

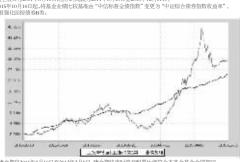
# 上投摩根强化回报债券型证券投资基金

## **2015 第四季度** 报告

担个别及建带责任。 基金杆管人中国建设银行股份有限公司根据本基金会同规定,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						
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	即管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。 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。				
		§ 2 基金产品概况				
	基金简称	上投摩根强化回报债券				
	基金主代码	372010				
	基金运作方式	契约型开放式				
	基金合同生效日	2011年8月10日				
	报告期末基金份额总额	16.137.386.78份 本基金在严格控制风险和维持资产收高流光性的基础上,通过主动管理,力争获得超越业绩比较基本 的投资收益率。实现基金资产的长期稳定增值。				
	投资目标					
	投資策略	本基金将通过对固定收益类金融工具的主动管理。力争获取稳定的债券投资收益。此外,本基金将根据对投资市场的趋势研测及新股(增发)申购收益率的预测。适整与一级市场化发射协会股票 投资,在严格处别规定的预度下,方式是基金的整股收益率。 本金档采用用版主动的情势投资策略。以中长期种学分析分化。结合生寒经济周期、紧观效等为由。或者被继续整个条件。在一种轮刺风				

3.1 主要财务指标

2 - 4



姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
KE-KE	871.99	任职日期	离任日期	IIE3FAANE4-PR	19091
唐瑭	本基金基金经理	2015-12-11		8年	英国爱丁傑大学硕士,2008年2月至200年4月 PMorganicRAA分析所。2018年3月加入上學報 管理有限公司,先后担任研究员及基金经理助理 2015年5月起附近上投廠服务少富定附升依備导型。 投資基金基金營理,且2015年1月起同时担任上投庫 銀化四股债券型证券投资基金和上投廠根轮动路条 季程证券投资基金基金完整。
马毅	本基金基金经理	2015-04-22	2015-12-23-	7年	200年7月至201年3月年李朝李管理有限公司 等記録。2014年7月至201年5月在3個基金管理模 前年年金投修処理業研究1,201年5月起加人上校 東ム管理を研究の、前年投資をデール、主要信息 中产品投資的7件。自2014年3月至2015年12月旧日 資業報や漁港等を報告等を記を終り返去を12月間 素が開発・型正等投資基金基金を提供。自2015年4月 2015年12月日日上投票報金化開発・電圧等投資基金基金を提供。 2015年12月日日上投票報金化開発・電圧等投資 金加金等度。自2015年5月至2015年12月間村採任1 機関金維生率機能等対定等分度基金基金等差。

4.3.1 公平交易制度的取行价价。 报告期,本企可能使實现落实。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 等规则范则上市股票。债券的一级市场申请工资市场交易需定动,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 可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,本公司标行集中交易制度,确保不同投资组合在交卖同一证券时,按照时间技术上间分拾的原则在各投资

合何公平分配交易量。对于提行河市场投资活动。本公司通过对手库控制和交易宏简价和制,严格防范对手风险并检查价格公允性。对于根较资行方,本公司通循价格允先,比例分企的原则,根据事物独立中根价价格或规划交易标果在方公子为组。 报告期内,通过4不同投资指合之间的现在单层形式。对同问交易和区间交易的交易时机和交易价差监控分析,未发现整体公平交 代于出现等常的情况。 4.31异常义易行为转专项进期 报告期内,通过对党易价格、交易相向、交易方向等的分析,未发现有可能等载不必平交易和利益输送的异常交易行为。 所有投资组合金净的交易所公开资价同日反向交易成交权少的单位交易量程宜该证券当日成交量的\$\(\sigma\)的情形。报告期内,所有股资组 与向交易所公开资价同日反向交易成交权少的单位交易量超过该证券当日成交量的\$\(\sigma\)的大致为两次,均发生在纯量化投资组合与主 穿现券的社会之间。

