上投摩根分红添利债券型证券投资基金

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
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十二日

§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2016年1月21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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根分红添利债券
基金主代码	370021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月25日
报告期末基金份额总额	240,637,131.36份
投资目标	在有效控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极主动的投资管理,力争为投资者创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。通过对固定收益资产的投资,获取稳定的投资收益;在此基础上,适当参与新股发行申购及增发新股申购,在严格控制基金资产运作风险的基础上,实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证综合债券指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	上投摩根分红添利债券A类 / 上投摩根分红添利债券B类
下属分级基金的交易代码	370021 / 370022
报告期末下属分级基金的份额总额	229,875,886.65份 / 10,761,244.71份

§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10月1日-2015年12月31日)	
	上投摩根分红添利债券A类	上投摩根分红添利债券B类
1.本期已实现收益	3,675,835.51	187,719.18
2.本期利润	4,793,044.12	241,286.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0213	0.0199
4.期末基金资产净值	258,017,874.02	12,054,699.56
5.期末基金份额净值	1.122	1.120

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

1、上投摩根分红添利债券A类:

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	1.90%	0.08%	2.33%	0.06%	-0.43%	0.02%

2、上投摩根分红添利债券B类:

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	1.81%	0.08%	2.33%	0.06%	-0.52%	0.02%

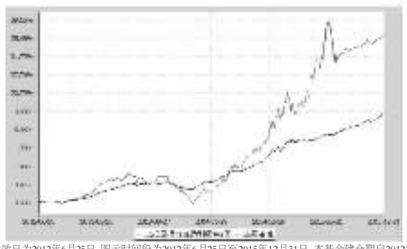
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根分红添利债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月25日至2015年12月31日)

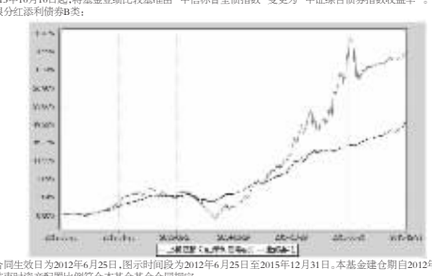
1. 上投摩根分红添利债券A类:



注:本基金合同生效日为2012年6月25日,图示时间段为2012年6月25日至2015年12月31日。本基金建仓期自2012年6月25日至2012年12月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金自2015年10月10日起,将基金业绩比较基准由“中信标普全债指数”变更为“中证综合债券指数收益率”。

2. 上投摩根分红添利债券B类:



注:本基金合同生效日为2012年6月25日,图示时间段为2012年6月25日至2015年12月31日。本基金建仓期自2012年6月25日至2012年12月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金自2015年10月10日起,将基金业绩比较基准由“中信标普全债指数”变更为“中证综合债券指数收益率”。

§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		
赵峰	本基金基金经理、债券投资部总监	2012-06-25	-	13年	上海财经大学金融学硕士。2003年4月至2006年5月在中银万国证券研究所担任研究员负责债券研究方面的工作;2006年6月至2011年3月在富国基金管理有限公司担任投资经理负责债券投资方面的工作;2011年4月加入上投摩根基金管理有限公司,2011年9月至2014年12月担任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理,2012年6月起任上投摩根分红添利债券型证券投资基金基金经理,2013年7月至2014年12月担任上投摩根大额年丰混合型证券投资基金基金经理,2013年6月至2015年11月担任上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金基金经理,自2014年6月起任上投摩根优信增利债券型证券投资基金基金经理,自2014年12月起同时担任上投摩根纯债添利债券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.赵峰先生为本基金首任基金经理,其任职日期按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.投资期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《上投摩根分红添利债券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;报告期内,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%的次数为两次,均发生在纯量化投资组合与主动管理投资组合之间。

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

2015年4季度市场大幅波动,9月下旬,在汇率预期稳定、场外杠杆清理完毕后,市场从恐慌中逐渐恢复。板块方面,技术领先、符合社会演进方向的行业,例如云计算、虚拟现实、智能驾驶、“地经济”等相关公司表现抢眼。而传统行业,如房地产、商贸等低估值板块在保险举牌的背景下,也走出一段不错的行情。

2016年,预计货币政策保持相对宽松,但在2015年5次降准降息的大幅度宽松基础下,继续宽松的空间减小;预期财政政策可能会加码,通过财政手段有的放矢的支持经济转型。同时,年底政府多次提及的供给侧改革将在2016年逐步落地,钢铁、煤炭、电力、有色等传统行业将会有机会;而符合产业发展趋势、社会发展阶段的新兴服务行业、高科技行业、高端制造行业仍然会继续有投资机会。展望2016年,变革仍然是主基调,新兴服务、高科技行业仍然值得中长期配置。同时供给侧改革指出了房地产去库存、淘汰落后产能的方向,钢铁、煤炭、有色、地产等传统产业也会有机会。

