

上投摩根中国优势证券投资基金

[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:中国建设银行股份有限公司
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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人和基金托管人根据本基金合同的约定，于2017年1月19日核对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。

基金管理人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2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根中国优势组合
基金代码	370100
交易代码	370100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年10月16日
报告期末基金份额总额	1,123,334,235.65

4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年4季度市场先扬后抑，市场在10.11受到以PMI为代表的宏观经济指标好转影响，信心明显回暖，有色金属、建筑等周期板块获得明显的交易机会。但是到了12月之后，央行执行流动性管理工具收紧资金，导致市场预期转淡，同时部分投资者对中央经济工作会议关于2017年经济增速和货币政策的表述产生一定的担忧，导致对周期类品种的看空出现分歧。本基金根据市场情况，对核心品种采取坚定的策略，同时结合对于宏观经济的判断，增加了部分周期类品种的持仓。另一方面，需求端可能对经济政策的预期转淡，导致对周期类品种的看空，但不保证基金一定盈利。

展望2017年一季度，我们对市场的看法逐步转向乐观，同时压制市场交易的流动性及汇率等因素趋于缓解，部分品种较好的成长类品种经过前期调整后，已经进入到了风险收益比相对合理的区间范围；另一方面，需求端可能对经济政策的预期转淡，导致对周期类品种的看空，但不保证基金一定盈利。

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。

基金管理人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2016年10月1日起至12月31日止。

§3 主要财务指标

单位:人民币元

报告期

(2016年10月1日-2016年12月31日)

1.本期已实现收益

-38,944,172.74

2.本期利润

-71,651,436.62

3.加权平均基金份额本期利润

-0.0620

4.期末基金份额净值

1,119,639,304.72

5.期末可供分配基金份额利润

0.0620

注:本期利润为本期已实现收益加上本期利润的变动收益。

上述基金利润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、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

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

净值增长率差

业绩比较基准收益率

(1)~(3)

(2)~(4)

过去三个月

-4.08%

0.93%

0.46%

0.52%

-0.50%

0.41%

3.2.2 本基金合同生效以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根中国优势证券投资基金

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率走势图

(2004年9月15日至2016年12月31日)

5.4 报告期未按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期未持有股票。

5.5 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期未持有债券。

5.6 报告期未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

本基金本报告期未持有资产支持证券。

5.7 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期未持有贵金属。

5.8 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期未持有权证。

5.9 报告期未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

本基金本报告期未持有股票。

5.10 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

本基金本报告期未持有股指期货。

5.11 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

本基金本报告期未持有国债期货。

5.12 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票期权投资明细

本基金本报告期未持有股票期权。

5.13 其他资产构成

序号

名称

金额(元)

占基金资产净值比例(%)

1 002411 必康股份 3,791,763 0.34%

2 002466 旗滨集团 2,659,913 0.23%

3 300115 长盛客车 3,395,438 0.30%

4 300136 信维通信 2,156,587 0.19%

5 600208 大族激光 1,504,414 0.13%

6 000104 上海医药 1,333,408 0.12%

7 000630 丽珠集团 10,116,300 0.88%

8 000990 金马股份 1,982,049 0.17%

9 002640 鸿博股份 1,016,409 0.09%

10 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

11 002640 鸿博股份 2,725,213.70 0.24%

12 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

13 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

14 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

15 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

16 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

17 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

18 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

19 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

20 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

21 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

22 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

23 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

24 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

25 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

26 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

27 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

28 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

29 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

30 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

31 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

32 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

33 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

34 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

35 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

36 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

37 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

38 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

39 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

40 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

41 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

42 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

43 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

44 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

45 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

46 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

47 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

48 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

49 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

50 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

51 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

52 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

53 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

54 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

55 002640 鸿博股份 1,616,039 0.14%

56 002640 鸿博股份 1,616,039