为监控分析记录工作机制，确保公平交易可稽核、公可分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查。
4.3.2公平交易制度的执行情况
报告期内，公司严格执行上述公平交易制度和控制方法，开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的收益率差异，以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易时机和交易价差等方面的监控分析，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。
其中，在同向交易的监控和分析方面，根据法规要求，公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控，通过定期抽查前述的同向交易行为，定性分析交易时机、对比不同投资组合长期的交易趋势，重点关注任何可能导致不公平交易的情况。对于识别的异常情况，由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释，同时，公司根据法规要求，通过系统模块定期对全部产品一个季度内不同投资组合在不同时间窗内（日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行分析，采用概率统计方法，主要关注不同投资组合之间同向交易价差均值为零的显著性检验，以及同向交易价格占优的交易次数占比分析。
报告期内，通过前述分析方法，未发现不同投资组合之间同向交易价差异常的情况。
4.3.3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、交易方向等的抽样分析，公司未发现存在异常交易行为。
报告期内，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%的交易次数合计为0笔，其中，属于指数投资组合与主动管理投资组合之间，属于指数投资组合与指数投资组合之间的交易次数为0笔，属于主动管理投资组合之间的交易次数为0笔。
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1报告期内基金投资策略和业绩分析
2015年同季度市场延续了从国资调整以来的反弹趋势，整体上仍然是成长股的行情，但热点迅速切换，整体上仍然以主题表现为主，真正业绩驱动的成长股较少，后期金融地产等价值股有了较强的表现，同时保险等长线资金在年末不断上涨带横行情，侧生了一波价值股的行情。
四季度配置以消费转型个股为主，仓位集中在医药、消费等行业，后期增加了地产股的配置。基金整体上比较偏重具有独特商业模式和新领域布局的个股，特别是从其他领域跨界到医疗等具有长期发展潜力的子行业的个股。主题行情以及周期股的行情同样的了低仓位参与。
4.4.2报告期内基金的业绩表现
本报告期本基金份额净值增长率为43.98%，同期业绩比较基准收益率为5.66%。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2016年全年行情，在经济增速下行周期中，市场的热点仍然在以中小市值股的资产重估价值，以资产注入题材为主要的市场特征，中间偶然经历了周期调整，但从全年的角度看相关个股涨幅比大，且期间调整前后这个特征可非常明显。未来若注册制开始实施，相关个股的“稀缺时间”会越来越短，预计此模式个股的有较强的股价表现空间，但需要对相关标的进行仔细甄别，选出真正具备长期成长潜力的领域。同时在经济增速趋于稳定下行左侧阶段，医药、消费行业特别是医疗相关个股会表现出较强的吸引力，会是本基金侧重的重点。15年本基金随市场波动的特征较多，2016年力争维持控制回撤，实现净值的稳步增长。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
本公司的基金估值程序由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历，本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则，负责重大或特殊品种的估值问题等事项。基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员，参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。
4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
本报告期本基金未进行利润分配。
4.8报告期内聘请的会计师事务所情况
无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
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，对本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，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见
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（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金2015年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所有限公司审计，注册会计师陈玲、李丽签字出具了“无保留意见的审计报告”（编号：普华永道中天审字(2016)第23237号）。
投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1 资产负债表
会计主体：上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金
报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	11,535,272.21	11,982,687.99
结算备付金		2,780,564.50	787,093.53
存出保证金		225,829.84	96,850.01
交易性金融资产	7.4.7.2	202,909,723.41	137,783,568.39
其中：股票投资		191,680,560.41	137,783,568.39
基金投资		-	-
债券投资		11,229,173.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,110,538.90	-
应收利息	7.4.7.5	398,227.40	3,002.43
应收股利		-	-
应收申购款		374,204.42	3,407,580.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		220,334,362.68	154,060,758.64
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,881,134.85	2,698,934.60
应付赎回款		1,171,237.55	1,944,035.56
应付管理人报酬		274,079.28	188,843.36
应付托管费		46,679.88	31,473.90
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,168,561.04	427,775.75
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	304,348.82	305,417.66
负债合计		6,845,031.42	5,596,480.83
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	88,836,296.37	88,934,116.26
未分配利润	7.4.7.10	124,653,024.89	59,530,161.55
所有者权益合计		213,489,321.26	148,464,277.81
负债和所有者权益总计		220,334,352.68	154,060,758.64