按价效率的物明,加之则则为米+是關抗化。以中高等效信用物度量率处验 下方百亩元成益率膨胀整体 F8-12316 日美味熟加品。得购、 长侧发建和加速 F7-在李星被抵抗。10年期间开催的基本一度变弱。1次大,电体等效信用等交易,但为全局的发生下行。同时,由于 实体经济和企业基本而尚未好利。信用风险频度、发情企业资质分化加则。本基金提高了中高评效信用情的比例,等低组合信用风险频率。 明显1016年一季度,中央经济工作会以对2016年的定位更加营业于中、长期改革而非对经济的短期制度、经济提长出现""是类频量。 展型2016年一季度,中央经济工作会议对2016年的定位更加营业于中、长期改革而非对经济的短期制度、经济提长出现""整生频量。 大于""型投充而资价或是更多增加。1016年的发生,2016年的定位更加营业于中、长期改革而非对经济的短期制度、经济提长出现""整生频量, 大于""型投充的资价。本基金的产量转换的环境设备定,值市环境的然处分健康、风险因素在于海外大滨商品价格及国内的价的阶段 性生强、经济边所改建以及收益率过低而造成的情市波动,因此、本基金将采用中性杠杆,组合品种资质上移的操作策略,并根据市场情况 样机参与高弹性是特色的交易现代。

参与高溶性品种的交易则配会。 4.3据告期内基色的业绩表现 本用法即苏基金A类价额单值增长率为1.75%,未基金B类基金份额单值增长率为1.70%,同期业绩比较基准收益率为2.33%。 4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预需设明 4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值领于五千万元的情况,出现该情况的时间范围为2015年10月15日至2015年12月

日。 基金管理人拟调整本基金运作方式,加大营销力度,提升基金规模,方案已根监管机关。 6.5 投资组合报告

序号	版吉朋木基金货产组合情况 项目	金額(元)		占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,407,742.00		6.68
	其中:股票	1,407,742.00		6.68
2	固定收益投资	18,212,566.70		86.39
	其中:债券	18,212,566.70		86.39
	资产支持证券	_		-
3	责金属投资	_		-
4	金融衍生品投资	_		-
5	买人返售金融资产	_		-
	其中:买斯式回购的买人返售金融资产	_		-
6	银行存款和结算备付金合计	950,224.11		4.51
7	其他各项资产	511,435.23		2.43
8	合计	21,081,968.04		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		-	-
В	采矿业		-	
C	制造业	816,01	6.00	3.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		-	-
E	建筑业		-	-
F	批发和零售业		-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	366,33	6.00	1.79
Н	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		-	-
K	房地产业	225,39	00.0	1.10
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		-	-
О	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	1.407.74	2.00	6.87

债券代码

平為並平原官明本本持有权证。 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。

3而形。 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

8.1备查次件目录 1.中国证监会批准上投降积强化回取债券型证券投资基金分同); 2.人上投降限型化回取债券型证券投资基金金合同); 3.上投降限型化回取债券型证券投资基金件管协议); 4.人上投降用产优式基金业多规则); 6.基金管型人业务资格批件、营业执照; 6.基金管型人业务资格批件和营业处照。

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

# 上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金

### **2015 第四季度** 报告

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

、例及连带唐任。 基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金台同规定,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。

