上投摩根阿尔法股票型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3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:二〇一五年四月二十二日

§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。

基金托管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4月21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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根阿尔法股票
基金主代码	377010
交易代码	377010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年10月11日
报告期末基金份额总额	737,509,637.56份
投资目标	本基金采用嘉铃式投资技术(Barbell Approach),同步以"成长"与"价值"双重量化指标进行股票选择。在基于由下而上的择股流程中,精选个股,纪律执行,构造出相对均衡的不同风格类资产组合,同时结合公司质量、行业布局、风险因子等深入分析,对资产配置进行适度调整,努力控制投资组合的市场适应性,以求多空环境中都能创造超越业绩基准的主动管理回报。
投资策略	本基金充分借鉴摩根资产管理集团全球行之有效的投资理念和技术,依据中国资本市场的具体特征,引入集团在海外市场成功运作的"Dynamic Fund"基金产品概念。具体而言,本基金将以量化指标分析为基础,通过严格的证券选择,积极构建并持续优化"哑铃式"资产组合,结合严密的风险监控,不断谋求超越业绩比较基准的稳定回报。
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	本基金是股票型证券投资基金,属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金产品。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	280,904,679.83
2.本期利润	716,902,732.52
3.加权平均基金份额本期利润	1.1038
4.期末基金资产净值	2,510,360,107.40
5.期末基金份额净值	3.4038

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	48.73%	1.86%	11.60%	1.46%	37.13%	0.40%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计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

上投摩根阿尔法股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005年10月11日至2015年3月31日)

注:1. 本基金合同生效日为2005年10月11日,图示时间段为2005年10月11日至2015年3月31日。

2. 本基金建仓期自2005年10月11日至2006年4月10日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3. 本基金自2013年12月7日起,将基金业绩比较基准由"暂时中国A全指×80%+同业存款利率×20%"变更为"沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%"。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
征茂平	本基金基金经理	2014-1-3	2015-2-16-	13年	征茂平先生自2001年3月至2004年3月在上海证大投资管理有限公司任高级研究员从事证券研究的工作;2004年3月至2005年4月在平安证券有限公司任高级研究员从事证券研究的工作;2005年5月至2008年5月在大成基金管理有限公司任研究员从事成长股票组合的管理工作;2008年5月起加入上投摩根基金管理有限公司,担任行业专家兼基金经理助理,自2013年7月起担任上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金基金经理,自2013年9月起同时担任上投摩根红利回报混合型证券投资基金基金经理,2014年1月至2015年2月担任上投摩根阿尔法股票型证券投资基金基金经理。
蔡晟	本基金基金经理	2014-10-23	-	7年	蔡晟先生自2008年7月至2011年3月在华安基金管理有限公司先后担任助理研究员、研究员及高级研究员;2011年5月至2012年7月在国投瑞银基金管理有限公司任高级研究员;2012年8月至2014年8月在平安养老保险股份有限公司担任权益投资经理,自2014年9月起加入上投摩根基金管理有限公司,自2014年10月起担任上投摩根阿尔法股票型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根阿尔法股票型证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根阿尔法股票型证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,通过对交易价格、交易时间、交易方向等的分析,未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形;无。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2014年四季度的大盘股上涨较多,其实质还是补涨的行情,我们坚持认为本轮市场的驱动力是创新发展、核心指数依然是创业板指数,所以去年四季度阿尔法坚持了一定的持仓风格并保持了相对均衡的配置,今年以来取得了较好的效果,即使如此我们也意识到,整体的估值水平上升创造利润的同时也存在风险,过去的一个季度阿尔法逐步降低了互联网券商的配置,增加了互联网银行的配置比例,同时增加物流信息化以及汽车后市场的配置,属于在大互联网领域内的调整,整体组合依然保持稳定。

展望2015年,我们依然认为创新动力没有衰弱而是增强,互联网在2015年会真正地渗透到传统领域中去,同时在改变着各个行业.除去互联网对于传统领域的渗透,我们注意到新兴的医药生物技术的突破,例如新兴的血糖仪技术和生物基因技术不断取得突破,因此阿尔法始终保持在前沿医疗领域的配置。对于未来的展望依然是看好互联网对传统产业的渗透以及取得技术突破的新兴医药生物企业的投资机遇。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为48.73%,同期业绩比较基准收益率为11.60%。

