

上投摩根核心成长股票型证券投资基金

[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、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。
基金托管人承诺以诚实信用、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	上投摩根核心成长股票
基金代码	000467
交易代码	000467
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年10月1日
报告期末基金份额总额	362,768,224.01份

投资目标 本基金将在充分利用研究人员的研究平台，通过深入的基本面研究，选择公司和个股投资且具有较高成长潜力的公司进行投资，力争实现基金的长期资本增值。

投资策略 本基金将“上投下下”的个股精选策略，即研究发现并分析决定性分析的因素，基于公司内部研究团队对基于基本的深入研究和细致的实地调研，通过深入的公司基本面研究，精选具有较好成长性的行业，从而选择具有较好成长性的行业进行投资，力争各个行业的长期投资收益，参考具体行业的行业特征分析，结合对宏观经济的判断，力求最大程度地将资产类别转换为投资业绩，公司研究团队负责对投资组合的构建和维护。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×6%+中债国债收益率×15%

风险收益特征 本基金为股票型基金，运作风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于高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

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		43,000,089.24
2.本期利润		98,897,689.29
3.加权平均基金份额本期利润		0.2700
4.期末基金份额净值		614,050,498.00
5.期末基金份额总额		1,741

注:本期已实现收益指基金本期利润减去期间费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益(或减去损失)扣除相关费用后的余额。本期利润是用以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的申购费用(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将低于不计费用。

3.2 基金本期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 前一阶段(净值增长率为%) 后一阶段(净值增长率为%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 103.0% 1.86% 14.37% 1.42% 366% 0.44%

3.2.2 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

上投摩根核心成长股票型证券投资基金 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(2014年10月1日至2015年12月31日)



注:本基金合同生效日为2014年10月1日,图示时间为2014年10月1日至2015年12月31日。

本基金建仓期自2014年10月1日至2014年9月30日,建仓期结束时的资产配置比例符合本基金合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
李博	本基金基金经理	2014-12-31	-	7年

注:1.任职业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.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信的说明

在本基金报告期内,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取利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规,《上投摩根核心成长股票型证券投资基金基金合同》的规定,基金管理人和股东不存在合谋损害了股东利益的情况。

4.3 公平交易的专项说明

报告期内,本公司继续遵循《证券投资基金行业公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易制度的各项要求,规范地在股票市场上买卖股票,债券的一级市场申购和二级市场交易等,通过系统通过交易执行部门对交易执行部门进行交易行为,确保公平对待所有投资者。

对于对市场投资活动,本公司执行中立态度,确保不同投资组合在买卖同一证券时,按照时间优先,比价分配的原则,在投资组合间公平分配交易,对于银行间市场投资活动,本公司通过对对手控制和交易室的内部控制,严格防范对冲风险和价格操纵行为;对于申购或赎回行为,本公司遵循价格优先,比价分配的原则,根据事先申报的申购或赎回价格和数据对交易结果进行公平分配。

报告期内,通过对不同投资组合之间的收益率差进行对比,对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析,未发现整体不公平交易执行出现异常的情况。

4.4 报告期内基金的异常交易行为的专项说明

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

2015年4季度,市场交易调整后出现上涨,沪深300涨16.49%,板块方面,新兴产业大放异彩,行业上电子、计算机和通信服务,热点主题包括云计算、虚拟现实等,本基金持仓仍以优质成长股为主,继续加大了业绩增长确定性较高的个股。

进入2016年,我们判断市场将震荡磨底,但A股仍然会有结构性的投资机会。我们将继续以精选个股为首要方向,首先,重点关注中大盘股,中盘股涨幅较小,估值也普遍处于历史低位,伴随着年初的估值切换,中盘股在2016年全年有可能获得超额收益;其次,关注大消费领域,居民可支配收入仍处于稳步提升阶段,居民消费相关的领域存在投资机会;最后,关注经济转型带来的投资机会,如新能源、环保等领域。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.3 报告期内基金的费用情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.4 报告期内基金的利润分配情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.5 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.6 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.7 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.8 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.9 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.10 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.11 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.12 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.13 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.14 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.15 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.16 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.17 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.18 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.19 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.20 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.21 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.22 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.23 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.24 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.25 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.26 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.27 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.28 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.29 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.30 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.31 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.32 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.33 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.34 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.35 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.36 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。

4.4.37 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期基金净值增长率14.37%,同期业绩比较基准收益率为14.37%。