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33.29%,同期业绩比较基准收益率为13.57%。

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	1,467,330.00	0.40
	其中:股票	1,467,330.00	0.40
2	固定收益投资	301,513,855.44	82.60
	其中:债券	301,513,855.44	82.60
	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	35,203,543.38	9.64
7	其他各项资产	26,846,205.45	7.35
8	合计	365,030,934.27	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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	27,330.00	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,440,000.00	0.53
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	1,467,330.00	0.54

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	601318	中国平安	40,000	1,440,000.00	0.53
2	603778	乾景园林	1,000	27,330.00	0.01

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	34,544,400.00	12.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	21,004,000.00	7.78
	其中:政策性金融债	21,004,000.00	7.78
4	企业债券	196,333,558.04	72.70
5	企业短期融资券	20,037,000.00	7.42
6	中期票据	20,535,000.00	7.60
7	可转债	9,059,897.40	3.35
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	301,513,855.44	111.64

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	150218	15国开18	200,000	21,004,000.00	7.78
2	010107	21国债(7)	180,000	19,517,400.00	7.23
3	019515	15国债15	150,000	15,027,000.00	5.56
4	1282501	12电网MTN4	100,000	10,352,000.00	3.83
5	101551075	15光明MTN002	100,000	10,183,000.00	3.77

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	51,742.82
2	应收证券清算款	20,703,915.62
3	应收股利	-
4	应收利息	5,911,923.13
5	应收申购款	178,623.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,846,205.45

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	2,596,800.00	0.96
2	110030	格力转债	1,517,780.00	0.56

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票无流通受限情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入的原因,投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	上投摩根分红添利债券A类	上投摩根分红添利债券B类
本报告期期初基金份额总额	191,325,574.36	12,763,797.91
报告期基金总申购份额	65,586,385.78	2,282,700.66
减:报告期基金总赎回份额	27,036,073.49	4,285,253.86
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	229,875,886.65	10,761,244.71

§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分红添利债券型证券投资基金设立的文件;

2、《上投摩根分红添利债券型证券投资基金基金合同》;

3、《上投摩根分红添利债券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
二〇一六年一月二十二日

上投摩根行业轮动混合型证券投资基金

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
基金托管人:招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

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月21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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根行业轮动混合
基金主代码	377530
交易代码	377530
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年1月28日
报告期末基金份额总额	1,143,950,346.75份
投资目标	本基金通过把握资产轮动、产业策略与经济周期相联系的规律,挖掘经济周期波动中强势行业中具有核心竞争优势的上市公司,力求在景气的多空变化中追求基金资产长期稳健的超额收益。
投资策略	国际经验表明,受宏观经济周期波动的影响,产业发展存在周期轮动的现象。某些行业能够在经济周期的特定阶段获得更好的表现,从而形成阶段性的强势行业。在股票市场中表现为行业投资收益的中长期轮动,处于各行业的不同企业也面临不同的投资机会。本基金通过把握经济周期变化,依据对宏观经济、产业政策、行业景气度及市场波动等因素的综合判断,采取自上而下的资产配置策略,行业配置策略与自下而上的个股选择策略相结合,精选强势行业中具有核心竞争优势的个股,力求无论在多空市场环境下均能获取稳健的超额回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是主动管理的混合型证券投资基金,属于证券投资基金的较高风险品种,预期风险收益水平风险高于债券基金和货币市场基金,低于股票基金。
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

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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	231,910,136.79
2.本期利润	631,788,797.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.5504
4.期末基金资产净值	2,565,260,895.78
5.期末基金份额净值	2.242

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

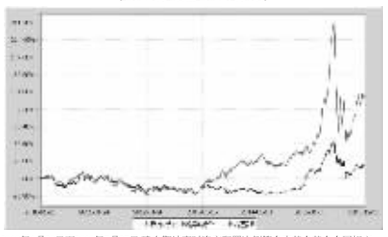
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	33.29%	2.05%	13.57%	1.34%	19.72%	0.71%

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

上投摩根行业轮动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

(2010年1月28日至2015年12月31日)



注:本基金建仓期自2010年1月28日至2010年7月27日,建仓期结束时资产配置比例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,图示时间段为2010年1月28日至2015年12月31日。

§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		
孙芳	本基金基金经理,投资二部投资总监	2014-12-19	-	13年	华东师范大学经济学硕士,2003年7月至2006年10月任华宝兴业基金行业研究员;自2006年12月起加入上投摩根基金管理有限公司,先后担任行业专家、基金经理助理,主要负责投资研究方面的工作。自2011年12月起担任上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金经理,2012年11月起担任上投摩根核心优选混合型证券投资基金基金经理,2014年2月至2015年7月同时担任上投摩根核心成长股票型证券投资基金基金经理,自2014年12月起同时担任上投摩根行业轮动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.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、《上投摩根行业轮动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;报告期内,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%的次数为两次,均发生在纯量化投资组合与主动管理投资组合之间。