§5投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,328,927,611.16	90.90
	其中:股票	2,328,927,611.16	90.90
2	固定收益投资	124,588,209.80	4.86
	其中:债券	124,588,209.80	4.86
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	82,768,156.56	3.23
7	其他各项资产	25,866,237.82	1.01
8	合计	2,562,150,215.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	25,079,257.44	1.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	928,069,182.63	36.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,488,496.00	0.98
E	建筑业	224,426,648.03	8.94
F	批发和零售业	57,689,547.75	2.30
G	交通运输、仓储和邮政业	81,438,891.58	3.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	724,910,140.05	28.88
J	金融业	-	-
K	房地产业	75,397,215.50	3.00
L	租赁和商务服务业	20,462,869.68	0.82
M	科学研究和技术服务业	61,756,675.20	2.46
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	83,840,361.30	3.34
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	21,368,326.00	0.85
	合计	2,328,927,611.16	92.77

5.3 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	300075	数字政通	3,346,732	208,534,870.92	8.31
2	002081	金螳螂	4,210,443	148,081,280.31	5.90
3	300231	银信科技	4,216,822	122,119,165.12	4.86
4	300140	启源装备	2,193,267	100,034,907.87	3.98
5	300206	理邦仪器	3,021,840	99,932,248.80	3.98
6	600850	华东电脑	1,676,818	96,031,366.86	3.83
7	000902	新洋丰	4,385,487	95,077,358.16	3.79
8	300253	卫宁软件	421,580	68,759,698.00	2.74
9	002077	大港股份	4,639,405	63,559,848.50	2.53
10	002178	延华智能	2,144,329	61,756,675.20	2.46

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	44,830,303.00	1.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	79,284,462.40	3.16
	其中:政策性金融债	79,284,462.40	3.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	473,444.40	0.02
8	其他	-	-
9	合计	124,588,209.80	4.96

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	018001	国开1301	773,960	79,284,462.40	3.16
2	019321	13国债21	381,010	38,215,303.00	1.52
3	019414	14国债14	66,150	6,615,000.00	0.26
4	113008	电气转债	3,410	473,444.40	0.02

5.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的上海三毛企业(集团)股份有限公司(以下简称:上海三毛,股票代码:600689)于2014年12月23日收到中国证券监督管理委员会上海监管局(以下简称:证监局)《行政处罚书》([2014]4号),主要内容为:1. 证监局认定上海三毛存在违法事实:上海三毛的重要控股子公司上海三毛进出口有限公司(以下简称:三进公司)为生外商应收账款逾期,并预计后续还可能有大额应收账款发生逾期,对上海三毛2012年度及以后的经营业绩产生重大影响,属于《证券法》第六十七条所述的重大事件;对于前述重大事件,上海三毛没有及时披露,直至2013年3月23日才予以公告,并直至4月8日才发布因该重大事件导致公司2012年度经营业绩预亏公告;上海三毛的前述行为违反了《证券法》第六十七条关于上市公司应及时按篇重大事件的规定,构成了《证券法》第一百九十三条第一款所述的违法行为,钟家红、蔡伯承为直接负责的主管人员,朱建忠为其他直接责任人员。2. 证监局决:(1)对上海三毛给予警告,并处以30万元罚款;(2)对钟家红、蔡伯承给予警告,并分别处以10万元罚款;(3)对朱建忠给予警告,并处以5万元罚款。

对上述股票投资决策程序的说明:本基金管理人在投资上海三毛前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金选库,由研究员跟踪并分析。上述事件发生后,本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

除上述股票外,本基金投资的其余前九名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,294.90
2	应收证券清算款	2,036,283.16
3	应收股利	-
4	应收利息	1,911,249.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,963,828.05

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票无流通受限情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	675,718,227.88
本报告期基金总申购份额	169,002,336.59
减:本报告期基金总赎回份额	107,210,926.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	737,509,637.56

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1. 中国证监会批准上投摩根阿尔法股票型证券投资基金设立的文件;
2. 《上投摩根阿尔法股票型证券投资基金基金合同》;
3. 《上投摩根阿尔法股票型证券投资基金托管协议》;
4. 《上投摩根开放式基金业务规则》;
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照;
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一五年四月二十二日

