

# 上投摩根成长先锋混合型证券投资基金

# 2016年年度报告摘要

在本报告期内,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,本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规,《上投摩根成长先锋混合型证券投资基金基金合同》的规定,基金经对于股和投资的组合的比例遵守了投资业绩说明书中的业绩比较基准,基金投资组合符合基金合同和法律法规的要求。

4.3 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求,制订了《上投摩根基金管理有限公司公平交易制度》,规范了公司所有投资组合的投融资、债券资产和品种的投资管理、同日买卖等授权,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各个环节,以确保本基金管理人的不同投资组合按照公平交易。

公司执行自上而下的三级授权体系,依次为投资决策委员会、投资总监、基金经理,经理人在其授权范围内决策,投资决策委员会和投资总监不得干预其授权范围内的投资活动。

公司已建立系统的研究方法,并充分利用内幕信息作为投资决策依据,各投资组合享有公平的投资机会。公司在集中交易制度、执行公平交易制度、对于交易所市场投资活动,不因投资组合在买入同一证券时,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机会;对于银行间市场投资活动,通过交易对手库控制和交易室询价机制,严格防范交易对手风险并抽除价格歧视;对于一级市场申购投资行为,遵循价格优先、比例分配原则,根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

公司制订了《异常交易监控与报告制度》,通过系统和人工相结合的方式进行投资交易行为的监控与分析,并执行异常交易行为监控与分析工作机制,确保公平交易可稽核。公司对于每年度和每半年对公司管理的不同投资组合的收益差异及不同时间窗下同向交易的价格差异进行分析,并留存报告备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行上述公平交易制度和控制方法,开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的收益率差异,以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的价格差异,从交易等方面监控,并发现整体公平交易执行出现异常的情况。

其中,在同向交易的价格监控和分析方面,根据法律法规,公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控,通过定期梳理前述同向交易行为,定性分析交易是否合理,对比不同投资组合长期的交易趋势,重点关注近期可能导致的公平交易价格异常的情况。对于识别的异常情况,由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释。同时,公司根据前述情况,通过系统复核进行对比,对于不同投资组合在不同时间窗口内(日、3日、5日)的同向交易差异进行分析,采用概率统计方法,主要关注不同投资组合之间同向交易差异均值是否显著性检验,以及同向交易价格占优的交易次数占比分析。

4.3.3 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、交易方向等的统计分析,公司未出现存在异常交易行为。

2.1 基金基本情况

2.2 基金产品说明

2.3 基金管理人及基金托管人

2.4 信息披露方式

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

3.2.2 自基金合同生效以来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

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

3.2.3 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*80%+中债综合指数收益率\*20%。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

7.4 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.1 公平交易制度和控制方法

7.4.2 公平交易制度的执行情况

7.4.3 异常交易行为的专项说明

7.4.4 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.5 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.6 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.7 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.8 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.9 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.10 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.11 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.12 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.13 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.14 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.15 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.16 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.17 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.18 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.19 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.20 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.21 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.22 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.23 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.24 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.25 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.26 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.27 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.28 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.29 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.30 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.31 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.32 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.33 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.34 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.35 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.36 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.37 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.38 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.39 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.40 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.41 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.42 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.43 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.44 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.45 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.46 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.47 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.48 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.49 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.50 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.51 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.52 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.53 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.54 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.55 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.56 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.57 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.58 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.59 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.60 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.61 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.62 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.63 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.64 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.65 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.66 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.67 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.68 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.69 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.70 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.71 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.72 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.73 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.74 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.75 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.76 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.77 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.78 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.79 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.80 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.81 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.82 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.83 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.84 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.85 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.86 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.87 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.88 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

7.4.9.3.2 交易所市场非正常申购

7.4.10 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

(i) 公允价值估值方法

公允价值估值结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次,相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次,相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的金额为640,430,671.89元,属于第二层次的金额为17,357,686.87元,无属于第三层次的金额(2015年12月31日,第一层次895,189,698.00元,第二层次202,860,203.32元,无属于第三层次的金额)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨停板停牌或交易所不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次,并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iv) 第三层次公允价值计量和本期变动金额

(v) 持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日,本基金持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015年12月31日)为:-

不以公允价值计量的金融工具

(i) 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相若。

(ii) 按公允价值计量的金融工具

8.1 期末基金资产组合情况

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期内按行业分类的境内股票投资组合

8.3 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

8.4 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

8.4.1 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

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有投资明细,应阅读投资于本基金管理人网站(www.cfm.com)的年度投资报告。

8.4.1 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

8.4.1 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

8.4.1