上投摩根卓越制造股票型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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:二〇一五年十月二十六日

§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10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根卓越制造股票
基金主代码	001126
交易代码	001126
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月14日
报告期末基金份额总额	2,937,459,592.01份
投资目标	通过系统和深入的基本面研究,重点投资于制造业中具有竞争力的优质上市公司,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过系统和深入的基本面研究,重点投资于制造业中具有竞争力的优质上市公司,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产长期稳定增值。本基金将不低于80%的非现金基金资产投资于国家鼓励制造相关行业。 在行业配置层面,本基金将从行业生命周期、行业景气度、行业竞争格局等多角度,综合评估各个行业的投资价值,对基金资产在行业间分配进行安排。 在个股选择层面,本基金将主要采用"自下而上"的方法,在备选行业内部通过定量与定性相结合的分析方法,综合分析上市公司的业绩质量、成长性和估值水平等各方面信息,精选具有良好成长性、估值合理的个股。
业绩比较基准	申万制造业指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%
风险收益特征	本基金属于股票型基金产品,预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于较高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	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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-942,152,667.46
2.本期利润	-886,691,864.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3004
4.期末基金资产净值	1,840,870,066.87
5.期末基金份额净值	0.627

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。

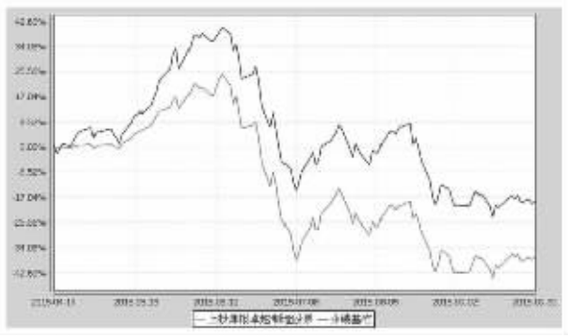
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-31.33%	4.56%	-26.40%	3.51%	-4.93%	1.05%

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
上投摩根卓越制造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
(2015年4月14日至2015年9月30日)



注:本基金合同生效日为2015年4月14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		
吴文哲	本基金基金经理、研究总监	2015-04-14	-	10年	吴文哲先生,自2001年7月至2002年7月在招商银行上海分行担任职员,2004年6月至2007年7月在华宝兴业基金管理有限公司担任研究员,2007年7月至2014年1月在交银施罗德基金管理有限公司担任高级研究员,自2014年1月起加入上投摩根基金管理有限公司,担任研究部副总监兼高级行业专家一职,自2015年1月起担任上投摩根成长先锋混合型证券投资基金基金经理,自2015年4月起同时担任上投摩根卓越制造股票型证券投资基金基金经理。
许俊哲	本基金基金经理	2015-04-14	-	5年	许俊哲先生,复旦大学经济学硕士,CPA(中国注册会计师)。2010年7月加入上投摩根基金管理有限公司,曾先后担任研究员、行业专家,负责行业研究等相关工作。自2014年1月起担任基金经理助理,协助基金经理进行产品的模拟投资组合等工作,自2015年4月起担任上投摩根卓越制造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.吴文哲先、许俊哲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、《上投摩根卓越制造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

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

三季度,中国资本市场经历了罕见的大幅调整:沪深300指数三季度下跌28%,较年内最高点下跌40%;创业板指数三季度下跌27%,较年内最高点下跌48%;市场上超过一半以上的个股较年内高点下跌超过50%。本基金在三季度继续维持了较高的仓位,造成净值回撤幅度较大。

虽然经历了大幅调整,但是,我们仍然坚定看好本届政府继续深化各项改革的决心,这是资本市场持续发展的基石。当然,改革的推进必然会遇到各种阻力,出现各种波折,这是可以理解的。展望四季度,经过本轮深幅调整后,已经有不少优秀上市公司的股价进入到价值投资的区间,我们会通过持续的研究和跟踪,抱着长期持有的心态,逐步买入这类公司。我们认为:中国经济要破茧而出,终究还是通过新兴产业,因此,本基金会继续围绕契约构建投资组合,从高端制造、军工、新能源、先进电子、医药等新兴产业中精选个股,争取为投资者获取良好的回报。

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-31.33%,同期业绩比较基准收益率为-26.40%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	1,676,329,367.10	89.37
	其中:股票	1,676,329,367.10	89.37
2	固定收益投资	85,723,908.40	4.57
	其中:债券	85,723,908.40	4.57
	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	102,219,025.71	5.45
7	其他各项资产	11,399,752.26	0.61
8	合计	1,875,672,053.47	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	93,719,413.02	5.09
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,197,614,618.85	65.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	73,611,832.80	4.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	74,627,147.28	4.05
G	交通运输、仓储和邮政业	32,975,750.36	1.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	123,954,577.51	6.73
J	金融业	-	-
K	房地产业	67,654,216.56	3.68
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,171,810.72	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,676,329,367.10	91.06