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

2015年4季度市场大幅波动,9月下旬,在汇率预期稳定、场外杠杆清理完毕后,市场从恐慌中逐渐恢复。板块方面,技术领先、符合社会演进方向的行业,例如云计算、虚拟现实、智能驾驶、“地经济”等相关公司表现抢眼。而传统行业,如房地产、商贸等低估值板块在保险举牌的背景下,也走出一段不错的行情。

2016年,预计货币政策保持相对宽松,但在2015年5次降准降息的大幅度宽松基础下,继续宽松的空间减小;预期财政政策可能会加码,通过财政手段有的放矢的支持经济转型。同时,年底政府多次提及的供给侧改革将在2016年逐步落地,钢铁、煤炭、电力、有色等传统行业将会有机会;而符合产业发展趋势、社会发展阶段的新兴服务行业、高科技行业、高端制造行业仍然会继续有投资机会。展望2016年,变革仍然是主基调,新兴服务、高科技行业仍然值得中长期配置。同时供给侧改革指出了房地产去库存、淘汰落后产能的方向,钢铁、煤炭、有色、地产等传统产业也会有机会。

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33.29%,同期业绩比较基准收益率为13.57%。

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	2,334,344,302.37	89.22
	其中:股票	2,334,344,302.37	89.22
2	固定收益投资	51,770,824.00	1.98
	其中:债券	51,770,824.00	1.98
	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	220,842,955.61	8.44
7	其他各项资产	9,564,663.21	0.37
8	合计	2,616,522,745.19	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	109,589,241.26	4.27
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,054,848,430.18	41.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,645,000.60	1.16
E	建筑业	111,301,495.24	4.34
F	批发和零售业	205,195,515.28	8.00
G	交通运输、仓储和邮政业	12,533,253.81	0.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	186,749,850.95	7.28
J	金融业	116,626,956.74	4.55
K	房地产业	292,566,898.19	11.40
L	租赁和商务服务业	12,555,927.00	0.49
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	60,132,015.08	2.34
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	79,172,104.40	3.09
S	综合	63,427,613.64	2.47
	合计	2,334,344,302.37	91.00

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	002345	潮宏基	6,427,992	108,504,504.96	4.23
2	002466	天齐锂业	597,557	84,106,147.75	3.28
3	002477	雏鹰农牧	4,808,923	81,318,887.93	3.17
4	600701	工大高新	2,650,548	63,427,613.64	2.47
5	000718	苏宁环球	4,679,180	61,718,384.20	2.41
6	002273	水晶光电	1,479,614	60,072,328.40	2.34
7	002329	皇氏集团	2,050,973	57,222,146.70	2.23
8	002717	岭南园林	1,240,551	54,460,188.90	2.12
9	002405	四维图新	1,388,676	53,880,628.80	2.10
10	600122	宏图高科	2,769,300	53,779,806.00	2.10

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,005,000.00	1.95
	其中:政策性金融债	50,005,000.00	1.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,765,824.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	51,770,824.00	2.02

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	500,000	50,005,000.00	1.95
2	110031	航信转债	13,600	1,765,824.00	0.07

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	2,025,294.36
2	应收证券清算款	4,305,889.65
3	应收股利	-
4	应收利息	2,926,172.01
5	应收申购款	307,307.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,564,663.21

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	1,765,824.00	0.07

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票无流通受限情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入的原因,投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

§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	1,090,191,102.93
报告期基金总申购份额	152,246,613.40
减:报告期基金总赎回份额	98,487,369.58
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,143,950,346.75

§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行业轮动混合型证券投资基金设立的文件;

2、《上投摩根行业轮动混合型证券投资基金基金合同》;

3、《上投摩根行业轮动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
二〇一六年一月二十二日

上投摩根大盘蓝筹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
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十二日

§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2016年1月21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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根大盘蓝筹股票
基金主代码	376510
交易代码	376510
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月20日
报告期末基金份额总额	143,560,943.85份
投资目标	通过投资大盘蓝筹股票,力争最大程度的分享中国经济持续发展带来的中长期收益。在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金充分借鉴摩根资产管理集团全球行之有效的投资理念和技术,自下而上的精选个股,重点投资于在行业内占有领先地位、业绩良好且稳定增长、价值相对低估的大盘蓝筹上市公司。同时结合宏观经济运行状况和金融市场运行状况和趋势的市场研判,对相关资产类别的预期收益进行监控,动态调整股票、债券等大类资产配置。
业绩比较基准	沪深300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,在开放式基金中,其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,属于风险水平较高的基金产品。
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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	31,680,802.31
2.本期利润	38,758,458.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.2570
4.期末基金资产净值	226,235,029.51
5.期末基金份额净值	1.576

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	18.59%	1.86%	14.30%	1.42%	4.29%	0.44%

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