

上投摩根安全战略股票型基金

【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预示其未来表现。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。

本报告自2015年10月1日起至12月31日止。

基金简称	上投摩根安全战略股票
基金代码	010009
交易代码	010009
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2015年12月26日
报告期末基金份额总额	1,271,574,583.00份
投资目标	通过系统化和深入的基本面研究，重点投资于与安全战略相关的上市公司，分享中国经济增长长期式发展带来的投资机会，在有效控制风险的前提下力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将通过系统化和深入的基本面研究，重点投资于与国家安全战略相关的上市公司，分享中国经济增长长期式发展带来的投资机会。本基金将重点投资于具有良好成长性的非金融类上市公司，分享中国经济增长长期式发展带来的投资机会。本基金将重点投资于具有良好成长性的非金融类上市公司，分享中国经济增长长期式发展带来的投资机会。本基金将重点投资于具有良好成长性的非金融类上市公司，分享中国经济增长长期式发展带来的投资机会。
业绩比较基准	中证800指数收益率*85%+中债总财富指数收益率*15%
风险收益特征	本基金属于股票型基金产品，预期风险和基金净值高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较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

主要财务指标	报告期 (2015年10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	39,055,087.43
2.本期利润	248,085,704.13
3.本期加权平均基金份额本期利润	0.1794
4.期末基金资产净值	1,386,226,177.87
5.期末基金份额净值	1.090

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。

上述基金业绩指标不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、红利再投资费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平可能会低于所列数据。

3.2 基金净值表现

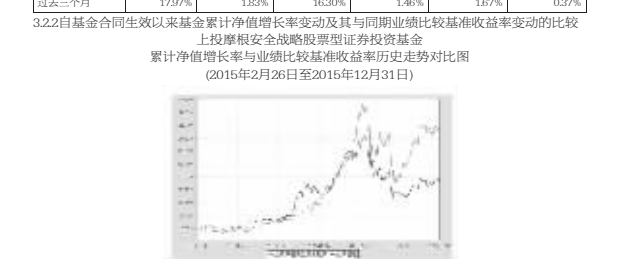
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准③	业绩比较基准收益差④	①-③	②-④
过去三个月	17.07%	13.0%	16.30%	1.46%	1.67%	0.37%

3.2.2自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

上投摩根安全战略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对比图
(2015年2月26日至2015年12月31日)



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。

本基金建仓期自2015年2月26日至2015年5月25日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

姓名	职务	任本基金基金经理期限 任期起始日期	离任日期	证券从业年限	说明
卢杨	本基金基金经理	2015-02-26	-	10年	卢杨先生，硕士研究生，自2004年5月至2007年4月在中国建设银行总行金融市场部工作，自2007年4月至2010年7月在中国国际期货有限公司担任分析师，自2010年7月起加入上投摩根基金管理有限公司，任基金经理兼资产管理部负责人。自2014年10月至2015年11月担任上投摩根成长先锋混合型证券投资基金基金经理，自2014年10月起兼任上投摩根成长先锋混合型证券投资基金基金经理，自2015年11月起兼任上投摩根安全战略股票型证券投资基金基金经理。

注：1.任职日期和离任日期均指根据基金合同规定确定的聘任日期和解聘日期。

2.卢杨先生为本基金前任基金经理，其任职日期自基金基金合同生效之日起。

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. 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，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，《上投摩根安全战略股票型证券投资基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资组合符合基金合同和法律规定的要求。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司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流程的各项要求，严格规范内上市股票、债券的一级市场和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式对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相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，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交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手选择控制和交易询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购赎回投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据数量优先的原则进行申购赎回交易；对于申购赎回投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据数量优先的原则进行申购赎回交易；对于申购赎回投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据数量优先的原则进行申购赎回交易。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价格差分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 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。

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情形：报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的5%的次数为两次，均发生在量化投资组合与主动管理投资组合之间。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度以来，经济延续下行趋势，货币和财政政策的宽松继续加强，在经历了大幅下跌之后，股市迎来了新一轮修复的上涨，创业板综合指数、沪深300指数分别高达39.1%、16.5%，针对这一阶段市场风险偏好提升特点，我们也积极提升了创业板仓位配置，取得了不错的回报。

展望2016年1季度，稳增长的政策基调以及宽松的货币政策没有变化，但是流动性边际改善在减弱，加之前期调控政策的有效性有所显现以及股票供给增量的逐步放开使得市场大幅反弹持续难度增加。在此背景下，我们淡化权数的影响，自下而上的精选反映未来经济结构转型方向的个股，具体包括新能源、军民融合等，争取为投资者带来更优的回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期末基金份额净值增长率为17.07%，同期业绩比较基准收益率为16.30%。

