

上投摩根安全战略股票型证券投资基金

[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

§ 1 重要提示

基金管理人的董事局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、完整性和及时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，保证复核结果不存在虚假记载、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本基金，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、基金合同。

本基金中财会资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	上投摩根安全战略股票
基金代码	001009
交易代码	001009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月26日
报告期末基金资产总额	2,602,027,899.88元
投资目标	通过积极的资产配置，力求在控制风险的前提下，实现基金的长期资本增值。
投资策略	本基金将通过系统地深入的基金研究，重点关注于国家安全战略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，在控制风险的前提下力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证800指数收益率*85%+中债企业债收益率*15%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，同时风险收益水平高于混合型基金，低于股票型基金和货币市场基金，属中等风险收益水平的基金产品。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标		报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)	单位:人民币元		
1.本期已实现收益		477,297,489.66			
2.本期利润		388,296,097.47			
3.加权平均基金份额本期利润		0.1462			
4.期末基金份额净值		2,457,017,668.32			
5.期末基金份额净值		1.227			
注:本公司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，本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。					
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金份额的费用(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将低于所列数字。					
3.2 基金净值表现					
3.2.1 本基金报告期内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	净值增长①	净值增长基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去三个月	18.44%	3.15%	12.00%	2.24%	6.38%
注:本基金合同生效日为2015年2月26日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。					
注:本基金合同的约定，本基金建仓期自基金合同生效之日起六个月内。本基金在本报告期尚处在建仓期内。					
§ 4 管理人报告					
4.1 基金经理(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	说明	
卢扬	本基金基金经理	2015-2-26	-	9年	卢扬先生，硕士研究生，于2004年5月至2006年1月在中行国际有限公司任客户经理；2006年1月至今在上投摩根基金管理有限公司担任分析师，自2010年7月起担任本基金基金经理。卢扬先生拥有10年证券从业经验，期间担任过上投摩根行业轮动基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、上投摩根行业轮动债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根行业轮动灵活配置混合型证券投资基金。
注:1.任职日期和离任日期均指根据公司决定的聘任日期和解聘日期。 2.卢扬先生为本基金基金经理，其任职日期即本基金合同生效之日起之日。 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守法律法规情况的说明					
在本基金报告期内，基金管理人不存在挪用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，基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根安全战略股票型证券投资基金基金合同》。基金管理人对每个投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金管理人对每个投资组合的比例遵循了法律法规的要求。					
4.3 公平交易制度的执行情况					
报告期内，本公司继续贯彻实行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司公平交易制度的要求，严格执行防范内幕交易、股票交易的一级市场申购和二级市场交易等各项活动，通过制度和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动的各个环节均得到公平对待。					
对于交易所场外投资活动，本公司继续贯彻实行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司公平交易制度的要求，严格执行防范内幕交易、股票交易的一级市场申购和二级市场交易等各项活动，通过制度和人工相结合的方式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%的股票。					
4.4 报告期内本基金的基金策略和运作分析					
2015年2季度以来，在杠杆资金的推波助澜之下，股市波动明显加大，在改革牛以及万众创业的乐观情绪推动下，创业板指数屡创新高，从6月18日高点到6月30日收盘，累计下跌2.5%。相比之下，前创业板指数小幅，中枢相较于主板市场波动相对较小。					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.5 公平交易制度的执行情况					
报告期内，本公司继续贯彻实行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司公平交易制度的要求，严格执行防范内幕交易、股票交易的一级市场申购和二级市场交易等各项活动，通过制度和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动的各个环节均得到公平对待。					
对于交易所场外投资活动，本公司继续贯彻实行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司公平交易制度的要求，严格执行防范内幕交易、股票交易的一级市场申购和二级市场交易等各项活动，通过制度和人工相结合的方式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%的股票。					
4.6 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.7 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.8 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.9 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.10 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.11 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.12 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.13 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.14 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.15 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.16 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.17 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.18 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.19 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.20 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.21 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.22 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.23 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.24 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.25 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.26 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.27 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.28 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.29 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.30 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.31 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.32 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.33 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.34 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.35 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.36 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.37 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.38 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.39 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.40 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.41 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.42 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					
4.43 公平交易制度的执行情况					
报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异对比，对向同向交易和反向交易的交易时段和交易差价进行分析，未发现具体公平交易执行出现异常的情况。					