

上投摩根医疗健康股票型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金管理人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十二日

5.1 重要提示
基金管理人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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年1月21日复核了本报告中财务报告、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。
基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务数据截止日为2015年12月31日。

5.2 基金产品概况

基金名称	上投摩根医疗健康股票
基金代码	901766
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年10月21日
报告期末基金份额总额	302,071,068.75份
投资目标	通过积极主动的管理和科学的风险控制,重点投资于健康产业相关的优质上市公司,分享医疗健康产业发展的长期增长红利。
投资策略	1. 资产配置策略 本基金将结合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素,对宏观经济、国家政策、资金面和估值等因素进行综合考量,制定和调整资产配置方案,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。 2. 股票投资策略 本基金将结合行业基本面、估值、政策等多方面因素,对宏观经济、国家政策、资金面和估值等因素进行综合考量,制定和调整资产配置方案,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。 3. 债券投资策略 本基金将结合宏观经济、政策、市场等多方面因素,对宏观经济、国家政策、资金面和估值等因素进行综合考量,制定和调整资产配置方案,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。 4. 衍生品投资策略 本基金将根据风险管理原则,适度使用股指期货、国债期货等金融衍生品,以对冲投资组合的系统性风险,提高投资效率。
业绩比较基准	中证健康产业指数收益率*90%+中债总财富指数收益率*10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,风险收益特征高于混合型基金、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品种。
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

5.3 主要财务指标和基金净值表现

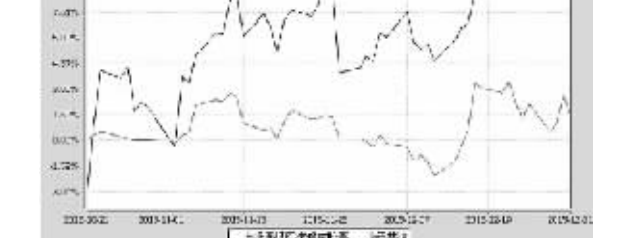
报告期	2015年10月1日至2015年12月31日
1. 本期已实现收益	-5,667,093.39
2. 本期利润	5,098,175.23
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0164
4. 期末基金份额净值	309.853096
5. 期末基金资产净值	1,013,110.23

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,本期利润为本基金本期实现收益加上本期公允价值变动收益。
上述基金净值增长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、证券交易佣金、基金转换费等),计入费用后实现的净值低于所列数字。

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的比较

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益	①-②	②-①		
自基金合同生效以来	1.30%	0.82%	10.16%	1.63%	-8.86%	-0.83%

3.2.2 本基金合同生效以来本基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较
上投摩根医疗健康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10月21日至2015年12月31日)



注:本基金合同生效日为2015年10月21日,截至报告期末本基金合同生效满一年。
根据基金合同的规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。本基金建仓期尚处在建仓期内。

4.1 基金经理简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈飞	基金经理	2015-10-21	-	8年	陈飞先生,自2008年5月至2010年5月负责管理上投摩根智慧互联股票型证券投资基金,自2010年5月至2015年5月担任上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金经理,自2015年5月起担任上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金经理,自2015年10月起,同时担任上投摩根医疗健康股票型证券投资基金基金经理。

5.4 投资组合报告

5.4.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	274,796,148.20	83.63
2	固定收益投资	274,796,148.20	83.63
3	其中:债券	1,800,154.00	0.43
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买入返售金融资产-买断式回购	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	47,794,617.38	14.53
9	其他金融资产	6,601,266.21	1.49
10	合计	328,541,531.97	100.00

5.4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物、酒店	176,049,209.45	53.57
B	制造业	1,706,499.20	0.50
C	通信设备	163,777,905.45	53.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,706,499.20	0.50
E	建筑业	23,538,316.28	7.34
F	交通运输、仓储和邮政业	25,428,785.00	7.82
G	信息、软件和信息技术服务业	5,682,577.38	1.80
H	金融业	1,228,475.50	0.37
I	住宿和餐饮业	7,158,977.60	2.23
J	房地产业	3,180,837.50	1.01
K	综合类	4,043,407.50	1.26
L	其他行业	1,000,000.00	0.30
M	持有待分类金融资产	9,433,267.00	2.96
N	买入返售金融资产	-	-
O	应收利息、应收股利和其他应收款项	6,601,266.21	2.06
P	政府存款	-	-
Q	其他应收款	-	-
R	其他	-	-
S	合计	274,796,148.20	89.82