4.4.3报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

无。

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预示其未来表现。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	上投摩根成长先锋混合
基金代码	078810
交易代码	078810
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2006年9月20日
报告期末基金份额总额	882,464,104.24份
投资目标	本基金主要投资于国内市场上具有良好成长性的股票，积极捕捉成长性强上市公司并分享中国经济增长长期式发展带来的投资机会，在有效控制风险的前提下力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	(1) 股票投资策略：本基金采取定量分析与定性分析相结合的方式，挖掘具有良好成长性的上市公司，分享中国经济增长长期式发展带来的投资机会。本基金将重点投资于具有良好成长性的非金融类上市公司，分享中国经济增长长期式发展带来的投资机会。本基金将重点投资于具有良好成长性的非金融类上市公司，分享中国经济增长长期式发展带来的投资机会。本基金将重点投资于具有良好成长性的非金融类上市公司，分享中国经济增长长期式发展带来的投资机会。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债总财富指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金产品，预期风险和基金净值高于股票型基金、债券型基金和货币市场基金，属于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

主要财务指标	报告期 (2015年10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	140,132,092.80
2.本期利润	310,402,430.62
3.本期加权平均基金份额本期利润	0.3462
4.期末基金资产净值	1,304,387,565.68
5.期末基金份额净值	1.4781

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。

上述基金业绩指标不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、红利再投资费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平可能会低于所列数据。

3.2 基金净值表现

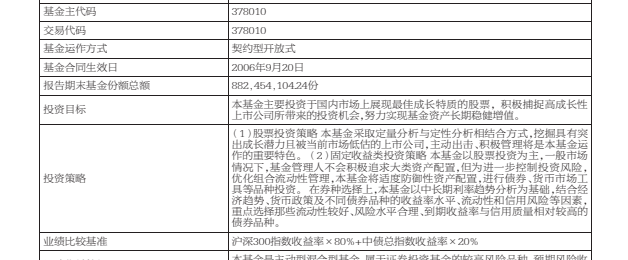
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准③	业绩比较基准收益差④	①-③	②-④
过去三个月	30.10%	21.4%	13.60%	1.34%	16.44%	0.80%

3.2.2自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

上投摩根成长先锋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历史走势对比图
(2006年9月20日至2015年12月31日)



注：本基金合同生效日为2006年9月20日，图示时间段为2006年9月20日至2015年12月31日。

本基金建仓期自2006年9月20日至2007年3月19日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

对报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

无。

姓名	职务	任本基金基金经理期限 任期起始日期	离任日期	证券从业年限	说明
吴文辉	本基金基金经理	2015-01-09	-	12年	吴文辉先生，自2003年7月至2007年7月在中国建设银行总行金融市场部工作，自2007年7月至2010年7月在中国国际期货有限公司担任分析师，自2010年7月起加入上投摩根基金管理有限公司，任基金经理兼资产管理部负责人。自2014年10月至2015年11月担任上投摩根成长先锋混合型证券投资基金基金经理，自2014年10月起兼任上投摩根成长先锋混合型证券投资基金基金经理，自2015年11月起兼任上投摩根成长先锋混合型证券投资基金基金经理。

主要财务指标	报告期 (2015年10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	16,760,792.90
2.本期利润	28,879,980.70
3.本期加权平均基金份额本期利润	0.229
4.期末基金资产净值	28,879,980.70
5.期末基金份额净值	1.000

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。

上述基金业绩指标不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、红利再投资费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平可能会低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准③	业绩比较基准收益差④	①-③	②-④
过去三个月	30.10%	21.4%	13.60%	1.34%	16.44%	0.80%

3.2.2自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

上投摩根成长先锋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历史走势对比图
(2006年9月20日至2015年12月31日)

注：本基金合同生效日为2006年9月20日，图示时间段为2006年9月20日至2015年12月31日。

本基金建仓期自2006年9月20日至2007年3月19日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

对报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

无。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,206,467,771.63	84.87
	其中：股票	1,206,467,771.63	84.87
2	固定收益投资	62,250,717.10	4.38
	其中：债券	62,250,717.10	4.38
	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	--	--
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	--	--
6	银行存款和结算备付金合计	140,238,016.66	10.00
7	其他各项资产	3,584,088.64	0.26
8	合计	1,421,540,593.02	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	849,969,187.75	61.24
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	66,360,640.72	4.71
E	建筑业	17,432,139.00	1.26
F	批发和零售业	31,627,702.74	2.28
G	交通运输、仓储和邮政业	44,131,022.00	3.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	102,101,822.94	7.37
J	金融业	13,717,322.00	0.99
K	房地产业	21,004,626.17	1.52
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	62,073,381.41	4.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	1,206,467,771.63	87.03

