

上投摩根行业轮动股票型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

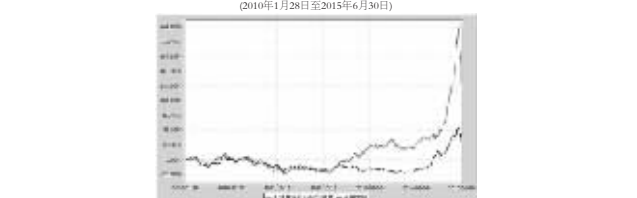
基金管理人：上投摩根基金管理有限公司
基金管理人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年七月二十日

5.1 重要提示
基金管理人及基金托管人根据法律法规的规定，对基金资产的投资行为进行监督和检查，并保证基金资产的安全、完整和真实性。基金管理人及基金托管人根据法律法规的规定，对基金资产的投资行为进行监督和检查，并保证基金资产的安全、完整和真实性。基金管理人及基金托管人根据法律法规的规定，对基金资产的投资行为进行监督和检查，并保证基金资产的安全、完整和真实性。

5.2 基金产品概况
基金名称：上投摩根行业轮动股票基金
基金代码：377350
交易币种：人民币
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2010年11月28日
基金管理人：上投摩根基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
3.1.1 本报告期末基金份额净值表现
3.1.2 本报告期末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
3.1.3 本报告期末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

3.2 基金业绩比较基准
3.2.1 本报告期末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
3.2.2 本报告期末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



注：本基金合同自2010年11月28日至2010年7月27日适用业绩比较基准为上证综指+10%。本基金合同自2010年7月27日至2015年6月30日适用业绩比较基准为上证综指+10%。

4.1 基金经理
姓名：孙芳
职务：基金经理
任职日期：2012-11-29
证券从业年限：12年

4.2 基金经理
孙芳，毕业于中国人民大学经济学院，2003年7月至2006年10月担任摩根大通银行资产管理部高级分析师，自2006年12月起加入上投摩根基金管理有限公司，担任基金经理助理。2012年11月29日起担任上投摩根行业轮动股票型证券投资基金基金经理。2014年12月19日起担任上投摩根行业轮动股票型证券投资基金基金经理。

4.3 基金投资策略
本基金采取自上而下的投资策略，在宏观和微观两个层面进行分析和判断。在宏观层面，本基金通过对宏观经济、政策、市场、行业、个股等方面的分析，把握市场运行的主要矛盾和趋势。在微观层面，本基金通过对个股的基本面、估值、技术等方面的分析，把握个股的投资机会。本基金采取分散投资，严格控制个股仓位，追求基金资产的长期增值。

4.4 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为：上证综指+10%。
本基金合同自2010年11月28日至2010年7月27日适用业绩比较基准为上证综指+10%。本基金合同自2010年7月27日至2015年6月30日适用业绩比较基准为上证综指+10%。

4.5 基金费用
基金管理人运用基金财产投资于证券市场，基金管理人应当按照法律法规的规定，履行信息披露义务。基金管理人应当按照法律法规的规定，履行信息披露义务。基金管理人应当按照法律法规的规定，履行信息披露义务。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	银行存款	3,106,422,304.60	89.28
2	应收利息	3,106,422,304.60	89.28
3	应收股利	1,468,356,779.17	21.78
4	其他应收款	1,468,356,779.17	21.78
5	其他资产	139,857,601.70	4.18
6	应付利息	-	-
7	应付股利	-	-
8	其他负债	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,443,006,396.14	100.00

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.2 报告期末基金资产组合情况

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	66,479,369.50	2.08
B	采矿业	3,725,232.00	0.12
C	制造业	1,344,577,209.81	38.01
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	56,422,292.30	1.77
E	建筑业	106,958,515.35	3.24
F	交通运输、仓储和邮政业	186,443,411.66	5.82
G	信息、软件和信息技术服务业	21,374,645.36	0.67
H	批发和零售业	15,137,960.25	0.47
I	金融业	992,643,432.52	31.04
J	房地产业	4,130,070.00	0.13
K	其他行业	129,147,368.45	4.04
L	债券回购	-	-
M	买入返售金融资产	40,596,383.14	1.27
N	其他	-	-
O	应收利息	-	-
P	应收股利	-	-
Q	其他	-	-
R	其他	-	-
S	合计	3,006,942,366.66	94.01