上投摩根稳进回报混合型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十二日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月21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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月27日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根稳进回报混合
基金主代码	000887
交易代码	000887
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月27日
报告期末基金份额总额	569,883,169.24份
投资目标	在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定回报。
投资策略	本基金将灵活运用久期策略、期限结构配置策略、信用策略、回购策略、可转债策略等多种投资策略,实施积极主动的组合管理,并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测,对债券组合进行动态调整。本基金将采用"自下而上"的个股精选策略,重点投资于具有良好基本面和较高成长潜力的公司。在具体操作上,本基金将综合运用定量分析与定性分析的手段,对个股投资价值进行深入挖掘。首先,本基金将基于公司财务指标分析公司的基本面价值,选择财务和资产状况良好且盈利能力较强的公司。本基金将每季度检视基金投资组合,通过对业绩表现分析、归因分析、绩效检验报告等评估基金绩效和风险,以便基金经理调整投资决策提高投资业绩。本基金将根据绩效分析和风险分析结果,动态调整组合的资产配置、行业配置、债券类属配置、债券杠杆水平等。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)+1%
风险收益特征	本基金属于混合型基金产品,预期风险和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,属于中等风险收益水平的基金产品。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月27日(基金合同生效日)-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	3,539,280.44
2.本期利润	22,389,920.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0393
4.期末基金资产净值	592,273,089.79
5.期末基金份额净值	1.039

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	3.90%	0.34%	0.67%	0.01%	3.23%	0.33%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计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

上投摩根稳进回报混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年1月27日至2015年3月31日)

注:本基金合同生效日为2015年1月27日,截至报告期末本基金合同生效未满一年。根据基金合同的规定,本基金建仓期自基金合同生效之日起六个月,本基金在本报告期尚处在建仓期内。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯曙光	本基金基金经理	2015-1-27	-	11年	冯曙光先生自2004年8月至2006年3月在南京银行任债券分析师;2006年3月至2009年9月在兴业银行任债券投资经理;2009年9月至2014年5月在中欧基金管理有限公司先后担任研究员、基金经理助理、基金经理、固定收益部总监、固定收益事业部副总经理负责人等职务,自2014年5月起加入上投摩根基金管理有限公司,自2014年8月起担任上投摩根纯债债券型证券投资基金基金经理,自2014年10月起担任上投摩根红利回报混合型证券投资基金基金经理,自2014年11月起同时担任上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.冯曙光先生为本基金首任基金经理,其任职日期指本基金基金合同生效之日。

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根稳进回报混合型证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求,严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动,通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析,以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动,本公司执行集中交易制度,确保不同投资组合在买卖同一证券时,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;对于银行间市场投资活动,本公司通过对手库控制和交易室询价机制,严格防范对手风险并检查价格公允性;对于申购投资行为,本公司遵循价格优先、比例分配的原则,根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内,通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析,未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,通过对交易价格、交易时间、交易方向等的分析,未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形;无。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

一季度宏观经济继续面临向下压力,地产销售延续颓势,物价水平保持低迷,实体经济不振迫使货币政策保持宽松,继去年四季度不对称降息之后,一季度央行进一步引导回购利率下行,并继续实施降准,降息等较宽松的货币政策,受流动性等因素拖动,增量资金不断进入股市,推动股指进一步走高,成长风格再次主导市场,创业板、主板均纷创出多年来新高,新股发行节奏也明显加快,一季度债券市场也出现大幅上涨。本基金在一季度逐步建仓,随着安全垫的增加逐步增加了股票资产投资比例。

展望二季度,经济延续温和回落态势是大概率事件,货币政策仍将维持宽松基调,股票市场基底使得基本面和预期之间的偏离进一步拉大;经济基本面虽然仍支持债市,但较低的利率水平仍是债市的潜在风险。二季度本基金将以追求稳健收益为目标,对高估值品种保持适当谨慎,尽量控制回撤,力争为投资者创造长期稳定的投资回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为3.90%,同期业绩比较基准收益率为0.67%。

