

上投摩根天颐年丰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
欧洲货币:人民币

基金管理人的董事及高级管理人员所持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。

基金托管人的董事及高级管理人员所持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。

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金管理人和基金托管人应当根据基金合同的约定,履行各自职责,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。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	上投摩根天颐年丰混合
基金代码	000025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月18日
报告期末基金总资产	696,515,698.98元
投资目标	在有效控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值,力争为投资者提供稳定的现金流。

投资策略

1.资产配置策略:本基金将主要将资产配置于固定收益类资产,根据基金资产的性质变化和市场环境的变化,适时调整资产配置比例,在不同行业、不同资产类别之间进行资产配置,并根据基金的合同约定,适时调整资产配置比例,以达到风险与收益的平衡。

2.债券投资策略:本基金主要在货币市场、固定收益类金融工具、股票、商品、黄金等资产中进行配置,根据宏观经济、政策、市场环境的变化,适时调整资产配置比例,并根据基金的合同约定,适时调整资产配置比例,以达到风险与收益的平衡。

3.股票投资策略:本基金将主要在股票、商品、黄金等资产中进行配置,根据宏观经济、政策、市场环境的变化,适时调整资产配置比例,并根据基金的合同约定,适时调整资产配置比例,以达到风险与收益的平衡。

4.风险管理策略:本基金将主要将资产配置于固定收益类资产,根据基金资产的性质变化和市场环境的变化,适时调整资产配置比例,以达到风险与收益的平衡。

业绩比较基准

一年期定期存款利率(税后)+1%

风险收益特征

本基金为混合型基金产品,预期风险及预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属中等风险水平的基金产品。

基金管理人

上投摩根基金管理有限公司

基金托管人

中国银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称

上投摩根天颐年丰混合A

上投摩根天颐年丰混合C

下属分级基金的交易代码

000025

报告期末下属分级基金的份额总额

696,515,698.98份

§ 3 主要财务指标和净值表现

单位:人民币元

报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)				
	上投摩根天颐年丰混合A	上投摩根天颐年丰混合C	上投摩根天颐年丰混合C	上投摩根天颐年丰混合C
1.本期已实现收益	-1,915,085.45	-	-	-
2.本期利润	3,756,564.98	-	-	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0062	-	-	-
4.期末基金资产净值	598,330,924.60	-	-	-
5.期末基金份额净值	1.003	-	-	-

主要财务指标

1.本期利润

(2017年1月1日-2017年3月31日)

2.本期已实现收益

(2017年1月1日-2017年3月31日)

3.加权平均基金份额本期利润

(2017年1月1日-2017年3月31日)

4.期末基金资产净值

(2017年1月1日-2017年3月31日)

5.期末基金份额净值

(2017年1月1日-2017年3月31日)

注:本基金已根据合同约定于2014年1月17日,建仓期结束并按比例符合本基金基金合同规定。

本基金合同生效日(2013年7月18日),建仓期结束并按比例符合本基金基金合同规定。

注:截至报告期末,本基金未发生费用。

§ 4 财务报告

4.1 基金管理人(或基金托管人)简介

姓名	职务	任本基金的基金管理人	证券从业年限	说明
葛晓光	本基金基金经理	2015-04-22	-	8年 葛晓光先生于2000年7月至2003年7月在南航国际任项目经理;2003年7月至2006年7月在南航国际任项目经理;2006年7月至2009年7月在南航国际任项目经理;2009年7月至2010年7月在南航国际任项目经理;2010年7月至2011年7月在南航国际任项目经理;2011年7月至2012年7月在南航国际任项目经理;2012年7月至2013年7月在南航国际任项目经理;2013年7月18日至今任本基金基金经理。葛晓光先生具有基金从业资格,并取得基金从业资格证书。

4.2 基金管理人(或基金托管人)的内部控制制度

4.3 基金管理人(或基金托管人)的督察长

4.4 基金管理人(或基金托管人)的高级管理人员

4.5 基金管理人(或基金托管人)的基金经理

4.6 基金管理人(或基金托管人)的其他从业人员

4.7 其他从业人员

4.8 合计

6.1.1.3 机构客户

6.1.1.4 个人客户

6.1.1.5 其他客户

6.1.1.6 其他

6.1.1.7 其他

6.1.1.8 其他

6.1.1.9 其他

6.1.1.10 其他

6.1.1.11 其他

6.1.1.12 其他

6.1.1.13 其他

6.1.1.14 其他

6.1.1.15 其他

6.1.1.16 其他

6.1.1.17 其他

6.1.1.18 其他

6.1.1.19 其他

6.1.1.20 其他

6.1.1.21 其他

6.1.1.22 其他

6.1.1.23 其他

6.1.1.24 其他

6.1.1.25 其他

6.1.1.26 其他

6.1.1.27 其他

6.1.1.28 其他

6.1.1.29 其他

6.1.1.30 其他

6.1.1.31 其他

6.1.1.32 其他

6.1.1.33 其他

6.1.1.34 其他

6.1.1.35 其他

6.1.1.36 其他

6.1.1.37 其他

6.1.1.38 其他

6.1.1.39 其他

6.1.1.40 其他

6.1.1.41 其他

6.1.1.42 其他

6.1.1.43 其他

6.1.1.44 其他

6.1.1.45 其他

6.1.1.46 其他

6.1.1.47 其他

6.1.1.48 其他

6.1.1.49 其他

6.1.1.50 其他

6.1.1.51 其他

6.1.1.52 其他

6.1.1.53 其他

6.1.1.54 其他

6.1.1.55 其他

6.1.1.56 其他

6.1.1.57 其他

6.1.1.58 其他

6.1.1.59 其他

6.1.1.60 其他

6.1.1.61 其他

6.1.1.62 其他

6.1.1.63 其他

6.1.1.64 其他

6.1.1.65 其他

6.1.1.66 其他

6.1.1.67 其他

6.1.1.68 其他

6.1.1.69 其他

6.1.1.70 其他

6.1.1.71 其他

6.1.1.72 其他

6.1.1.73 其他

6.1.1.74 其他

6.1.1.75 其他

6.1.1.76 其他

6.1.1.77 其他

6.1.1.78 其他

6.1.1.79 其他

6.1.1.80 其他

6.1.1.81 其他

6.1.1.82 其他

6.1.1.83 其他

6.1.1.84 其他

6.1.1.85 其他

6.1.1.86 其他

6.1.1.87 其他

6.1.1.88 其