

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金

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
报告送达日期：二〇一七年三月三十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监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。本基金年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事会签发。

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司根据基金合同的规定，于2017年3月29日核算了本基金中的财务指标、净值表现、利得和损失情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	上投摩根中证消费服务指数
基金主代码	370023
交易代码	370023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月25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
报告期末基金总资产	15,387,107.69元
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品利润

投资目标 在基金进行积极地价值投资，通过严格的投资纪律和审慎的风险管理，力争在控制基金净值增长和相对收益的基础上获取超越业绩基准的收益。

投资策略 本基金将采用完全复制法，通过系统化和工具化的方法，将基金资产投资于构成标的指数成分股的股票，以期在扣除相关费用后，使基金的净值增长率与标的指数的净值增长率相接近。

业绩比较基准 95%×中证消费服务领先指数收益率+5%×现金回购比例。

风险收益特征 本基金为股票型基金，长期内预期收益率高于货币基金、债券基金、货币市场基金等，具有较高的风险收益产品。

2.3 管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
上投摩根基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司	
姓名	施彦	
信批披露负责人	021-36794888	010-67795096
联系电话	service@cfmchina.com	tianqing@zhigob.com
客户服务电话	400-889-4888	010-67795096
传真	021-20628400	010-66275853

2.4 信息披露方式

基金份额年度报告的管理人互联网网址 <http://www.cfmchina.com>

基金份额年度报告地点 本基金管理人、基金托管人的办公场所

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

项目	金额单位：人民币元
3.1.1 期间数据和指标	
年初至报告期期末	2016年 1月 1日至 2016年 12月 31日
本期已实现收益	-1,489,006.73
2016年 1月 1日至 2016年 12月 31日	16,064,928.34
2.999,845.41	
本期利润	-2,898,223.5
9,106,517.77	
8,323,863.82	
本期已实现基金份额利润	-0.1946
0.3508	
0.0205	
本期已实现份额净值增长率	-11.65%
21.89%	
20.41%	
3.1.2 相关指标	
2016年末	2015年末
2014年末	
公司已分配利润总额	0.2737
0.4422	
0.0016	
公司未分配利润	19,598,019.09
22,668,408.03	
54,255,727.81	
期初基金份额净值	1.274
1.442	
1.183	

注：1. 本期已实现收益指基金利润收入、投资收益、其他收入（不含汇兑损益）变动对基金份额的贡献；余额本期为实现收入加上本期利润，本期利润未变动时，对本期可供分配利润、采用期末资产负债表中未分配利润与本期利润之和计算。

2. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（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 基金份额净值增长率为数及其与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年9月25日至2016年12月31日)

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

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

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自基金合同生效以来基金净值增长率变化率与其同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注：本基金的业绩比较基准为：95%×中证消费服务领先指数收益率+5%×货币市场基金收益率。

3.2.3 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.4 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.5 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.6 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.7 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.8 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.9 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.10 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.11 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.12 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.13 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.14 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.15 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.16 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.17 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.18 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金自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的历史走势对比图

注：本基金于2012年9月25日正式成立，图示的时间段为2012年9月25日至2016年12月31日。本基金成立初期2012年9月25日至2013年3月24日期间，建仓初期资产配置比例符合本基金合同规定。

3.2.19 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图