

上投摩根行业轮动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：招商银行股份有限公司

报告期截止日：二〇一五年九月三十一日

\$1 重要提示

基金管理人的董事及高级管理人员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，并对本内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和基金管理公司根据本基金合同约定，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数据，保证复核后的情况与本基金管理人所提供的情况一致。

基金管理人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金的基金名称为“2015年7月21日起由上投摩根行业轮动股票型证券投资基金更名为上投摩根行业轮动混合型证券投资基金”。该变更不涉及基金份额持有人的任何利益关系的变化，亦不涉及投资目标、投资范围和投资策略的变更，对本基金的投资运作无实质性影响。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

\$2 基金产品概况

基金简称 上投摩根行业轮动混合

基金代码 377530

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2010年7月21日

报告期末基金份额总额 1,090,191,102.93份

本基金通过资产轮动策略，产业策略与经济周期相关的规律，挖掘经济周期中强势行业，从而实现基金资产长期稳健的回报预期。

投资目标 本基金通过资产轮动策略，产业策略与经济周期相关的规律，挖掘经济周期中强势行业，从而实现基金资产长期稳健的回报预期。

投资策略 本基金通过资产轮动策略，产业策略与经济周期相关的规律，挖掘经济周期中强势行业，从而实现基金资产长期稳健的回报预期。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×80%+上证国债收益率×20%

风险收益特征 本基金主要投资于股票型证券投资基金，属于风险较高的品种，预期风险收益水平高于股票型基金，低于债券型基金。

基金管理人 上投摩根基金管理有限公司

基金托管人 招商银行股份有限公司

\$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 -280,764,718.40

2.本期利润 -914,329,383.99

3.加权平均基金份额本期利润 -0.7699

4.期末基金资产净值 1,833,199,249.53

5.期末基金份额净值 1.082

注：本期利润为截至报告期末基金资产净值相对于年初变动增长百分比，即1.082-1=0.082=8.2%。

注：本报告期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，本期利润为当期收入减去损失后的金额。

注：上投摩根行业轮动股票型证券投资基金的各项费用（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）从投资人申购后至对应收益水平到账时列于下列表格。

3.2.1 本期报告期基金资产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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -29.30% 4.30% -22.45% 2.67% -6.85% 1.63%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图

2010年1月28日至2015年9月30日

注：本基金合同自2010年1月28日至2010年7月31日，建仓期结束后将定期公布符合本基金基金合同规定。

本基金合同生效日为2010年1月28日，报告期间为2010年1月28日至2015年9月30日。

\$4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理助理)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

孙芳 本基金基金经理及基金经理助理 2014-12-19 - 12年

注：1.任职日期和离任日期均指根据公司决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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.担任本基金基金经理的人员在本公司及旗下所有基金中持有份额的持有人利益优先的原则。

4.本基金基金经理在本公司及旗下所有基金的从业时间，指从基金管理人正式聘用之日起至该基金经理管理该基金的总时间。

4.1.1 公公平交易制度的执行情况

本基金基金经理及其他投资决策人员不存在利用内幕信息谋取个人利益的行为。

本基金基金经理及其他投资决策人员不存在利用未公开信息谋取个人利益的行为。

本基金基金经理及其他投资决策人员不存在利用与关联方之间存在业务往来便利化投资安排谋取个人利益的行为。

本基金基金经理及其他投资决策人员不存在利用与公司之间存在关联交易便利化投资安排谋取个人利益的行为。

本基金基金经理及其他投资决策人员不存在利用与公司之间存在关联交易便利化投资安排谋取个人利益的行为。