

信息披露 isclosure

上投摩根中国优势证券投资基金

「2015」年度报告摘要

报告截止日期: 2015年12月31日

单位: 人民币元

日托投资: 前一日基金资产净值 X 0.26% / 当年天数

7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券回购交易

7.4.8.4关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.4.8.4.2报告期内除基金管理人之外其他关联方投资本基金的情况

7.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
中国建设银行	366,040,041.99	917,466.00	189,718,660.86	1,630,613.32

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管, 按照银行协议利率计息。

7.4.8.6本基金在承销期间参与关联方承销的情况

7.4.8.7其他关联方交易事项的说明

7.4.8.8 2015年12月31日, 本基金持有的流通受限证券

7.4.8.9报告期内关联方投资于非固定收益类流通受限证券

7.4.8.10期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末公允价值	数量(股)	期末公允价值	期末公允价值占基金资产净值的比例
600433	联创股份	16/10/21	重大事项	41.77	160,033.22	3,544	569.511
600844	丹化科技	16/11/20	重大事项	22.02	未知	未知	1,099.706
600717	明电股份	16/11/29	重大事项	22.02	未知	未知	1,099.706
600089	海油工程	16/11/29	重大事项	10.85	795.709	8,296.715	8,416.633
300038	梅泰诺	16/12/16	重大事项	6.68	未知	未知	116.019
300038	梅泰诺	16/12/29	重大事项	7.70	未知	未知	5,513.166

本基金截至2015年12月31日止持有以上公司股票的总数量可能产生重大影响而被暂时停牌的股票, 该类股票将在所公布事项的

7.4.8.12报告期内市场公允价值

7.4.8.13报告期内市场公允价值

7.4.10用于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中, 出售资产所能收到的价格。

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续以公允价值计量的金融工具

(i) 各层级金融工具公允价值

于2015年12月31日, 本基金持有的以公允价值计量的金融资产中属于第一层次的金额31,461,157,369.88元, 属于第二层次的金额179,388,490.21元, 无属于第三层次的金额203,444,642,503.97元。

(ii) 公允价值计量所属层次的重大变动

对于证券交易上的重大变动, 若因重大事项停牌, 交易不活跃(包括但不限于停牌)或属于非公开发行等情况, 本基金不会于资产负债表日重新计量其公允价值, 交易不活跃期间及提供期间其公允价值按照公允价值输入值第一层次, 并参照估值调整中采用的估值技术进行估值。

8.1期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1,569,463,240.09	84.84
2	固定收益投资	75,063,000.00	84.84
3	货币市场工具	75,063,000.00	4.07
4	其他资产	—	—
5	其他负债	—	—
6	其他资产	—	—
7	其他负债	—	—
8	其他资产	—	—
9	其他负债	—	—
10	合计	1,644,526,240.09	100.00

8.2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

代码	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	—	—	—	—	—
B	—	—	—	—	—
C	—	—	—	—	—
D	—	—	—	—	—
E	—	—	—	—	—
F	—	—	—	—	—
G	—	—	—	—	—
H	—	—	—	—	—
I	—	—	—	—	—
J	—	—	—	—	—
K	—	—	—	—	—
L	—	—	—	—	—
M	—	—	—	—	—
N	—	—	—	—	—
O	—	—	—	—	—
P	—	—	—	—	—
Q	—	—	—	—	—
R	—	—	—	—	—
S	—	—	—	—	—
T	—	—	—	—	—
U	—	—	—	—	—
V	—	—	—	—	—
W	—	—	—	—	—
X	—	—	—	—	—
Y	—	—	—	—	—
Z	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

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债券投资明细

代码	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	—	—	—	—	—
B	—	—	—	—	—
C	—	—	—	—	—
D	—	—	—	—	—
E	—	—	—	—	—
F	—	—	—	—	—
G	—	—	—	—	—
H	—	—	—	—	—
I	—	—	—	—	—
J	—	—	—	—	—
K	—	—	—	—	—
L	—	—	—	—	—
M	—	—	—	—	—
N	—	—	—	—	—
O	—	—	—	—	—
P	—	—	—	—	—
Q	—	—	—	—	—
R	—	—	—	—	—
S	—	—	—	—	—
T	—	—	—	—	—
U	—	—	—	—	—
V	—	—	—	—	—
W	—	—	—	—	—
X	—	—	—	—	—
Y	—	—	—	—	—
Z	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

注: 投资者除了本基金所披露的有价证券外, 还应通过基金管理人(www.cimc.com.cn)网站查询年度报告全文。

8.4.1计划买入的股票明细(前十大)

序号	项目	金额	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	1,565,463,240.09	84.84

注: 本基金投资于股票资产占基金资产净值的比例不低于80%。

8.4.2计划买入的债券明细(前十大)

	其中:债券	75,083,000.00	4.07
	资产支持证券	--	--
2	基金投资		