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	300145	南方泵业	2,283,023	78,832,784.19	4.28
2	002462	嘉事堂	2,034,546	74,627,147.28	4.05
3	000958	东方能源	2,788,327	73,611,832.80	4.00
4	002236	大华股份	2,153,486	72,809,361.66	3.96
5	000902	新洋丰	3,124,412	69,518,167.00	3.78
6	600240	华业资本	6,358,479	67,654,216.56	3.68
7	002470	金正大	3,650,786	64,947,482.94	3.53
8	300171	东富龙	2,279,602	46,025,164.38	2.50
9	002444	巨星科技	3,097,607	40,454,747.42	2.20
10	600562	国睿科技	929,629	38,867,788.49	2.11

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	21,864,024.00	1.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	63,859,884.40	3.47
	其中:政策性金融债	63,859,884.40	3.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	85,723,908.40	4.66

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	632,840	63,859,884.40	3.47
2	019321	13国债21	218,400	21,864,024.00	1.19

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报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在本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	2,211,071.96
2	应收证券清算款	5,005,470.77
3	应收股利	-
4	应收利息	3,530,423.18
5	应收申购款	652,786.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,399,752.26

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存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300145	南方泵业	78,832,784.19	4.28	筹划重大事项

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

本报告期期初基金份额总额	3,058,952,511.93
本报告期基金总申购份额	605,134,121.96
减:本报告期基金总赎回份额	726,627,041.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,937,459,592.01

§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卓越制造股票型证券投资基金设立的文件;
2. 《上投摩根上投摩根卓越制造股票型证券投资基金基金合同》;
3. 《上投摩根上投摩根卓越制造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和营业执照。
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
二〇一五年十月二十六日

上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根整合驱动混合
基金主代码	001192
交易代码	001192
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月23日
报告期末基金份额总额	2,881,970,960.34份
投资目标	通过深入细致的基本面研究,把握企业整合发展带来的投资机会,在严格的风险控制前提下,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法,在股票、债券和现金等资产类别之间进行相对灵活的配置。 本基金将重点投资于整合主题相关的上市公司。在个股选择层面,首先将根据本基金对于整合主题的界定构建初选投票池,在此基础上剔除不具有投资价值的股票建立备选股票池,本基金将深入分析公司的并购重组行为对未来经营可能产生的影响,综合评估其是否会带来经营业绩的改善,通过对并购重组带来的行业增长及公司协同效应的综合分析,精选未来具有较高成长潜力的公司。
业绩比较基准	中证800指数收益率*60%+中债总指数收益率*40%
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高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于较高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	中国银行股份有限公司

§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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,187,463,201.64
2.本期利润	-1,068,653,582.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3536
4.期末基金资产净值	1,881,145,456.07
5.期末基金份额净值	0.653

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。

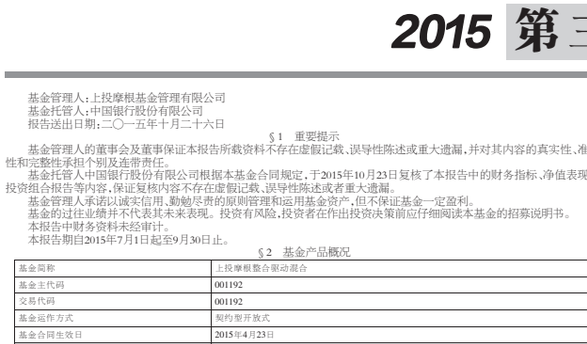
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-32.05%	3.64%	-17.02%	2.05%	-15.03%	1.59%

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
上投摩根整合驱动灵活配置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4月23日至2015年9月30日)



注:本基金合同生效日为2015年4月23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		
征茂平	本基金基金经理	2015-9-18		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混合型证券投资基金基金经理,自2015年9月起同时担任上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
蔡晟	本基金基金经理	2015-04-23	2015-9-25	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月至2015年9月担任上投摩根阿尔法混合型证券投资基金基金经理,自2015年4月至2015年9月同时担任上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2015年7月至2015年9月同时担任上投摩根科技前沿灵活配置混合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.蔡晟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、《上投摩根整合驱动灵活配置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

六月份政府坚定清理场外配资,以及改革进度低于预期导致市场风险偏好发生较大下降,A 股也出现了巨大的调整:上证综指、沪深300、创业板指数分别下跌28.63%、28.39%、27.14%,调整幅度远超市场预期;大部分成长股下跌超过70%,并且断崖式无量下跌导致流动性枯竭,卖出非常困难。最终,三季度A股投资者损失惨重。

本基金在三季度初以成长股为主,重点配置了具有整合驱动特征的中小市值成长股。成长股在三季度下跌非常惨烈,本基金虽然在市场进入调整期后,进行了减仓操作,但依然遭受了不小的损失。