§5投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	164,195,042.31	26.34
	其中:股票	164,195,042.31	26.34
2	固定收益投资	70,341,040.50	11.28
	其中:债券	70,341,040.50	11.28
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	112,200,207.30	18.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	272,685,770.33	43.74
7	其他各项资产	3,963,828.05	0.64
8	合计	623,385,888.49	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	102,285,520.11	17.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	868,800.00	0.15
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,075,900.00	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	6,766,400.00	1.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,665,382.20	6.19
J	金融业	1,880,000.00	0.32
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,285,000.00	1.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,640.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,358,400.00	0.74
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	164,195,042.31	27.72

5.3 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	600689	上海三毛	549,851	8,363,233.71	1.41
2	300033	同花顺	60,000	7,260,000.00	1.23
3	002256	彩虹精化	250,000	5,610,000.00	0.95
4	300220	金运激光	130,000	5,526,300.00	0.93
5	300010	立思辰	110,000	5,217,300.00	0.88
6	600037	歌华有线	190,000	5,097,700.00	0.86
7	300140	启源装备	110,000	5,017,100.00	0.85
8	300206	理邦仪器	150,000	4,960,500.00	0.84
9	600138	中青旅	200,000	4,868,000.00	0.82
10	002339	积成电子	200,000	4,690,000.00	0.79

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	35,503,221.20	5.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	19,861,508.30	3.35
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	13,956,431.00	2.36
8	其他	1,019,880.00	0.17
9	合计	70,341,040.50	11.88

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019321	13国债21	279,660	28,049,898.00	4.74
2	127100	15新交投	100,000	9,996,000.00	1.69
3	019407	14国债07	73,270	7,324,069.20	1.24
4	110029	浙能转债	20,000	2,787,800.00	0.47
5	110023	民生转债	20,030	2,749,518.10	0.46

5.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的上海三毛企业(集团)股份有限公司(以下简称:上海三毛,股票代码:600689)于2014年12月23日收到中国证券监督管理委员会上海监管局(以下简称:证监局)《行政处罚书》([2014]4号),主要内容为:1. 证监局认定上海三毛存在违法事实:上海三毛的重要控股子公司上海三毛进出口有限公司(以下简称:三进公司)为生外商应收账款逾期,并预计后续还可能有大额应收账款发生逾期,对上海三毛2012年度及以后的经营业绩产生重大影响,属于《证券法》第六十七条所述的重大事件;对于前述重大事件,上海三毛没有及时披露,直至2013年3月23日才予以公告,并直至4月8日才发布因该重大事件导致公司2012年度经营业绩预亏公告;上海三毛的前述行为违反了《证券法》第六十七条关于上市公司应及时按篇重大事件的规定,构成了《证券法》第一百九十三条第一款所述的违法行为,钟家红、蔡伯承为直接负责的主管人员,朱建忠为其他直接责任人员。2. 证监局决:(1)对上海三毛给予警告,并处以30万元罚款;(2)对钟家红、蔡伯承给予警告,并分别处以10万元罚款;(3)对朱建忠给予警告,并处以5万元罚款。

对上述股票投资决策程序的说明:本基金管理人在投资上海三毛前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金选库,由研究员跟踪并分析。上述事件发生后,本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

除上述股票外,本基金投资的其余前九名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,294.90
2	应收证券清算款	2,036,283.16
3	应收股利	-
4	应收利息	1,911,249.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,963,828.05

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票无流通受限情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	569,883,169.24
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	569,883,169.24

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1. 中国证监会批准上投摩根进回报混合型证券投资基金设立的文件;
2. 《上投摩根进回报混合型证券投资基金基金合同》;
3. 《上投摩根进回报混合型证券投资基金基金托管协议》;
4. 《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照;
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一五年四月二十二日

上投摩根天添盈货币市场基金

2015 第一季度 报告

2015年3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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十二日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月21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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根天添盈货币		
基金主代码	000855		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年11月25日		
报告期末基金份额总额	145,213,528.37份		
投资目标	在有效控制投资风险和保持较高流动性的前提下,为投资者提供资金的流动性储备,进一步优化现金管理,并力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。		
投资策略	本基金将综合考虑各类可投资品种的收益性、流动性及风险性特征,对各类资产进行合理的配置和选择。在保证基金资产的安全性和流动性基础上,力争为投资者创造稳定的投资收益。本基金以短期金融工具作为投资对象,基于对各细分市场的市场规模、交易情况、各交易