

上投摩根核心优选混合型证券投资基金

[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。

基金托管人中国建设银行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、资产配置等内容,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。

本报告未经财务资料未经审计。

报告期自2016年10月1日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	上投摩根核心优选混合
基金代码	370204
交易代码	370204
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年1月28日
报告期末基金总资产	364,023,367.71元
投资目标	本基金在宏观基本面分析的基础上,运用定性分析和定量分析相结合的方法,对宏观经济、行业配置、公司基本面进行深入研究,精选具有投资价值的股票,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1.资产配置策略 本基金从宏观经济出发,运用定性分析和定量分析相结合的方法,对宏观经济、行业配置、公司基本面进行深入研究,精选具有投资价值的股票,力求实现基金资产的长期稳定增值。 2.股票投资策略 本基金在深入研究的基础上,精选具有投资价值的股票,力求实现基金资产的长期稳定增值。 3.债券投资策略 本基金在深入研究的基础上,精选具有投资价值的债券,力求实现基金资产的长期稳定增值。 4.货币市场工具投资策略 本基金在深入研究的基础上,精选具有投资价值的货币市场工具,力求实现基金资产的长期稳定增值。 5.权证投资策略 本基金在深入研究的基础上,精选具有投资价值的权证,力求实现基金资产的长期稳定增值。 6.资产支持证券 本基金在深入研究的基础上,精选具有投资价值的资产支持证券,力求实现基金资产的长期稳定增值。 7.股指期货投资 本基金在深入研究的基础上,精选具有投资价值的股指期货,力求实现基金资产的长期稳定增值。 8.报告期末基金的资产配置情况 报告期末基金的资产配置情况
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行定期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,其预期风险和预期收益均高于混合型基金,高于债券型基金。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 (2016年10月1日-2016年12月31日)

1.本期已实现收益 -31,273,530.03

2.本期利润 -26,826,769.31

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0781

4.期末基金资产净值 798,022,346.71

5.期末基金份额 2,167

6.报告期末基金资产净值 789,340,376.67

7.报告期末基金份额 2,167,000.00

8.报告期末按基金的资产配置情况

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的