5.4.3 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	002335	乐视网	1,471,091.00	17,861,210.01	5.82
2	002374	伟明环保	1,585,400.00	12,824,400.00	4.06
3	600275	华信国际	252,100.00	12,569,152.00	4.01
4	600745	华信股份	276,700.00	11,789,346.00	3.75
5	600213	广宇集团	1,106,000.00	10,627,200.00	3.49
6	002462	嘉应股份	79,850.00	9,589,121.00	3.22
7	000705	新嘉科技	510,000.00	9,509,476.00	3.11
8	300668	汇金股份	165,200.00	9,297,157.76	3.04
9	400687	新康医疗	247,900.00	9,086,270.00	2.93
10	300171	东星华	298,500.00	8,949,030.00	2.93

5.4.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债	-	-	-
4	其他政策性金融债	-	-	-
5	企业债	-	-	-
6	中期票据	-	-	-
7	可转债	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	-	-	-

5.4.5 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权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	12094	1209转债	1,238	1,800,154.00	0.48

5.4.6 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
本基金本报告期末持有资产支持证券。
5.4.7 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
本基金本报告期末持有贵金属。
5.4.8 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
本基金本报告期末持有权证。
5.4.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末持有股指期货。
5.4.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末持有国债期货。
5.4.11 投资组合报告附注
5.4.11.1 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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
5.4.11.2 报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。
5.4.11.3 其他资产构成

5.4.11.3 其他资产构成

序号	项目	名称	金额(元)
1	存出保证金	-	212,270.21
2	应收证券清算款	-	4,255,145.40
3	应收利息	-	4,477,302.82
4	应收股利	-	19,682.20
5	应收申购款	-	114,187.21
6	其他应收款	-	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	4,699,088.23

5.4.12 衍生品投资的政策和程序
报告期内,本基金衍生品投资符合《证券投资基金衍生品投资指引》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求,严格执行内上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文件;
4.1.4 衍生品投资的投资决策和授权审批
1. 上投摩根智慧互联股票型证券投资基金管理委员会;
2. 上投摩根基金管理有限公司;
3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金管理办法》;
4. 《开放式证券投资基金业务规则》;
5. 基金管理人业务操作规程-衍生品业务;
6. 基金管理人业务操作规程-衍生品业务。
4.2 衍生品投资的投资决策和授权审批
基金管理人或基金托管人。
4.3 报告方式
投资者可在投资时间免费查询,也可拨打本费用购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一六年一月二十二日

4.1 基金经理或基金经理简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈飞	基金经理	2015-10-21	-	9年	陈飞先生,自2007年5月至2008年4月负责管理上投摩根智慧互联股票型证券投资基金,自2008年4月至2010年5月担任上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金经理,自2010年5月至2015年5月担任上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金经理,自2015年5月起担任上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金经理,自2015年10月起,同时担任上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金经理。

4.2 报告期内基金的业绩表现
本报告期末基金份额净值增长率为30.42%,同期业绩比较基准收益率为16.30%。
报告期内基金份额持有人或基金资产净值情况说明
无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	2,419,572,242.57	88.98
2	固定收益投资	2,419,572,242.57	88.98
3	其中:债券	72,297,616.20	2.66
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买入返售金融资产-买断式回购	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	221,121,602.50	8.13
9	其他金融资产	6,359,661.12	0.23
10	合计	2,719,325,622.39	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物、酒店	1,718,366,157.57	62.86
B	制造业	1,718,366,157.57	62.86
C	通信设备	1,718,366,157.57	62.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,718,366,157.57	62.86
E	建筑业	1,718,366,157.57	62.86
F	交通运输、仓储和邮政业	1,718,366,157.57	62.86
G	信息、软件和信息技术服务业	1,718,366,157.57	62.86
H	金融业	1,718,366,157.57	62.86
I	住宿和餐饮业	1,718,366,157.57	62.86
J	房地产业	1,718,366,157.57	62.86
K	综合类	1,718,366,157.57	62.86
L	其他行业	1,718,366,157.57	62.86
M	持有待分类金融资产	1,718,366,157.57	62.86
N	买入返售金融资产	1,718,366,157.57	62.86
O	应收利息、应收股利和其他应收款项	1,718,366,157.57	62.86
P	政府存款	1,718,366,157.57	62.86
Q	其他应收款	1,718,366,157.57	62.86
R	其他	1,718,366,157.57	62.86
S	合计	2,419,572,242.57	90.91

