

上投摩根新兴动力股票型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014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：二〇一五年一月二十一日

1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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，也不保证基金份额持有人不受本金损失。投资者有风险，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。

本报告自2014年10月1日起至12月31日止。

1.1 基金产品概况

基金名称	上投摩根新兴动力股票
基金代码	377240
交易代码	377240
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年7月13日
报告期末基金份额总额	755,408,273.09份

投资目标

本基金在把握经济结构调整和产业升级的发展趋势基础上，充分挖掘新兴产业发展的投资机会，重点投资于新兴产业中的优质上市公司，并围绕新兴产业中具备成长潜力的上市公司进行投资，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。

投资策略

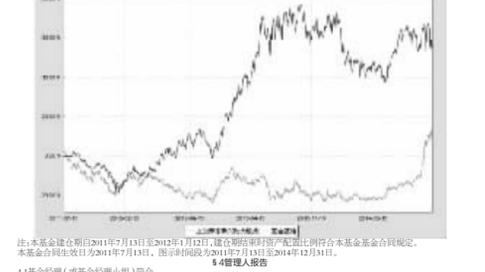
本基金管理人认为，从经济发展的中长期趋势看，转变经济发展方式实体经济转型升级为我国在相当一段时期内经济发展的首要任务。在金融结构调整、我国经济转型升级、国内经济结构转型升级等背景下，新兴产业将成为推动经济转型升级的重要引擎。本基金管理人认为，新兴产业是未来中国经济发展的主要驱动力，也是未来中国产业升级、结构调整和转型升级的重要引擎。本基金管理人认为，新兴产业是未来中国经济发展的主要驱动力，也是未来中国产业升级、结构调整和转型升级的重要引擎。

3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)	
1.本期末资产负债率		68.200,769.68	
2.本期利润		-90,997,721.14	
3.加权平均基金份额本期利润		-0.0964	
4.期末基金份额净值		1,180,586.08	
5.期末基金份额净值增长率		1.561	

3.2 基金份额持有人往来收益以基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段	净值增长率	业绩比较基准	①-②	②-③		
过去三个月	-5.16%	1.57%	1.58%	1.32%	-40.79%	0.25%



4.1 基金经理(或基金经理小组)

姓名	职务	任本基金的基金经理日期	任职日期	证券从业年限	说明
杜猛	本基金基金经理	2011-7-13	-	12年	毕业于上海交通大学，先后任职于平安证券、中银国际证券和中国国际信托，任研究员、2007年7月加入上投摩根基金管理有限公司，历任行业专家、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金基金经理。自2011年7月13日起担任上投摩根新兴动力股票型证券投资基金基金经理。自2011年5月20日至2014年12月31日担任上投摩根新兴动力股票型证券投资基金基金经理。自2014年12月31日起担任上投摩根新兴动力股票型证券投资基金基金经理。

4.2 基金经理(或基金经理小组)简介

注：1、任职日期和离职日期均以中国证监会公告的聘任日期和解聘日期为准；2、杜猛先生为本公司基金经理，其任职日期自中国证监会公告之日起计算；3、杜猛先生为本公司基金经理，其任职日期自中国证监会公告之日起计算；4、基金经理人对报告期内本基金运作情况的说明。

4.3 基金管理人内部交易管理制度

本基金管理人内部交易管理制度，旨在规范基金管理人内部交易行为，防止利益冲突，维护基金份额持有人的合法权益。基金经理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规，《上投摩根新兴动力股票型证券投资基金合同》的规定，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规，《上投摩根新兴动力股票型证券投资基金合同》的规定，基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规，《上投摩根新兴动力股票型证券投资基金合同》的规定。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	1,067,180,178.55	83.00
2	固定收益投资	1,067,180,178.55	83.00
3	银行存款	90,728,968.12	3.95
4	其他资产	90,728,968.12	3.95
5	资产减值准备	-	-

5.2 基金资产组合情况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	18,595,216.31	1.58
B	采矿业	3,697.06	0.00
C	制造业	558,992,561.38	47.35
D	电力、热力、燃气生产和供应业	9,035,402.30	0.73
E	建筑业	86,466,398.70	7.32
F	交通运输、仓储和邮政业	12,527,970.25	1.06
G	信息传输、软件和信息技术服务业	208,434,583.98	17.66
H	金融业	126,849,817.25	10.74
I	房地产业	2,058,000.10	0.17
L	租赁和商务服务业	20,010,481.64	1.70
M	科学研究和技术服务业	2,011,400.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	879,457.26	0.07
O	建筑业	974,122	0.08
P	教育、文化和体育业	50,127.92	0.01
R	综合	244,909.40	0.02
S	合计	1,067,180,178.55	90.40