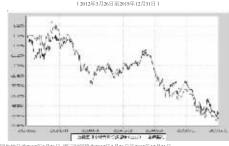
基金简称	上投摩根全球天然资源混合(QDII)
基金主代码	378546
交易代码	378546
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月26日
报告期末基金份額总额	65,034,463.70(;)
投资目标	本基金主要投资于全球范围内从事天然资源的勘探、开发、生产及销售。或是向天然资源行业提供服务的公司的投票,通过条板主动的资产配置和组合管理。在风险可控的前提下以获取长期资产增值。
投資策略	全球天地病原的网络巨人来时任愿支撑中系斯地位介着目标空息,这里示了实然的原具有缺少的 的场价。该于他少明线上四公司是自有效的较限电点。本场中长分分字企业下的原理与来 来的高州政策。此事把整合球天地旁部的线索组合。如此为投资者带来长期隐建则思 总体上本基金等规划上面下与目下而,拥挤合的投资额高,指头通过等不同国家的发展 趋势及不同行业的管气程度,决定他位与现状的基本布局,其次采取目下而上的造股额路。在20世 提出了基本面的价价的时,是12年从不好定理的位与动物特性,选取目标处设计会。在国业收益 进投资份,本选与将6分率的产布局的安全性,统治性与收益性,并结合现金管理要求率来制 订具体路路。
业绩比较基准	汇丰矿产、黄金及能源指数(总回报)
风险收益特征	本基金方混合型投资基金、主型投资干海外市场的天然资源行业的股票。本基金的业绩表现在大多数的情况下与国际大学商品价格的走势具有效率的排关性。本基金的预测取场数益从平低于投票型基金。高于增多率基金及货币市场基金。属于增多率级和技术预测数量的基金品种。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
境外投资顺问英文名称	JPMorgan Asset Management(UK) Limited
境外投资顺问中文名称	摩根资产管理(英国)有限公司
境外资产托管人英文名称	Bank of China (Hongkong)
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港)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

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	-601,157.23
2.本期利润	-369,396.67
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0061
4.期末基金资产净值	29,475,981.96
5.期末基金份额净值	0.453
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收:到收益加上本期公分价值变示收益。	益、其他收人(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期日

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,计人费用后实际收益水平要低于所列数字

上投廠相合理于快资源混合刑证券投资非全 工政學依至學人然與哪能百至此分及與鄰並 累計份額爭值增长率与业績比较基準收益率历史走勢对比图 (2012年3月26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

本基金基金 经理

2. 张军先生担任本基金首任基金经理的任职日期为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境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

4.3报告期内本基金运作遵原守信情应说明 在本报告期内,基金管理人不存在描述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》为发化的有关建油注取。(土投廉根金球天然营源混合地距券投资基金会同)的规定,基金经理对个股和投资组合的比例遵 简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。

4.4公平交易专项说明

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 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

4.5报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

展望2016年,国际原油供大于求的格局还将继续成为压制油价走低的因素。在2016年的第一季度仍可预计每日新增供给100万桶以上

而原油需求的增长跟不上供给增加的速度。在那些主要产油国间争夺市场份额的价格战还没有结束前、油价仍处在探底过程中。这使得市

而限制而来的增长数个工程的互加助地度、在那些主要广油加明中外中助价物则价格或改良有各集则,而的价效在体涨或量中。这使停止 除对价全球等提供货价值值销售在运动的时期单位有正面的效宜。 除了产油国和区域组织层面的明争暗斗外,在全球主要的资源类公司层面却可以观象到一些ن董碑里性的反应。企业为了应对团境。已 经开始了"自敌"行动,如宣布破产,控制成本,削减开支等措施、以维持现金流、增强投资人的持股信心、这些情况在工业金属行业比较明 是一当家库得更好,投资者风险维尔英德分价位实现也会在一级新形分投资者间逐渐复观。 尽管行业供大于求是目前压制股价的最大基本面因素,但股价已经连年走低,国际资金在能源和大宗股票上的配置也已经降到版位。

更多资金在观望等待。厂商宣布的减产措施将会抑制明年以后的供给量,供求关系在未来会发生变化。本基金坚定持有处于中长期价值投

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

5.1 报告期末基金资产组合情况

报告期内,本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况,出现该情况的时间范围为2014年8月8日至2015年12月

807,259. Freeport=McMoRan In 725,851. Alcoa Inc

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

5.10投资组合报告附注

5.10.1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 5.10.2报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库

序号	名称	金額(人民币元)
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收股利	24,258.29
4	应收利息	537.36
5	应收申购款	266,369.13
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	291,164.78
5.10.4报台	·期末持有的处于转股期的可转换债券明细	

5.10.5 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中不存在流通受限情况。

因四舍五人的原因,投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

\$7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况。 7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 于

1、中国证监会批准上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金设立的文件;

《上投摩根企課天然资源混合型证券投资基金基金合同》。3、《上投摩根企課天然资源混合型证券投资基金基金托管协议》;4、《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

