

# 上投摩根核心优选混合型证券投资基金

## 2016年度报告摘要

2016年 12月 31 日

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：二〇一七年三月三十日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。

本基金年度报告未经三分之二以上独立董事签字确认，并由董事长签发。

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 29 日核对了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核无误。勤勉尽责的原则和运用基金资产，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基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要披露年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本基金报告自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 上投摩根核心优选混合型证券投资基金

基金简称 370204

基金代码 370204

基金运作方式 封闭式

基金合同期限 2012/11/28 至 2012/11/28

基金管理人 上投摩根基金管理有限公司

基金托管人 上投摩根基金管理有限公司

基金合同生效日 364.023.3071 份

基金募集期间 364.023.3071 份

基金合同终止日 不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 在本基金合同有效期内，本基金将通过精选行业、精选个股，力争在严格控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金在充分研究的基础上，采用定量分析和定性分析相结合的方法，综合考虑宏观经济环境、国家政策、行业景气度、公司治理、估值水平、市场情绪等多方面因素，精选具有持续竞争优势的上市公司，构建投资组合。

投资范围 本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票（含存托凭证）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

投资比例 本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 50%，其中投资于本基金所定义的核心资产的比例不低于 80%；投资于债券的比例不高于基金资产的 50%，其中投资于国债的比例不高于基金资产的 20%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不高于基金资产的 20%；权证、资产支持证券、衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具的投资比例不高于基金资产的 10%；存托凭证的投资比例不高于基金资产净值的 10%。

禁售期 本基金首次募集期为 2012 年 11 月 28 日至 2012 年 12 月 31 日，基金合同生效后进入封闭期，封闭期为 2012 年 11 月 28 日至 2013 年 11 月 27 日。

风险收益特征 本基金为混合型基金，预期收益介于股票型基金与债券型基金之间，属于中等风险品种。

收益分配原则 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R4 级，适合风险承受能力为“进取型”的投资者。

风险收益特征 本基金的风险评级为 R5 级，适合风险承受能力为“激进型”的投资者。

风险收益特征 本基金是一只主动管理的股票基金，其风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金和货币型基金。