5.2 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
5.2.1 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
5.2.2 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	600773	恒信股份	1,961,130	207,613,543.20	6.49
2	300175	数字中国	4,686,470	153,340,540.00	4.79
3	300166	东方国信	2,992,190	107,479,664.00	3.36
4	002405	华信国际	2,172,477	98,154,492.60	3.07
5	300140	劲旅装备	2,093,104	83,263,518.00	2.60
6	002462	嘉事堂	1,516,687	80,630,079.70	2.52
7	002042	鸿达兴业	2,441,838	73,666,414.00	2.30
8	300347	碧松生物	2,163,107	71,758,019.84	2.24
9	002198	三药齐升	71,179,521.00	224	
10	601129	永鼎股份	2,365,313	69,827,819.96	2.18

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债券投资明细
5.3.1 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
5.3.2 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	019001	国开1901	666,319	68,276,785.70	2.13
2	159005	15国债05	500,000	49,540,000.00	1.53
3	140223	14国债23	100,000	10,040,000.00	0.31
4	019418	14国债18	100,000	10,024,000.00	0.31
5	110031	央行票据	13,600	1,976,216.00	0.06

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五名资产支持证券投资明细
5.4.1 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资产支持证券投资明细
5.4.2 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资产支持证券投资明细

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股指期货投资明细
5.5.1 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股指期货投资明细
5.5.2 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股指期货投资明细

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五名权证投资明细
5.6.1 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
5.6.2 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

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
5.7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
5.7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.8 基金资产净值
5.8.1 基金资产净值
5.8.2 基金资产净值

