

## 上投摩根阿尔法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:二〇一五年十月二十四日  
**§ 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、误导性陈述或者重大遗漏，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。  
基金托管人国投瑞银基金管理有限公司保证本基金合同合规，于2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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未来表现。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告所载数据截至2015年9月30日由上投摩根阿尔法股息增强型证券投资基金更变更为上投摩根阿尔法混合型证券投资基金。该变更涉及基金份额持有人利益的实质性不利影响。  
本报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)。

## § 2 基金产品概况

## § 3 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 -1,262,629,900.64

## 2.本期利润 -1,552,395,523.39

## 3.期末可供分配基金份额利润 -145,158

## 4.期末基金资产净值 2,447,474,831.81

## 2.5期末

注:本期已实现收益指基金本期已收入,投资收益,其收入(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。  
上述基金业绩报酬不包括个人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购费用,赎回投资费用,基金转换费等),计算费用后实际收益水平要进行调整。

## 5.基金净值表现

## 5.1本报告基金净值增长率与同期行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.2基金净值增长率与同期同行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.3主要财务指标和基金净值表现

## 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 -1,262,629,900.64

## 2.本期利润 -1,552,395,523.39

## 3.期末可供分配基金份额利润 -145,158

## 4.期末基金资产净值 2,447,474,831.81

## 2.5期末

注:本期已实现收益指基金本期已收入,投资收益,其收入(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。  
上述基金业绩报酬不包括个人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购费用,赎回投资费用,基金转换费等),计算费用后实际收益水平要进行调整。

## 5.基金净值表现

## 5.1本报告基金净值增长率与同期行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.2基金净值增长率与同期同行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.3主要财务指标和基金净值表现

## 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 -1,262,629,900.64

## 2.本期利润 -1,552,395,523.39

## 3.期末可供分配基金份额利润 -145,158

## 4.期末基金资产净值 2,447,474,831.81

## 2.5期末

注:本期已实现收益指基金本期已收入,投资收益,其收入(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。  
上述基金业绩报酬不包括个人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购费用,赎回投资费用,基金转换费等),计算费用后实际收益水平要进行调整。

## 5.基金净值表现

## 5.1本报告基金净值增长率与同期行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.2基金净值增长率与同期同行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.3主要财务指标和基金净值表现

## 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 -1,262,629,900.64

## 2.本期利润 -1,552,395,523.39

## 3.期末可供分配基金份额利润 -145,158

## 4.期末基金资产净值 2,447,474,831.81

## 2.5期末

注:本期已实现收益指基金本期已收入,投资收益,其收入(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。  
上述基金业绩报酬不包括个人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购费用,赎回投资费用,基金转换费等),计算费用后实际收益水平要进行调整。

## 5.基金净值表现

## 5.1本报告基金净值增长率与同期行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.2基金净值增长率与同期同行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.3主要财务指标和基金净值表现

## 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 -1,262,629,900.64

## 2.本期利润 -1,552,395,523.39

## 3.期末可供分配基金份额利润 -145,158

## 4.期末基金资产净值 2,447,474,831.81

## 2.5期末

注:本期已实现收益指基金本期已收入,投资收益,其收入(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。  
上述基金业绩报酬不包括个人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购费用,赎回投资费用,基金转换费等),计算费用后实际收益水平要进行调整。

## 5.基金净值表现

## 5.1本报告基金净值增长率与同期行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.2基金净值增长率与同期同行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.3主要财务指标和基金净值表现

## 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 -1,262,629,900.64

## 2.本期利润 -1,552,395,523.39

## 3.期末可供分配基金份额利润 -145,158

## 4.期末基金资产净值 2,447,474,831.81

## 2.5期末

注:本期已实现收益指基金本期已收入,投资收益,其收入(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。  
上述基金业绩报酬不包括个人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购费用,赎回投资费用,基金转换费等),计算费用后实际收益水平要进行调整。

## 5.基金净值表现

## 5.1本报告基金净值增长率与同期行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.2基金净值增长率与同期同行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.3主要财务指标和基金净值表现

## 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 -1,262,629,900.64

## 2.本期利润 -1,552,395,523.39

## 3.期末可供分配基金份额利润 -145,158

## 4.期末基金资产净值 2,447,474,831.81

## 2.5期末

注:本期已实现收益指基金本期已收入,投资收益,其收入(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。  
上述基金业绩报酬不包括个人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购费用,赎回投资费用,基金转换费等),计算费用后实际收益水平要进行调整。

## 5.基金净值表现

## 5.1本报告基金净值增长率与同期行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.2基金净值增长率与同期同行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.3主要财务指标和基金净值表现

## 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 -1,262,629,900.64

## 2.本期利润 -1,552,395,523.39

## 3.期末可供分配基金份额利润 -145,158

## 4.期末基金资产净值 2,447,474,831.81

## 2.5期末

注:本期已实现收益指基金本期已收入,投资收益,其收入(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。  
上述基金业绩报酬不包括个人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购费用,赎回投资费用,基金转换费等),计算费用后实际收益水平要进行调整。

## 5.基金净值表现

## 5.1本报告基金净值增长率与同期行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.2基金净值增长率与同期同行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.3主要财务指标和基金净值表现

## 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 -1,262,629,900.64

## 2.本期利润 -1,552,395,523.39

## 3.期末可供分配基金份额利润 -145,158

## 4.期末基金资产净值 2,447,474,831.81

## 2.5期末

注:本期已实现收益指基金本期已收入,投资收益,其收入(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。  
上述基金业绩报酬不包括个人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购费用,赎回投资费用,基金转换费等),计算费用后实际收益水平要进行调整。

## 5.基金净值表现

## 5.1本报告基金净值增长率与同期行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.2基金净值增长率与同期同行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.3主要财务指标和基金净值表现

## 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 -1,262,629,900.64

## 2.本期利润 -1,552,395,523.39

## 3.期末可供分配基金份额利润 -145,158

## 4.期末基金资产净值 2,447,474,831.81

## 2.5期末

注:本期已实现收益指基金本期已收入,投资收益,其收入(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。  
上述基金业绩报酬不包括个人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购费用,赎回投资费用,基金转换费等),计算费用后实际收益水平要进行调整。

## 5.基金净值表现

## 5.1本报告基金净值增长率与同期行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.2基金净值增长率与同期同行业业绩比较基准收益率的比值

## 5.3主要财务指标和基金净值表现

## 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 -1,262,629,900.64

## 2.本期利润 -1,552,395,523.39

## 3.期末可供分配基金份额利润 -145,158

## 4.期末基金资产净值 2,447,474,831.81

## 2.5期末

## 注:本期已实现收益指基金本期已收入,投资收益,其收入(不含公允价值变动收益扣除相关