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000226	大亚股份	2,367,166	87,348,426.40	6.30
2	000002	万科A	2,688,294	80,944,747.80	5.84
3	600271	航天信息	886,413	61,913,872.08	4.47
4	002191	成发集团	4,000,000	61,440,000.00	4.43
5	601011	华鑫证券	724,443	44,191,023.00	3.19
6	000040	许继电气	2,069,569	40,219,303.37	2.90
7	300037	东方雨润	534,066	37,286,480.20	2.69
8	000568	东方能源	1,433,971	36,881,724.12	2.66
9	002037	南方精工	2,140,289	35,391,393.03	2.58
10	002241	聚兴中学	1,027,568	35,363,763.00	2.56

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合			
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	35,077,000.00	2.53
2	央行票据	—	—
3	金融债券	27,173,717.10	1.96
	其中：政策性金融债	27,173,717.10	1.96
4	企业债券	—	—
5	含权短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转换债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	62,250,717.10	4.49

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010569	15国债09	360,000	35,077,000.00	2.53
2	010801	国开1301	271,710	27,173,717.10	1.96

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000226	大亚股份	2,367,166	87,348,426.40	6.30
2	000002	万科A	2,688,294	80,944,747.80	5.84
3	600271	航天信息	886,413	61,913,872.08	4.47
4	002191	成发集团	4,000,000	61,440,000.00	4.43
5	601011	华鑫证券	724,443	44,191,023.00	3.19
6	000040	许继电气	2,069,569	40,219,303.37	2.90
7	300037	东方雨润	534,066	37,286,480.20	2.69
8	000568	东方能源	1,433,971	36,881,724.12	2.66
9	002037	南方精工	2,140,289	35,391,393.03	2.58
10	002241	聚兴中学	1,027,568	35,363,763.00	2.56

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000226	大亚股份	2,367,166	87,348,426.40	6.30
2	000002	万科A	2,688,294	80,944,747.80	5.84
3	600271	航天信息	886,413	61,913,872.08	4.47
4	002191	成发集团	4,000,000	61,440,000.00	4.43
5	601011	华鑫证券	724,443	44,191,023.00	3.19
6	000040	许继电气	2,069,569	40,219,303.37	2.90
7	300037	东方雨润	534,066	37,286,480.20	2.69
8	000568	东方能源	1,433,971	36,881,724.12	2.66
9	002037	南方精工	2,140,289	35,391,393.03	2.58
10	002241	聚兴中学	1,027,568	35,363,763.00	2.56

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000226	大亚股份	2,367,166	87,348,426.40	6.30
2	000002	万科A	2,688,294	80,944,747.80	5.84
3	600271	航天信息	886,413	61,913,872.08	4.47
4	002191	成发集团	4,000,000	61,440,000.00	4.43
5	601011	华鑫证券	724,443	44,191,023.00	3.19
6	000040	许继电气	2,069,569	40,219,303.37	2.90
7	300037	东方雨润	534,066	37,286,480.20	2.69
8	000568	东方能源	1,433,971	36,881,724.12	2.66
9	002037	南方精工	2,140,289	35,391,393.03	2.58
10	002241	聚兴中学	1,027,568	35,363,763.00	2.56

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000226	大亚股份	2,367,166	87,348,426.40	6.30
2	000002	万科A	2,688,294	80,944,747.80	5.84
3	600271	航天信息	886,413	61,913,872.08	4.47
4	002191	成发集团	4,000,000	61,440,000.00	4.43
5	601011	华鑫证券	724,443	44,191,023.00	3.19
6	000040	许继电气	2,069,569	40,219,303.37	2.90
7	300037	东方雨润	534,066	37,286,480.20	2.69
8	000568	东方能源	1,433,971	36,881,724.12	2.66
9	002037	南方精工	2,140,289	35,391,393.03	2.58
10	002241	聚兴中学	1,027,568	35,363,763.00	2.56

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000226	大亚股份	2,367,166	87,348,426.40	6.30
2	000002	万科A	2,688,294	80,944,747.80	5.84
3	600271	航天信息	886,413	61,913,872.08	4.47
4	002191	成发集团	4,000,000	61,440,000.00	4.43
5	601011	华鑫证券	724,443	44,191,023.00	3.19
6	000040	许继电气	2,069,569	40,219,303.37	2.90
7	300037	东方雨润	534,066	37,286,480.20	2.69
8	000568	东方能源	1,433,971	36,881,724.12	2.66
9	002037	南方精工	2,140,289	35,391,393.03	2.58
10	002241	聚兴中学	1,027,568	35,363,763.00	2.56

上 世 麻 相 成 长 生 终					
-----------------	--	--	--	--	--