

上投摩根安全战略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，确认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。

本报告为财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31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	000099
交易代码	000099
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月6日
报告期末基金份额总额	1,271,174,100.00份
投资目标	通过系统深入的基本面研究，重点投资于与宏观经济相关的上市公司，充分把握经济结构转换带来的投资机会，在控制风险的前提下力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金将通过深入的基本面研究，重点投资于与宏观经济相关的上市公司，充分把握经济结构转换带来的投资机会，在控制风险的前提下力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金将通过深入的基本面研究，重点投资于与宏观经济相关的上市公司，充分把握经济结构转换带来的投资机会，在控制风险的前提下力争实现基金资产的稳健增值。
业绩比较基准	中证500指数收益×90%+中国国债指数收益×10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险和收益水平高于混合型基金，低于债券型基金和货币市场基金，属中等较高风险收益水平的基金品种。
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		单位：人民币元	
		报告期	
主要财务指标		(2015年10月1日-2015年12月31日)	
1.本期已实现收益		39,066,087.63	
2.本期利润		248,095,794.13	
3.加权平均基金份额本期利润		0.1784	
4.期末基金资产净值		1,396,226,173.97	
5.期末基金份额净值		1.0901	

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。

注：本期利润为本期已实现的收入加上本期公允价值变动收益扣除相关费用后的余额。

注：本期加权平均基金份额本期利润=本期利润除以报告期期末基金资产净值。

注：上述基本净值指标不包括持有人认购或申购基金时产生的费用（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要低于所列数字。

3.2 基金净值情况

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.97% 13.83% 16.30% 1.46% 1.67% 0.37%

3.2.2 自基金合同生效以来以基金累计净值增长率变化与其同期间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尚未满一年。

本基金建仓期自2015年2月26日至2015年8月25日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定的各项比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介			
姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限
卢扬	本基金基金经理	2015-02-26	- 10年

注：1.任本基金日期即担任本公司决定确定的聘任日期即聘任日期。

2.卢扬先生为本基金基金经理，其任职日期即担任本基金基金经理合同生效之日。

3.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指标的分析

本基金在报告期内整体表现良好，严格遵循基金合同规定的投资范围、投资比例、投资策略、投资组合和投资限制，严格执行法律法规和行业自律规则。

本基金在报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规，《上投摩根成长全能股票型证券投资基金基金合同》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，基金经理投资组合的合规性符合法律法规的要求。

4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续遵循《证券投资基金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制度的各项要求，严格执行境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等各项活动，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范围内公平对待。

对于不同市场投资活动，本公司执行公平交易和利益共享的原则，对申购赎回行为，本公司遵循价格优先、份额分配均匀的原则；对买卖申报的场外交易和大宗交易等，按照公平对待的原则，通过综合评估和调整申报的买卖时机、买卖价格以及买卖数量，实现公平交易和利益共享。

对于交易所市场投资活动，本公司执行公平交易和利益共享的原则，对申购赎回行为，本公司遵循价格优先、份额分配均匀的原则；对买卖申报的场外交易和大宗交易等，按照公平对待的原则，通过综合评估和调整申报的买卖时机、买卖价格以及买卖数量，实现公平交易和利益共享。

对于柜台市场投资活动，本公司执行公平交易和利益共享的原则，对申购赎回行为，本公司遵循价格优先、份额分配均匀的原则；对买卖申报的场外交易和大宗交易等，按照公平对待的原则，通过综合评估和调整申报的买卖时机、买卖价格以及买卖数量，实现公平交易和利益共享。

4.4 报告期内基金的估值政策和会计政策

2015年4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码，在经历了大幅下跌之后，股市迎来了一轮修复的上涨，创业板指数涨幅高达39.1%，16.5%。针对这一阶段市场风格偏好修复的特点，我们积极提升了调整提升了仓位的配置，取得了不错的收益。

展望2015年的季度，稳增长的政策基调以及宽松的货币政策没有变化，但是流动性的边际改善在减弱，加之前期政策的有序退出以及股票市场的逐步恢复使得市场大概率维持震荡格局。在此背景下，我们淡化指数的判断，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、军工融合等，争取为投资者带来更好的回报。

4.5 2015年内基金经理的业绩表现

本基金在报告期内实现的总回报率为17.97%，同行业业绩比较基准收益率为16.30%。

4.5.1 报告期内基金持有人数或基金资产净值预说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.1.1 报告期末按资产类别分项的资产配置比例

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.1.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

5.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股权类投资明细

5.1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

5.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

5.1.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险理财产品投资明细

5.1.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期货投资明细

5.1.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资明细

5.1.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他投资明细

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.2.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股权类投资组合

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资组合

5.2.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险理财产品投资组合

5.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期货投资组合

5.2.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资组合

5.2.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他投资组合

5.3 主要财务指标和基金净值表现

5.3.1 主要财务指标

5.3.2 主要财务指标

5.3.3 主要财务指标

5.3.4 主要财务指标

5.3.5 主要财务指标

5.3.6 主要财务指标

5.3.7 主要财务指标

5.3.8 主要财务指标

5.3.9 主要财务指标

5.3.10 主要财务指标

5.3.11 主要财务指标

5.3.12 主要财务指标

5.3.13 主要财务指标

5.3.14 主要财务指标

5.3.15 主要财务指标

5.3.16 主要财务指标

5.3.17 主要财务指标

5.3.18 主要财务指标

5.3.19 主要财务指标

5.3.20 主要财务指标

5.3.21 主要财务指标

5.3.22 主要财务指标

5.3.23 主要财务指标

5.3.24 主要财务指标

5.3.25 主要财务指标

5.3.26 主要财务指标

5.3.27 主要财务指标

5.3.28 主要财务指标

5.3.29 主要财务指标

5.3.30 主要财务指标

5.3.31 主要财务指标

5.3.32 主要财务指标

5.3.33 主要财务指标

5.3.34 主要财务指标

5.3.35 主要财务指标