# 上投摩根科技前沿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7月9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 | 上投摩根科技前沿混合 |
| 基金主代码 | 001538 |
| 交易代码 | 001538 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年7月9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 | 114,279,404.77份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 采用定量及定性研究方法，自下而上优选科技前沿主题上市公司，通过严格的风险控制，力争实现基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金将通过系统相深入的基本面研究，密切关注处于科技前沿，通过高精尖科学技术为经济发展带来新增长点的相关行业及公司，重点投资于科技前沿主题相关行业的上市公司，分享中国经济增长模式转变带来的投资机会。<br>在行业配置层面，本基金将从行业生命周期、行业景气度、行业竞争格局等多角度，综合评估各个行业的投资价值，对基金资产在行业间动态配进行安排。<br>在个股选择层面，本基金将主要采用"自下而上"的方法，在备选行业内部通过定量与定性相结合的分析方法，综合分析上市公司的业绩质量、成长性和估值水平等，精选具有良好成长性、估值合理的个股。 |
| 业绩比较基准 | 中证800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 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 胡迪 | 王永民 |
| | 联系电话 | 021-38794888 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | services@cifm.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-889-4888 | 95566 |
| 传真 | | 021-20628400 | 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.cifm.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人、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7月9日（基金合同生效日）至2015年12月31日 |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 28,064,221.04 |
| 本期利润 | 28,218,553.82 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1470 |
| 本期基金份额净值增长率 | 15.90% |
| 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 | 0.1591 |
| 期末基金资产净值 | 132,464,497.26 |
| 期末基金份额净值 | 1.159 |

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。

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 | 13.52% | 1.63% | 12.20% | 1.03% | 1.32% | 0.60% |
| 过去六个月 | - | - | - | - | - | - |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 15.90% | 1.34% | 4.59% | 1.57% | 11.31% | -0.23% |

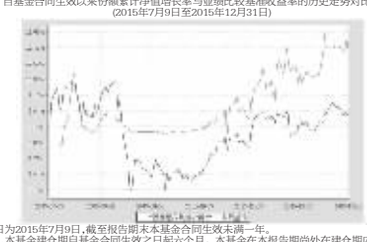
注：本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率*60%+中债总指数收益率*40%

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

上投摩根科技前沿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7月9日至2015年12月31日)



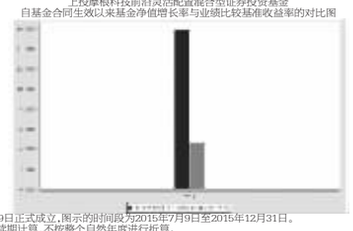
注：本基金合同生效日为2015年7月9日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

根据基金合同的规定，本基金建仓期自基金合同生效之日起六个月。本基金在本报告期尚处在建仓期内。

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

上投摩根科技前沿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7月9日正式成立，图示的时间段为2015年7月9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

本基金过去三年来未进行利润分配。

### §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、上投摩根全球新兴市场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、上投摩根岁岁盈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、上投摩根优信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、上投摩根新兴市场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、上投摩根岁岁盈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、上投摩根优信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、上投摩根新兴市场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、上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力