5.9 基金费用
5.9.1 基金费用
5.9.2 基金费用

5.10 基金业绩
5.10.1 基金业绩
5.10.2 基金业绩

5.11 基金风险
5.11.1 基金风险
5.11.2 基金风险

5.12 基金其他
5.12.1 基金其他
5.12.2 基金其他

5.13 基金其他
5.13.1 基金其他
5.13.2 基金其他

5.14 基金其他
5.14.1 基金其他
5.14.2 基金其他

5.15 基金其他
5.15.1 基金其他
5.15.2 基金其他

5.16 基金其他
5.16.1 基金其他
5.16.2 基金其他

5.17 基金其他
5.17.1 基金其他
5.17.2 基金其他

5.18 基金其他
5.18.1 基金其他
5.18.2 基金其他

5.19 基金其他
5.19.1 基金其他
5.19.2 基金其他

5.20 基金其他
5.20.1 基金其他
5.20.2 基金其他

5.21 基金其他
5.21.1 基金其他
5.21.2 基金其他

5.22 基金其他
5.22.1 基金其他
5.22.2 基金其他

5.23 基金其他
5.23.1 基金其他
5.23.2 基金其他

5.24 基金其他
5.24.1 基金其他
5.24.2 基金其他

5.25 基金其他
5.25.1 基金其他
5.25.2 基金其他

5.26 基金其他
5.26.1 基金其他
5.26.2 基金其他

5.27 基金其他
5.27.1 基金其他
5.27.2 基金其他

5.28 基金其他
5.28.1 基金其他
5.28.2 基金其他

5.29 基金其他
5.29.1 基金其他
5.29.2 基金其他

5.30 基金其他
5.30.1 基金其他
5.30.2 基金其他

5.31 基金其他
5.31.1 基金其他
5.31.2 基金其他

5.32 基金其他
5.32.1 基金其他
5.32.2 基金其他

5.33 基金其他
5.33.1 基金其他
5.33.2 基金其他

5.34 基金其他
5.34.1 基金其他
5.34.2 基金其他

5.35 基金其他
5.35.1 基金其他
5.35.2 基金其他

5.36 基金其他
5.36.1 基金其他
5.36.2 基金其他

5.37 基金其他
5.37.1 基金其他
5.37.2 基金其他

5.38 基金其他
5.38.1 基金其他
5.38.2 基金其他

5.39 基金其他
5.39.1 基金其他
5.39.2 基金其他

5.40 基金其他
5.40.1 基金其他
5.40.2 基金其他

5.41 基金其他
5.41.1 基金其他
5.41.2 基金其他

5.42 基金其他
5.42.1 基金其他
5.42.2 基金其他

5.43 基金其他
5.43.1 基金其他
5.43.2 基金其他

5.44 基金其他
5.44.1 基金其他
5.44.2 基金其他

5.45 基金其他
5.45.1 基金其他
5.45.2 基金其他

5.46 基金其他
5.46.1 基金其他
5.46.2 基金其他

5.47 基金其他
5.47.1 基金其他
5.47.2 基金其他

5.48 基金其他
5.48.1 基金其他
5.48.2 基金其他

5.49 基金其他
5.49.1 基金其他
5.49.2 基金其他

5.50 基金其他
5.50.1 基金其他
5.50.2 基金其他

5.51 基金其他
5.51.1 基金其他
5.51.2 基金其他

5.52 基金其他
5.52.1 基金其他
5.52.2 基金其他

5.53 基金其他
5.53.1 基金其他
5.53.2 基金其他

5.54 基金其他
5.54.1 基金其他
5.54.2 基金其他

5.55 基金其他
5.55.1 基金其他
5.55.2 基金其他

5.56 基金其他
5.56.1 基金其他
5.56.2 基金其他

5.57 基金其他
5.57.1 基金其他
5.57.2 基金其他

5.58 基金其他
5.58.1 基金其他
5.58.2 基金其他

5.59 基金其他
5.59.1 基金其他
5.59.2 基金其他

5.60 基金其他
5.60.1 基金其他
5.60.2 基金其他

5.61 基金其他
5.61.1 基金其他
5.61.2 基金其他

5.62 基金其他
5.62.1 基金其他
5.62.2 基金其他

5.63 基金其他
5.63.1 基金其他
5.63.2 基金其他

5.64 基金其他
5.64.1 基金其他
5.64.2 基金其他

5.65 基金其他
5.65.1 基金其他
5.65.2 基金其他

5.66 基金其他
5.66.1 基金其他
5.66.2 基金其他

5.67 基金其他
5.67.1 基金其他
5.67.2 基金其他

5.68 基金其他
5.68.1 基金其他
5.68.2 基金其他

5.69 基金其他
5.69.1 基金其他
5.69.2 基金其他

5.70 基金其他
5.70.1 基金其他
5.70.2 基金其他

5.71 基金其他
5.71.1 基金其他
5.71.2 基金其他

5.72 基金其他
5.72.1 基金其他
5.72.2 基金其他

5.73 基金其他
5.73.1 基金其他
5.73.2 基金其他

5.74 基金其他
5.74.1 基金其他
5.74.2 基金其他

5.75 基金其他
5.75.1 基金其他
5.75.2 基金其他

5.76 基金其他
5.76.1 基金其他
5.76.2 基金其他

5.77 基金其他
5.77.1 基金其他
5.77.2 基金其他

5.78 基金其他
5.78.1 基金其他
5.78.2 基金其他

5.79 基金其他
5.79.1 基金其他
5.79.2 基金其他

5.80 基金其他
5.80.1 基金其他
5.80.2 基金其他

5.81 基金其他
5.81.1 基金其他
5.81.2 基金其他

5.82 基金其他
5.82.1 基金其他
5.82.2 基金其他

5.83 基金其他
5.83.1 基金其他
5.83.2 基金其他

5.84 基金其他
5.84.1 基金其他
5.84.2 基金其他

5.85 基金其他
5.85.1 基金其他
5.85.2 基金其他

5.86 基金其他
5.86.1 基金其他
5.86.2 基金其他

5.87 基金其他
5.87.1 基金其他
5.87.2 基金其他

5.88 基金其他
5.88.1 基金其他
5.88.2 基金其他

5.89 基金其他
5.89.1 基金其他
5.89.2 基金其他

5.90 基金其他
5.90.1 基金其他
5.90.2 基金其他

5.91 基金其他
5.91.1 基金其他
5.91.2 基金其他

5.92 基金其他
5.92.1 基金其他
5.92.2 基金其他

5.93 基金其他
5.93.1 基金其他
5.93.2 基金其他

5.94 基金其他
5.94.1 基金其他
5.94.2 基金其他

5.95 基金其他
5.95.1 基金其他
5.95.2 基金其他

5.96 基金其他
5.96.1 基金其他
5.96.2 基金其他

5.97 基金其他
5.97.1 基金其他
5.97.2 基金其他

5.98 基金其他
5.98.1 基金其他
5.98.2 基金其他

5.99 基金其他
5.99.1 基金其他
5.99.2 基金其他

5.100 基金其他
5.100.1 基金其他
5.100.2 基金其他

5.101 基金其他
5.101.1 基金其他
5.101.2 基金其他

5.102 基金其他
5.102.1 基金其他
5.102.2 基金其他

5.103 基金其他
5.103.1 基金其他
5.103.2 基金其他

5.104 基金其他
5.104.1 基金其他
5.104.2 基金其他

5.105 基金其他
5.105.1 基金其他
5.105.2 基金其他

5.106 基金其他
5.106.1 基金