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	300667	东方雨润	2,355,220.00	164,838,000.00	6.17
2	002046	美尚服饰	1,075,720.00	151,316,220.00	5.61
3	002294	华信国际	4,016,800.00	106,445,200.00	3.93
4	600248	华信股份	1,046,240.00	104,641,280.00	3.90
5	300689	蓝思科技	1,405,270.00	93,266,760.00	3.53
6	600745	华信股份	1,275,740.00	92,717,580.00	3.43
7	600899	华信国际	937,100.00	76,713,130.00	2.83
8	300113	顺络科技	747,130.00	75,717,276.00	2.81
9	000232	普飞通信	957,155.00	72,228,316.00	2.72
10	002292	普飞通信	1,373,266.00	71,011,584.00	2.67

5.4 投资组合报告

5.4.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	155,644,888.47	82.27
2	固定收益投资	155,644,888.47	82.27
3	其中:债券	2,836,226.00	1.56
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买入返售金融资产-买断式回购	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	26,042,621.21	13.78
9	其他金融资产	4,644,275.88	2.45
10	合计	198,978,613.53	100.00

5.4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物、酒店	-	-
B	制造业	-	-
C	通信设备	109,005,332.87	58.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,986,120.00	3.16
F	交通运输、仓储和邮政业	2,210,772.80	1.20
G	信息、软件和信息技术服务业	1,726,270.40	0.93
H	金融业	-	-
I	住宿和餐饮业	-	-
J	房地产业	12,964,968.65	7.01
K	综合类	-	-
L	其他行业	-	-
M	持有待分类金融资产	-	-
N	买入返售金融资产	-	-
O	应收利息、应收股利和其他应收款项	1,310,645.00	0.71
P	政府存款	-	-
Q	其他应收款	-	-
R	其他	-	-
S	合计	155,644,888.47	84.09

5.4.3 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	002046	美尚服饰	90,300.00	12,759,720.00	6.87
2	002046	美尚服饰	90,300.00	12,759,720.00	6.87
3	300330	达意智能	111,500.00	6,495,750.00	3.76
4	002074	华信股份	258,000.00	6,027,500.00	3.45
5	300113	顺络科技	84,200.00	5,251,771.00	2.79
6	002042	普飞通信	124,100.00	5,645,642.20	3.46
7	600899	华信国际	323,800.00	5,429,866.00	3.14
8	600745	华信股份	132,100.00	5,413,480.00	3.03
9	002292	普飞通信	106,400.00	5,403,055.00	3.02
10	300078	顺络科技	108,100.00	5,275,280.00	2.85

5.4.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债	-	-	-
4	其他政策性金融债	-	-	-
5	企业债	-	-	-
6	中期票据	-	-	-
7	可转债	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	-	-	-

5.4.5 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权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019909	19转债	26,300	2,836,226.00	1.83

5.4.6 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
本基金本报告期末持有资产支持证券。
5.4.7 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
本基金本报告期末持有贵金属。
5.4.8 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
本基金本报告期末持有权证。
5.4.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末持有股指期货。
5.4.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末持有国债期货。
5.4.11 投资组合报告附注
5.4.11.1 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,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
5.4.11.2 报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。
5.4.11.3 其他资产构成

上投摩根基金管理有限公司
二〇一六年一月二十二日

上投摩根新兴服务股票型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金管理人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十二日

5.1 重要提示
基金管理人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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年1月21日复核了本报告中财务报告、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。
基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务数据截止日为2015年12月31日。

5.2 基金产品概况

基金名称	上投摩根新兴服务股票
基金代码	901882
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月11日
报告期末基金份额总额	152,080,927.40份
投资目标	通过积极主动的管理和科学的风险控制,重点投资于新兴产业相关的优质上市公司,分享新兴产业发展的长期增长红利。
投资策略	1. 资产配置策略 本基金将结合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素,对宏观经济、国家政策、资金面和估值等因素进行综合考量,制定和调整资产配置方案,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。 2. 股票投资策略 本基金将结合行业基本面、估值、政策等多方面因素,对宏观经济、国家政策、资金面和估值等因素进行综合考量,制定和调整资产配置方案,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。 3. 债券投资策略 本基金将结合宏观经济、政策、市场等多方面因素,对宏观经济、国家政策、资金面和估值等因素进行综合考量,制定和调整资产配置方案,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。 4. 衍生品投资策略 本基金将根据风险管理原则,适度使用股指期货、国债期货等金融衍生品,以对冲投资组合的系统性风险,提高投资效率。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率*80%+中债总财富指数收益率*20%
风险收益特征	