

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金

[2015] 第四季度报告

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一六年一月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、资产配置比例等内容，保证复核后的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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:上投摩根中证消费服务指数

基金代码:370023

交易代码:370023

基金运作方式契约型开放式

报告期末基金份额总额15,717,327,326份

投资目标 通过严格的投资纪律来实现量化指数化投资，通过严格的投资纪律来实现量化指数化投资管理，力争使本基金的净值增长率与业绩比较基准的收益率之间的差额在正常范围内不超过±3%，年度误差不超过±4%，以实现对本基金的净值表现的跟踪误差控制。

本基金在投资操作上将遵循以下原则：1)本基金将运用其方法建立立

2)本基金将运用其方法建立立

3)本基金将运用其方法建立立

4)本基金将运用其方法建立立

5)本基金将运用其方法建立立

6)银行存款和货币市场基金

7)其他各项资产

8)合计

22,842,872,008份 100.00%

§ 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10月1日-2015年12月31日)

1.本期已实现收益 -263,266.69

2.本期利润 3,864,226.02

3.期初至报告期基金份额总额 22,842,872,008份

4.期末基金份额净值 1.442

注: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。

上述基金业指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投费、基金转换费等)，计算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 本基金报告期内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 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 172.3% 1.89% 13.66% 1.34% 356% 0.51%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变化的比较

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图对比如图

(2012年9月25日至2015年12月31日)

注:本基金合同生效日为2012年9月25日，图示时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金建仓期自2012年9月25日至2013年3月24日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

4.1 管理人报告

4.1.1 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限 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

黄栋 本基金基金经理兼研究总监 2012-08-26 - 11年 上海财经大学经济学学士；2006年7月至2010年先在东方证券、工银瑞信基金管理有限公司工作，2010年7月加入上投摩根基金管理有限公司，主要从事金融工程研究工作，2013年7月担任基金经理兼研究总监，2015年3月担任本基金基金经理兼研究总监，2015年7月担任本基金基金经理兼研究总监。

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.黄栋先生为本基金现任基金经理，其任职日期为本基金基金合同生效之日。

3.证券从业的定义遵从行业协会《证券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，基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金基金合同》的规定，没有出现违反法律法规、基金合同的个股和投资组合的比例的违规操作，没有出现违反法律法规、基金合同的个股和投资组合的比例的违规操作，没有出现违反法律法规、基金合同的个股和投资组合的比例的违规操作，没有出现由于市场原因引起的投资组合的个股偏离比例不符合规定的情形，但已在规定时间内调整完毕。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平公正交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》，等相关法律规范和公司内部公平交易制度的各项要求，严格执行股票池内一级市场申购和二级市场交易等

活动，通过系统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、业绩评估等投资管理活动过程中得到公平对待。

对于交易所内场外投资活动，本公司执行集中交易制度，确保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；对于银行间场外投资活动，本公司通过对手库询价和交易竞价机制，严格按照对手风险及定价公允性，对于对手购买行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前申报的规格和数量进行公平配。

报告期内，通过对比对交易价格、交易时间、交易方向等的分析，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对比对交易价格、交易时间、交易方向等的分析，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，本基金将根据按照所持有的指数进行完全复制的策略，力争使跟踪误差最小化。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金在连续十个工作日内基金资产净值低于五十万元的情况，出现该情况的时间危

2015年6月19日至2015年12月31日。

基金管理人拟调整基金运作方式，增加营销力度，提升基金规模，方案已报监管机关。

5 投资组合报告

6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期初基金份额总额 16,548,901,017

报告期期间基金总申购份额 4,342,506,300

赎回金额 5,173,490,006

报告期期末基金份额总额 -

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金设立的文件；

2. 《上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金基金合同》；

3. 《上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金托管协议》；

4. 《上投摩根开放式基金业务规则》；

5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；

6. 基金托管人业务资格批件、营业执照；

7. 基金合同；

8. 其他

9. 合计

2,106,426,670.04 4.02 100,000

5.8 报告期内按行业分类的股票投资组合

5.8.1 报告期末按行业分类的股票资产

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 农林、牧、渔业 21,107,490,500 0.92

2 矿业 1,000,000 0.00

3 制造业 2,449,236,029,158 99.93 99.93

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 4,246,489,116 5.18

5 建筑业 129,529,996,611 5.15

6 批发和零售业 46,876,448,600 1.82

7 交通运输、仓储和邮政业 -

8 住宿和餐饮业 -

9 信息传输、软件和信息技术服务业 245,376,119,689 9.75

10 其他服务业 -

11 金融业 224,330,356,936 10.01

12 房地产业 -

13 公用事业 -

14 工业 57,008,569,793 2.29

15 农、林、牧、渔业 -

16 建筑业 129,529,996,611 5.15

17 批发和零售业 46,876,448,600 1.82

18 交通运输、仓储和邮政业 -

19 住宿和餐饮业 -

20 信息传输、软件和信息技术服务业 245,376,119,689 9.75

21 公用事业 -

22 房地产业 -

23 工业 57,008,569,793 2.29

24 公用事业 -

25 金融业 224,330,356,936 10.01

26 农、林、牧、渔业 -

27 建筑业 -

28 批发和零售业 -

29 交通运输、仓储和邮政业 -

30 住宿和餐饮业 -

31 信息传输、软件和信息技术服务业 -

32 公用事业 -

33 金融业 -

34 农、林、牧、渔业 -

35 建筑业 -

36 批发和零售业 -

37 交通运输、仓储和邮政业 -

38 住宿和餐饮业 -

39 信息传输、软件和信息技术服务业 -

40 公用事业 -

41 金融业 -

42 农、林、牧、渔业 -

43 建筑业 -

44 批售和零售业 -

45 交通运输、仓储和邮政业 -

46 住宿和餐饮业 -

47 信息传输、软件和信息技术服务业 -

48 公用事业 -

49 金融业 -

50 农、林、牧、渔业 -

51 建筑业 -

52 批售和零售业 -

53 交通运输、仓储和邮政业 -

54 住宿和餐饮业 -

55 信息传输、软件和信息技术服务业 -

56 公用事业 -

57 金融业 -

58 农、林、牧、渔业 -

59 建筑业 -

60 批售和零售业 -

61 交通运输、仓储和邮政业 -

62 住宿和餐饮业 -

63 信息传输、软件和信息技术服务业 -

64 公用事业 -

65 金融业 -

66 农、林、牧、渔业 -

67 建筑业 -

68 批售和零售业 -

69 交通运输、仓储和邮政业 -

70 住宿和餐饮业 -

71 信息传输、软件和信息技术服务业 -

72 公用事业 -

73 金融业 -

74 农、林、牧、渔业 -

75 建筑业 -

7