5.3 报告期末按行业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

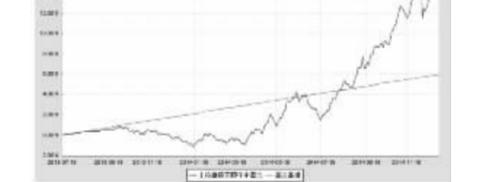
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002241	众业广告	4,450,330	109,166,594.00	9.25
2	301068	万昌信息	3,235,076	107,418,511.30	9.13
3	601633	长城汽车	2,243,673	93,224,613.15	7.91
4	002081	金麒麟	5,138,982	86,334,097.60	7.30
5	300115	长信科技	4,523,160	82,004,890.80	6.95
6	000925	华测检测	2,868,219	61,208,686.60	5.18
7	601318	中国平安	483,461	36,119,371.31	3.06
8	601198	中国平安	2,011,400	33,118,000.00	2.81
9	300166	东方园林	974,122	27,333,683.32	2.32
10	002553	三钢股份	848,411	25,935,924.27	2.20

5.4 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140207	14债07	30,000	30,045,000.00	2.54
2	140212	14债12	200,000	20,026,000.00	1.70
3	128009	中信转债	5,317	67,698,112	0.06

5.5 报告期末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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140207	14债07	30,000	30,045,000.00	2.54
2	140212	14债12	200,000	20,026,000.00	1.70
3	128009	中信转债	5,317	67,698,112	0.06



5.6 基金份额持有人往来收益以基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段	净值增长率	业绩比较基准	①-②	②-③		
过去三个月	9.20%	0.58%	0.99%	0.01%	8.21%	0.57%

上投摩根现金管理货币市场基金

2014 第四季度 报告

2014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：二〇一五年一月二十一日

1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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，也不保证基金份额持有人不受本金损失。投资者有风险，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。

本报告自2014年10月1日起至12月31日止。

1.1 基金产品概况

基金名称	上投摩根现金管理货币
基金代码	000685
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月19日
报告期末基金份额总额	1,235,262,485.05份

投资目标

在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的稳定回报。

投资策略

1. 资产配置策略：本基金在保持低风险的前提下，根据宏观经济状况、货币政策、利率水平、市场利率、流动性状况等因素，结合各类资产的估值水平、流动性状况、风险收益特征等进行资产配置，确定各类资产的配置比例，并适时进行动态调整。

2. 债券投资策略：本基金管理人认为，债券市场在整体流动性宽松的环境下，利率水平将保持平稳，债券收益率将保持较低水平。本基金管理人将根据市场利率、债券收益率、流动性状况等因素，结合各类资产的估值水平、流动性状况、风险收益特征等进行资产配置，确定各类资产的配置比例，并适时进行动态调整。

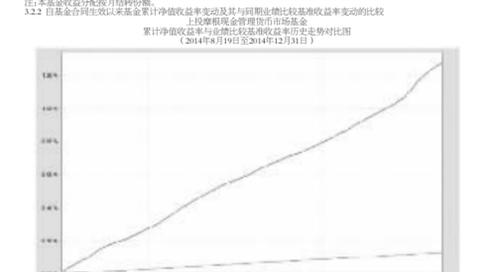
3. 货币市场投资策略：本基金管理人认为，货币市场在整体流动性宽松的环境下，利率水平将保持平稳，货币市场收益率将保持较低水平。本基金管理人将根据市场利率、货币市场收益率、流动性状况等因素，结合各类资产的估值水平、流动性状况、风险收益特征等进行资产配置，确定各类资产的配置比例，并适时进行动态调整。

3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)	
1.本期净利润		1,746,452.50	
2.本期利润		1,746,452.50	
3.期末基金份额净值		1,235,262,485.05	

3.2 基金份额持有人往来收益以基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段	净值增长率	业绩比较基准	①-②	②-③		
过去三个月	0.8758%	0.002%	0.0894%	0.0000%	0.7864%	0.0025%



4.1 基金经理(或基金经理小组)

姓名	职务	任本基金的基金经理日期	任职日期	证券从业年限	说明
王亚明	本基金基金经理	2014-8-19	-	12年	复旦大学金融学硕士，2001年2月至2007年7月任职于中国建设银行总行，任副行长助理。2007年7月加入上投摩根基金管理有限公司，任固定收益部副经理。2008年6月加入上投摩根基金管理有限公司，任2008年11月担任上投摩根现金管理货币市场基金基金经理。自2014年8月19日起担任上投摩根现金管理货币市场基金基金经理。自2014年8月19日起担任上投摩根现金管理货币市场基金基金经理。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	6,440,527.00	9.66
2	固定收益投资	6,440,527.00	9.66
3	银行存款	51,536,193.10	77.27
4	其他资产	51,536,193.10	77.27
5	资产减值准备	-	-
6	应收利息	-	-
7	其他	-	-
8	合计	66,695,152.5	100.00

5.2 基金资产组合情况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	196,900.00	0.41
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,722,663.00	3.51
D	电力、热力、燃气生产和供应业	442,130.00	0.95
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	458,610.00	0.95
G	信息传输、软件和信息技术服务业	426,000.00	0.98
H	金融业	-	-
I	房地产业	-	-
J	租赁和商务服务业	-	-
K	科学研究和技术服务业	-	-
L	水利、环境和公共设施管理业	-	-
M	建筑业	-	-
N	教育、文化和体育业	-	-
O	其他	-	-
P	综合	-	-
S	合计	6,440,527.00	13.28

