

上投摩根智慧互联股票型证券投资基金

[2016]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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年一月二十日

§ 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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中行工商银行政股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和组合报告等内容，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代表未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2016年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,613,875,364.75	87.15
	其中:股票	1,613,875,364.75	87.15
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	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	224,082,757.13	1.20
7	其他各项资产	13,890,369.82	0.75
8	合计	1,851,849,491.70	100.00

§ 3 报告期末基金资产组合情况

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	87,903,383.62	4.88	
C 制造业	969,910,822.15	53.84	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00	
E 建筑业	69,128,510.31	3.84	
F 批发和零售业	106,783,894.81	6.06	
G 交通运输、仓储和邮政业	9,495.69	0.00	
H 住宿和餐饮业	-	-	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	123,463,442.16	6.99	
J 金融业	76,221,575.78	4.24	
K 批发零售业	-	-	
L 租赁和商务服务业	25,326,333.71	1.41	
M 科学研究、技术服务及地质勘查业	3,367,000.00	0.18	
N 水利、环境和公共设施管理业	200,460.00	0.01	
O 国际服务、港澳台和其他服务业	-	-	
P 教育	93,477,096.33	5.19	
Q 卫生和社会工作	-	-	
R 文化、体育和娱乐业	97,156,491.88	3.18	
S 综合	-	-	
合计	1,613,875,364.75	89.68	

§ 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票投资明细

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	002411	必康股份	5,469,444.00	147,077,090.20	8.21
2	002377	东方锆业	93,477,096.33	5.19	
3	002108	锦华股份	2,356,041.00	87,262,062.90	4.85
4	002466	欧菲光	2,192,383.00	76,154,967.00	4.18
5	300340	科伦药业	1,350,546.00	72,152,378.00	4.01
6	002343	慈文影视	1,205,364.00	67,156,491.88	3.18
7	601233	桐昆股份	3,681,480.00	62,966,615.68	2.94
8	002768	国恩股份	1,026,340.00	47,826,594.04	2.66
9	000989	金马股份	3,217,762.00	46,432,306.06	2.58
10	300008	海兰生物	1,269,361.00	46,167,007.29	2.53

§ 5 报告期末按照行业分类的股票投资组合

注:本基金合同生效以来基金资产净值增长率与同期同行业比较基准收益率变动的比较

上投摩根智慧互联股票型证券投资基金

本基金合同生效以来基金资产净值增长率与同期同行业比较基准收益率的历史走势对比如图(2015年6月9日至2016年12月31日)



注:本基金合同生效日为2015年6月9日,报告时间为2015年6月9日至2016年12月31日。

本基金建仓期自2015年6月9日至2015年12月8日,建仓结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

§ 6 管理人报告

4.1 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间	证券从业年限	说明
郭帆	本基金基金经理	2015-06-09	-	10年

注:1.任日期即和离任日期指公司决定的聘任日期和解聘日期。
2.郭帆先生为本基金基金经理,其任职期间本基金合同生效之日。
3.孙从业的含义从行业协会《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规守信情况的说明

报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金合同》的规定,履行诚实守信、勤勉尽责的基金管理职责,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司继续贯彻执行《证券投资基金行业公平交易制度指导意见》等有关规定。

4.4 报告期内基金的投资组合报告

4.4.1 主要财务指标

4.4.2 报告期内基金的利润分配情况

4.4.3 报告期内基金的费用情况

4.4.4 公平交易制度的执行情况

4.4.5 投资组合报告

4.4.6 投资组合报告附注

因包含五只原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期初基金份额总额

本报告期总申购份数

本报告期赎回份数

本报告期基金余额变动

本报告期末基金份额总额

5.1 基金管理人运用资金投资本基金情况

5.1.1 备查文件目录

5.1.2 报告期内基金投资策略和运作分析

四市场的整体震荡探底走势,成交量低迷,活跃度不高,处于资金量高博弈的状况,大盘蓝筹股表现强于中小市值股票,低估值、低仓位的品种在大宗商品、周期、供给端相对较好的板块,大多股票的上涨趋势和市场赚钱效应不强,四季度美国大选成为市场影响最大的事件,特朗普上台后,对全球金融市场产生了较大的影响,12月份美联储加息预期加强,人民币贬值,相关股票也有所表现,随后受到监管层的重点关注之后有所回落。

四季度的市场赚钱效应不强,与本基金慧互联相关行业的个股相对较好,在第四季度表现不错,四季度前半段,沪深两市资金大举入场,相关股票也有表现,随后受到监管层的重点关注之后有所回落。

展望2017年一季度,本基金将保持震荡格局,市场存量资金博弈的格局没有被打破,特朗普上

5.1.3 投资组合报告附注

5.1.4 投资组合报告附注

5.1.5 投资组合报告附注

5.1.6 投资组合报告附注

5.1.7 投资组合报告附注

5.1.8 投资组合报告附注

5.1.9 投资组合报告附注

5.1.10 投资组合报告附注

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.12 投资组合报告附注

5.1.13 投资组合报告附注

5.1.14 投资组合报告附注

5.1.15 投资组合报告附注

5.1.16 投资组合报告附注

5.1.17 投资组合报告附注

5.1.18 投资组合报告附注

5.1.19 投资组合报告附注

5.1.20 投资组合报告附注

5.1.21 投资组合报告附注

5.1.22 投资组合报告附注

5.1.23 投资组合报告附注

5.1.24 投资组合报告附注

5.1.25 投资组合报告附注

5.1.26 投资组合报告附注

5.1.27 投资组合报告附注

5.1.28 投资组合报告附注

5.1.29 投资组合报告附注

5.1.30 投资组合报告附注

5.1.31 投资组合报告附注

5.1.32 投资组合报告附注

5.1.33 投资组合报告附注

5.1.34 投资组合报告附注

5.1.35 投资组合报告附注

5.1.36 投资组合报告附注

5.1.37 投资组合报告附注

5.1.38 投资组合报告附注

5.1.39 投资组合报告附注

5.1.40 投资组合报告附注

5.1.41 投资组合报告附注

5.1.42 投资组合报告附注

5.1.43 投资组合报告附注

<p