

上投摩根红利回报混合型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十日

基金管理人的董事会及监事会在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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6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	55,826,038.81	0.70
		55,826,038.81	0.70
2	固定收益投资	238,013,078.50	2.97
	其中:债券	238,013,078.50	2.97
	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	7,181,999,683.00	89.72
6	银行存款和结算备付金合计	519,917,829.45	6.60
7	其他各项资产	8,722,150.72	0.11
8	合计	8,004,476,750.45	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金净资产的比例(%)
A 农、林、牧、渔业	484,799.65	0.01	
B 采矿业	1,636,090.25	0.02	
C 制造业	26,207,765.41	0.33	
D 电力、燃气及水生产和供应业	—	—	
E 建筑业	517,799.02	0.01	
F 批发和零售业	—	—	
G 交通运输、仓储和邮政业	2,670,867.22	0.03	
H 住宿和餐饮业	—	—	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	10,000,397.28	0.26	
J 金融业	2,952,080.00	0.04	
K 房地产业	—	—	
L 租赁和商务服务业	673,691.40	0.01	
M 科学研究、技术服务和地质勘查业	823,611.68	0.01	
N 水、风、太阳能发电业	—	—	
O 国际贸易、代理和其它服务业	—	—	
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	65,826,038.81	0.70	

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 (2015年4月1日-2015年6月30日)

1.本期已实现收益 182,089,325.64

2.本期利润 162,565,348.68

3.期初平均基金份额净值 0.0332

4.期末基金份额净值 7,993,138,104.97

5.期末基金资产净值 1,089

注:本期实现收益余额,本期利润即为本期的收入加上本期的公允价值变动收益。

上述基金业指标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、红利再投费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

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

过去三个月 30.1% 0.09% 4.88% 1.00% -1.87% -0.09%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

上投摩根红利回报混合型证券投资基金 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 (2013年9月18日至2015年6月30日)



注:本基金建仓期自2013年9月18日至2014年3月17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2013年9月18日,图示时间为2013年9月18日至2015年6月30日。

§ 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

征茂平 本基金基金经理 2013-09-18 - 13年

征茂平先生于2001年3月至2004年3月在上海浦东发展银行工作,历任理财经理、客户经理;2004年3月至2006年1月在平安银行工作,历任理财经理;2006年1月至今在上投摩根基金管理有限公司,担任行业研究员、基金经理助理、基金经理。征茂平先生具有13年证券从业经验,具备丰富的行业研究经验,并取得良好的投资业绩。

本基金建仓期尚未有基金经理。

5.1 公平交易专项说明

5.1.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司严格执行《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部公平交易制度的规定,不存在违反公平交易制度的情况。

5.1.2 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。

5.1.3 其他资产配置情况

5.1.4 报告期内股票买卖的前十名资产支持证券情况

5.1.5 报告期内债券买卖的前十名资产支持证券情况

5.1.6 报告期内债券买卖的前十名贵金属情况

5.1.7 报告期内贵金属买卖的前十名资产情况

5.1.8 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.9 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.10 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.11 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.12 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.13 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.14 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.15 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.16 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.17 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.18 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.19 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.20 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.21 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.22 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.23 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.24 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.25 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.26 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.27 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.28 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.29 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.30 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.31 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.32 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.33 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.34 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.35 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.36 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.37 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.38 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.39 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.40 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.41 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.42 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.43 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.44 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.45 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.46 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.47 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.48 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.49 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.50 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.51 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.52 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.53 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.54 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.55 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.56 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.57 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.58 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.59 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.60 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.61 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.62 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.63 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.64 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.65 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.66 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.67 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.68 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.69 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.70 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.71 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.72 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.73 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.74 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.75 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.76 报告期内贵金属买卖的前十名贵金属情况

5.1.77 报