5.3 报告期末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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601628	中国人寿	27,600	942,540.00	1.94
2	601633	长城汽车	20,000	831,000.00	1.71
3	601377	中国铁建	48,100	727,272.00	1.50
4	600166	民生银行	53,400	580,992.00	1.20
5	600038	中信证券	12,500	470,250.00	0.97
6	601198	中国平安	48,300	442,130.00	0.98
7	600000	浦发银行	40,000	426,400.00	0.88
8	000555	顺丰控股	9,000	146,500.00	0.71
9	600048	保利地产	30,000	124,600.00	0.27
10	600682	南京高科	15,000	237,000.00	0.49

5.4 报告期末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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	30,700	4,154,186.80	8.57
2	110018	民生转债	21,240	2,938,854.80	6.06
3	110018	民生转债	12,010	1,599,551.50	3.26
4	020067	14债07	25,000	2,442,500.00	5.04
5	018002	国开1302	21,530	2,310,160.00	4.76

5.5 报告期末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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	30,700	4,154,186.80	8.57
2	110018	民生转债	21,240	2,938,854.80	6.06
3	110018	民生转债	12,010	1,599,551.50	3.26
4	020067	14债07	25,000	2,442,500.00	5.04
5	018002	国开1302	21,530	2,310,160.00	4.76

5.6 基金份额持有人往来收益以基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段	净值增长率	业绩比较基准	①-②	②-③		
过去三个月	0.8758%	0.002%	0.0894%	0.0000%	0.7864%	0.0025%

5.7 报告期末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

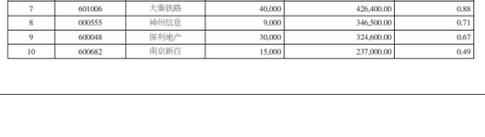
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601628	中国人寿	27,600	942,540.00	1.94
2	601633	长城汽车	20,000	831,000.00	1.71
3	601377	中国铁建	48,100	727,272.00	1.50
4	600166	民生银行	53,400	580,992.00	1.20
5	600038	中信证券	12,500	470,250.00	0.97
6	601198	中国平安	48,300	442,130.00	0.98
7	600000	浦发银行	40,000	426,400.00	0.88
8	000555	顺丰控股	9,000	146,500.00	0.71
9	600048	保利地产	30,000	124,600.00	0.27
10	600682	南京高科	15,000	237,000.00	0.49

5.8 报告期末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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	30,700	4,154,186.80	8.57
2	110018	民生转债	21,240	2,938,854.80	6.06
3	110018	民生转债	12,010	1,599,551.50	3.26
4	020067	14债07	25,000	2,442,500.00	5.04
5	018002	国开1302	21,530	2,310,160.00	4.76

5.9 报告期末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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	30,700	4,154,186.80	8.57
2	110018	民生转债	21,240	2,938,854.80	6.06
3	110018	民生转债	12,010	1,599,551.50	3.26
4	020067	14债07	25,000	2,442,500.00	5.04
5	018002	国开1302	21,530	2,310,160.00	4.76



上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014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：二〇一五年一月二十一日

1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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，也不保证基金份额持有人不受本金损失。投资者有风险，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。

本报告自2014年10月1日起至12月31日止。

1.1 基金产品概况

基金名称	上投摩根天颐年丰混合
基金代码	000125
交易代码	000125
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年7月13日
报告期末基金份额总额	42,555,460.69份

投资目标

在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值，力争为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。

投资策略

1. 资产配置策略：本基金在保持低风险的前提下，根据宏观经济状况、货币政策、利率水平、市场利率、流动性状况等因素，结合各类资产的估值水平、流动性状况、风险收益特征等进行资产配置，确定各类资产的配置比例，并适时进行动态调整。

2. 债券投资策略：本基金管理人认为，债券市场在整体流动性宽松的环境下，利率水平将保持平稳，债券收益率将保持较低水平。本基金管理人将根据市场利率、债券收益率、流动性状况等因素，结合各类资产的估值水平、流动性状况、风险收益特征等进行资产配置，确定各类资产的配置比例，并适时进行动态调整。

3. 货币市场投资策略：本基金管理人认为，货币市场在整体流动性宽松的环境下，利率水平将保持平稳，货币市场收益率将保持较低水平。本基金管理人将根据市场利率、货币市场收益率、流动性状况等因素，结合各类资产的估值水平、流动性状况、风险收益特征等进行资产配置，确定各类资产的配置比例，并适时进行动态调整。

3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)	
1.本期末资产负债率		50.78,308.06	
2.本期利润		4,785,424.00	
3.加权平均基金份额本期利润		0.0931	
4.期末基金份额净值		48,493,627.09	
5.期末基金份额净值增长率		48,493,627.09	

3.2 基金份额