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值2.403元，基金份额总额88,836,296.37份。
7.2 利润表
会计主体：上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金
本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入		52,464,621.51	47,601,641.58
1.利息收入		586,298.16	214,294.17
其中：存款利息收入	7.4.7.11	167,808.78	173,333.32
债券利息收入		427,989.77	41,960.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		58,970,332.81	14,099,737.46
其中：股票投资收益	7.4.7.12	58,259,224.19	12,752,231.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	83,484.21	-17,810.96
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	627,624.41	1,335,317.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-7,940,620.21	33,076,684.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	839,010.36	210,424.98
减：二、费用		12,280,139.03	5,988,671.20
1.管理人报酬		3,147,680.07	2,714,578.04
2.托管费		524,687.94	452,429.68
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	8,195,367.56	2,489,848.75
5.利息支出		70,249.70	-
其中：卖出回购金融资产支出		70,249.70	-
6.其他费用	7.4.7.19	342,335.76	331,817.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		40,184,382.48	41,612,970.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		40,184,382.48	41,612,970.38

7.3 所有者权益（基金净值）变动表
会计主体：上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金
本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	88,934,116.26	59,530,161.55	148,464,277.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,184,382.48	40,184,382.48
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-97,819.89	24,938,480.86	24,840,660.97
其中：1.基金申购款	200,042,024.01	451,752,173.74	651,794,197.75
2.基金赎回款	-200,139,843.90	-426,813,692.88	-626,953,536.78
四、本期期末所有者权益（基金净值）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	88,836,296.37	124,653,024.89	213,489,321.26

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	168,842,838.00	46,342,365.95	215,185,203.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,612,970.38	41,612,970.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-79,908,721.74	-28,425,177.78	-108,333,899.52
其中：1.基金申购款	66,338,993.02	28,438,146.45	94,777,139.47
2.基金赎回款	-146,247,714.76	-56,863,324.23	-203,111,038.99
四、本期期末所有者权益（基金净值）	88,934,116.26	59,530,161.55	148,464,277.81

报表附注为财务报表的组成部分。
本报告底稿（序号）从7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：
基金管理人负责人：麻顺鹏，主管会计工作负责人：胡志强，会计机构负责人：张鹏
7.4 报表附注
7.4.1 基金基本情况
上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金(原名为上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1753号《关于核准上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金募集的批复》核准，由上投摩根基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根健康品质生活股票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。
7.4.2 会计报表的编制基础
本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)，中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号-年度报告和半年度报告>》，中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》，《上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表期间至7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会及有的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。
7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
本基金2015年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。
7.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
7.4.4.1 本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致的说明
本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。
7.4.4.2 本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，基于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。
除以上会计估计变更外，本基金本报告期所采用的其他会计估计与最近一期年度报告相一致。
7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
7.4.5.1 会计政策变更的说明
本基金本报告期未发生会计政策变更。
7.4.5.2 会计估计变更的说明
对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，基于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。
除以上会计估计变更外，本基金本报告期所采用的其他会计估计与最近一期年度报告相一致。
7.4.6 税项
根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：
(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。
(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入、股权的股息、红利收入、债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
(3) 对基金取得的个人证券市场中取得的收入，对由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月30日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月30日起，暂免征收个人所得税所得额。基金于2015年3月23日起改为采用中证指数有限公司编制的《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值的注7.4.5.2，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。
(11) 第三层次公允价值金额和本期变动金额
无。
(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具
于2015年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014年12月31日：同)。
(d) 不以公允价值计量的金融工具
不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。
(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金尚需要说明的其他重要事项。

§5 投资组合报告

8.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	191,680,560.41	87.00
	其中：股票	191,680,560.41	87.00
2	固定收益投资	11,229,173.00	5.10
	其中：债券	11,229,173.00	5.10
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式逆回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	14,315,828.71	6.50
7	其他各项资产	3,108,800.56	1.41
8	合计	220,334,362.68	100.00

8.2期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,276,083.00	1.07
B	采矿业	-	-
C	制造业	100,594,010.54	47.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,233,120.00	0.58
E	建筑业	8,143,871.00	3.81
F	批发和零售业	23,784,819.57	11.14
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	785,150.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,463,736.30	3.50
J	金融业	8,757,209.00	4.10
K	房地产业	38,642,562.00	18.10
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	191,680,560.41	89.78

8.3 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投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002492	恒宝股份	256,300	12,973,906.00	6.08
2	600420	现代制药	246,700	10,304,659.00	4.83
3	600276	恒瑞医药	200,156	10,224,573.60	4.79
4	000002	万科A	339,100	8,284,213.00	3.88
5	002574	明牌珠宝	386,289	8,204,778.36	3.84
6	300498	温氏股份	138,700	7,987,064.00	3.68
7	002077	大港股份	364,100	7,263,795.00	3.40
8	600588	用友软件	407,000	6,934,968.00	3.25
9	300109	新开源	64,089	6,666,379.45	3.12
10	600745	中国医药	160,400	6,573,192.00	3.08

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.chinaamc）的年度报告正文。
8.4报告期内股票投资组合的重大变动
8.4.1累计买入金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	38,546,282.28	25.96
2	000002	万科A	37,634,734.76	25.36
3	002027	分众传媒	37,074,835.24	24.97
4	300104	乐视网	29,631,796.92	19.96
5	300049	福瑞股份	29,522,231.83