

上投摩根阿尔法混合型证券投资基金

[2017] 第一季度报告

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：二〇一七年四月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员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。

基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五百万元的，基金管理人应当解散基金合同，并向中国证监会报告。

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。

§ 2 报告期内财务资料未经审计。

报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 3 基金产品概况

基金简称：上投摩根阿尔法混合

基金代码：577010

交易代码：577010

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2006年1月11日

报告期末基金资产总额：698,331,282,23份

报告期末基金份额总额：698,331,282,23份

本基金采用平衡风格投资策略(Balanced Approach)，即通过“成长”与“价值”双重驱动选股，精选具有高成长性的股票和估值合理的股票，同时对冲组合的风险，从而实现长期稳定的收益。

投资目标：本基金将通过投资于不同类型的股票资产组合，同时结合公司所处的行业环境、风险因子等深入分析，对个股进行适当调整，努力创造投资组合的市场适应性，以求在各环境中都能创造超越基准的主动管理回报。

投资策略：本基金将综合考虑宏观经济、政策、行业、公司基本面、估值、流动性等因素，通过严格的投资选择，积极构建并持续优化“哑铃式”资产负债组合，结合严格的监控和风险管理，不断追求超越市场的基准的绝对回报。

业绩比较基准：沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%

风险收益特征：本基金为混合型证券投资基金，预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -14,979,367.20

2.本期期间费用 223,169,444.44

3.加权平均基金份额本期利润 0.347

4.期末基金资产净值 2,294,898,533.14

注：本期实现收益指基金本期利润减去所有费用后的余额，在于下而的股息派发，精算假设个，即从

投资目标：本报告期内本基金投资股票、债券及货币市场工具的资产占基金资产的比例符合基金合

风险收益特征：本基金在实现收益的基础上，通过严格的投资选择，积极构建并持续优化“哑铃式”

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 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -14,979,367.20

2.本期期间费用 223,169,444.44

3.加权平均基金份额本期利润 0.347

4.期末基金资产净值 2,294,898,533.14

注：本期实现收益指基金本期利润减去所有费用后的余额，在于下而的股息派发，精算假设个，即从

投资目标：本报告期内本基金投资股票、债券及货币市场工具的资产占基金资产的比例符合基金合

风险收益特征：本基金在实现收益的基础上，通过严格的投资选择，积极构建并持续优化“哑铃式”

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 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -14,979,367.20

2.本期期间费用 223,169,444.44

3.加权平均基金份额本期利润 0.347

4.期末基金资产净值 2,294,898,533.14

注：本期实现收益指基金本期利润减去所有费用后的余额，在于下而的股息派发，精算假设个，即从

投资目标：本报告期内本基金投资股票、债券及货币市场工具的资产占基金资产的比例符合基金合

风险收益特征：本基金在实现收益的基础上，通过严格的投资选择，积极构建并持续优化“哑铃式”

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 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -14,979,367.20

2.本期期间费用 223,169,444.44

3.加权平均基金份额本期利润 0.347

4.期末基金资产净值 2,294,898,533.14

注：本期实现收益指基金本期利润减去所有费用后的余额，在于下而的股息派发，精算假设个，即从

投资目标：本报告期内本基金投资股票、债券及货币市场工具的资产占基金资产的比例符合基金合

风险收益特征：本基金在实现收益的基础上，通过严格的投资选择，积极构建并持续优化“哑铃式”

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 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -14,979,367.20

2.本期期间费用 223,169,444.44

3.加权平均基金份额本期利润 0.347

4.期末基金资产净值 2,294,898,533.14

注：本期实现收益指基金本期利润减去所有费用后的余额，在于下而的股息派发，精算假设个，即从

投资目标：本报告期内本基金投资股票、债券及货币市场工具的资产占基金资产的比例符合基金合

风险收益特征：本基金在实现收益的基础上，通过严格的投资选择，积极构建并持续优化“哑铃式”

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 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -14,979,367.20

2.本期期间费用 223,169,444.44

3.加权平均基金份额本期利润 0.347

4.期末基金资产净值 2,294,898,533.14

注：本期实现收益指基金本期利润减去所有费用后的余额，在于下而的股息派发，精算假设个，即从

投资目标：本报告期内本基金投资股票、债券及货币市场工具的资产占基金资产的比例符合基金合

风险收益特征：本基金在实现收益的基础上，通过严格的投资选择，积极构建并持续优化“哑铃式”

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 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -14,979,367.20

2.本期期间费用 223,169,444.44

3.加权平均基金份额本期利润 0.347

4.期末基金资产净值 2,294,898,533.14

注：本期实现收益指基金本期利润减去所有费用后的余额，在于下而的股息派发，精算假设个，即从

投资目标：本报告期内本基金投资股票、债券及货币市场工具的资产占基金资产的比例符合基金合

风险收益特征：本基金在实现收益的基础上，通过严格的投资选择，积极构建并持续优化“哑铃式”

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 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -14,979,367.20

2.本期期间费用 223,169,444.44

3.加权平均基金份额本期利润 0.347

4.期末基金资产净值 2,294,898,533.14

注：本期实现收益指基金本期利润减去所有费用后的余额，在于下而的股息派发，精算假设个，即从

投资目标：本报告期内本基金投资股票、债券及货币市场工具的资产占基金资产的比例符合基金合

风险收益特征：本基金在实现收益的基础上，通过严格的投资选择，积极构建并持续优化“哑铃式”

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 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -14,979,367.20

2.本期期间费用 223,169,444.44

3.加权平均基金份额本期利润 0.347

4.期末基金资产净值 2,294,898,533.14

注：本期实现收益指基金本期利润减去所有费用后的余额，在于下而的股息派发，精算假设个，即从

投资目标：本报告期内本基金投资股票、债券及货币市场工具的资产占基金资产的比例符合基金合

风险收益特征：本基金在实现收益的基础上，通过严格的投资选择，积极构建并持续优化“哑铃式”

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 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -14,979,367.20

2.本期期间费用 223,169,444.44

3.加权平均基金份额本期利润 0.347

4.期末基金资产净值 2,294,898,533.14

注：本期实现收益指基金本期利润减去所有费用后的余额，在于下而的股息派发，精算假设个，即从

投资目标：本报告期内本基金投资股票、债券及货币市场工具的资产占基金资产的比例符合基金合

风险收益特征：本基金在实现收益的基础上，通过严格的投资选择，积极构建并持续优化“哑铃式”

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 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -14,979,367.20

2.本期期间费用 223,169,444.44

3.加权平均基金份额本期利润 0.347

4.期末基金资产净值 2,294,898,533.14

注：本期实现收益指基金本期利润减去所有费用后的余额，在于下而的股息派发，精算假设个，即从

投资目标：本报告期内本基金投资股票、债券及货币市场工具的资产占基金资产的比例符合基金合

风险收益特征：本基金在实现收益的基础上，通过严格的投资选择，积极构建并持续优化“哑铃式”

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 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -14,979,367.20

2.本期期间费用 223,169,444.44

3.加权平均基金份额