目前中国经济正处在转型期,经济下行压力较大,四季度政府将继续推出一系列稳经济的政策。经济继续低位徘徊,寻求企稳的概率较大;经过前期大幅下跌后,部分个股已经进入了价值投资区间,部分优质成长股在大幅下跌后也具有了一定投资价值,市场在四季度存在超跌反弹的可能性,但由于风险偏好的恢复需要一定时间,因此反弹的空间有限。本基金判断四季度A股市场将处于震荡个股,自下而上精选个股将重新成为市场主流。除非政治改革等重大事件导致风险偏好再度大幅提升,市场才可能出现较大级别的反弹或者反转。

操作上,本基金四季度将以获取绝对收益的策略应对市场的震荡整理,本基金判断四季度市场出现较大机会的可能性不大,因此将维持中等偏下的仓位,寻求确定性较高的投资机会,主要关注方向是以下板块中符合基金契约的具有整合驱动特征的个股:计算机、传媒、新能源汽车、高端装备、环保,以及部分超跌的行业。

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-32.05%,同期业绩比较基准收益率为-17.02%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	794,268,246.94	41.51
	其中:股票	794,268,246.94	41.51
2	固定收益投资	98,247,338.80	5.13
	其中:债券	98,247,338.80	5.13
	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	1,015,634,286.09	53.08
7	其他各项资产	5,169,780.37	0.27
8	合计	1,913,319,652.20	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	597,420,083.77	31.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	49,439.46	0.00
F	批发和零售业	14,431,308.96	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	3,782,037.60	0.20
H	住宿和餐饮业	664.34	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,775,091.49	5.78
J	金融业	-	-
K	房地产业	34,357,386.32	1.83
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,305,877.40	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	21,146,357.60	1.12
S	综合	-	-
	合计	794,268,246.94	42.22

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	002329	皇氏集团	7,298,933.00	93,134,385.08	4.95
2	300222	科大智能	5,355,216.00	79,632,061.92	4.23
3	601388	怡球资源	3,977,364.00	62,166,199.32	3.30
4	603766	隆鑫通用	3,575,938.00	56,642,857.92	3.01
5	603678	火炬电子	765,300.00	56,494,446.00	3.00
6	600446	金证股份	1,997,913.00	50,766,969.33	2.70
7	300075	数字政通	1,722,903.00	40,402,075.35	2.15
8	300026	红日药业	2,165,677.00	35,343,848.64	1.88
9	002077	大港股份	3,139,528.00	34,346,436.32	1.83
10	000782	美达股份	2,728,462.00	34,078,490.38	1.81

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	33,497,862.00	1.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	64,749,476.80	3.44
	其中:政策性金融债	64,749,476.80	3.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	98,247,338.80	5.22

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	344,480	34,761,476.80	1.85
2	019509	15国债09	334,310	33,497,862.00	1.78
3	150413	15农发13	300,000	29,988,000.00	1.59

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报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查或在本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	2,525,970.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,339,886.65
5	应收申购款	303,923.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,169,780.37

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存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002077	大港股份	34,346,436.32	1.83	筹划重大事项
2	300222	科大智能	79,632,061.92	4.23	筹划重大事项
3	601388	怡球资源	62,166,199.32	3.30	筹划重大事项
4	000782	美达股份	34,078,490.38	1.81	筹划重大事项
5	600446	金证股份	50,766,969.33	2.70	筹划重大事项

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

本报告期期初基金份额总额	3,643,740,561.91
本报告期基金总申购份额	384,572,558.03
减:本报告期基金总赎回份额	1,146,342,159.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,881,970,960.34

§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整合驱动灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;
2. 《上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3. 《上投摩根整合驱动灵活配置混合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和营业执照。
8.2存放地点
基金管理人或基金托管人住所。
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
二〇一五年十月二十六日

上投摩根内需动力混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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。

本基金的基金名称自2015年7月21日起由上投摩根内需动力股票型证券投资基金变更为上投摩根内需动力混合型证券投资基金。该变更不涉及基金份额持有人权利义务关系的变化,亦不涉及投资目标、投资范围和投资策略的变更,对本基金的投资及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根内需动力混合
基金主代码	377020
交易代码	377020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年4月13日
报告期末基金份额总额	2,502,314,942.75份
投资目标	本基金重点投资于内需增长背景下具有竞争优势的上市公司,把握中国经济和行业快速增长带来的投资机会,追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	(1)股票投资策略 在投资组合构建和管理的过程中,本基金将采取"自上而下"与"自下而上"相结合的方法。基金管理人在内需驱动行业分析的基础上,选择具有可持续增长前景的优势上市公司股票,以合理价格买入并进行中长期投资。 (2)固定收益类投资策略 本基金以股票投资为主,一般市场情况下,基金管理人不会积极追求大类资产配置,但为进一步控制投资风险,优化组合流动性管理,本基金将适度防御性资产配置,进行债券、货币市场工具等品种投资。 在券种选择上,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。
业绩比较基准	沪深300指数收益