6、基金托管人业务资格批件和营业执照。

基金管理人或基金托管人住所。

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

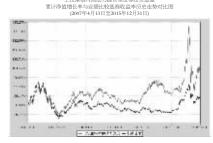
上投摩根基金管理有限公司

§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康假记载、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 了別及並前別比。 基金信管人中国工商銀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 等內容、保证复核内容不存む建設过载、混甲性陈述或者重大造温。 基金管理人承诺以诚实信用,勤勉尽劳的限则管理和运用基金资产。但不保证基金一定盈利。 基金管过任业绩并不代表状未来表现。投资有代则处,投资者在中担投资决策前应仔细阅读本基金的招募设明书。

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	2,346,456,255.42(f)
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。
投资簿略	(1)股票投资额据 在投资性合建等的管理的过程中,本基金将采取"自上而下"与"自下而上"相对合约方法。基金管理人在分辨等级所产业分析的基础上、选择具有可转床增长的保护化力的现象。从分理价格及人并进行中产化则收货。 (2)股市收益类投资器。 (3)股市收益类化、最初分析管区、基金管理人不会外租建筑大大憩外产程度,但为进一步的联系。从总域与成功分主一,参加分析管区、基金管理人不会外租建筑大大憩外产程度,也进一步的联系。 (4)股市发生及不同债务。 (4)股市发生及不同债务。(4)股市发生及工程、(4)股市发生、(4
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	本基金是一只混合型基金,其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金,属于较高风险,较高预期收益的基金产品。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司

	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	213,919,996.00
2.本期利润	691,115,946.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.2832
4.期末基金资产净值	3,428,312,227.10
5.期末基金份额净值	1.4611
益加上本期公允价值变动收益。	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 文师费用(例加 开场子其个的由阶额问题 行利面料涂题 其个转换费筮) 计 1 3

2水平要低于所列数字。 鱼齿 字型 と頭比較品相収3 率3) 2.69% 13.57% 13.4% 争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 上投摩根内需动力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 (2007年4月13日至2015年12月31日)



# 上投摩根内需动力混合型证券投资基金

# **2015 第四季度** 报告

2015年12月31日

本基金建仓期自2007年4月13日至2007年10月12日。建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。 § 4 管理人报告 基金基金 理,投资-杜猛

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。

注:本基金合同生效日为2007年4月13日,图示时间段为2007年4月13日至2015年12月31日

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 在本报告期內、基金管理人不在抵害基金的拥持有人利益的行为、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、《上投降根内需动力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。

4.3.1 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 报货制的,本公司继承员制备关证券按收益金管理公司公平交易制度指字重见)专特民法律法规形公司训制完于交易城市的各项要求"严格规范设力上市限票"编码产场级市场市场市场市场。 来广格规范设力上市限票,编码产场报场市场,经市场全局等活力。通过系统内、工程结合的方式进行交易执行和监控分析。以确保 本公司管理的不同时党组合在建议。研究分析、报资决策、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 组合间以平分应义是推设计量任何市场投资活动。本公司通过对手作政制和交易的价制,"格的资本子风险并检查价格公允性;对于 申购投资行为。本公司通循价格优先,比例分配的原则,根据事前独立中根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

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

4.1 报告前户部基金投资股份的运营等分别。 4.4 报告前则基金投资服务加险价分析 2015年季度、股市场的流产性问题逐步得到改善。市场机制也不断核复。虽然中国宏观经济增速仍然处在下行阶段。但我们观察到政府 也在他时相应的资度,对专准估算限。原则,我们也发展国内的一些新兴产业正在发生积极向上的变化、未来将成为中国经济增长的新动力。本基金依据契约、重点投资了相关行业的优势公司。取得了明显的超额收益。

市场在2015年联告起伏,相信的投资者每少点"中记忆来到,这里面有整验也有数别。展望2016年,市场依旧扑离法度,传统经济的低速可能依然持续。受制于汇单,货币政策可腾挪的空间已经不大。2016年经济增长更多的需要财政政策的发力,我们将持续的关注政策可能带来的投资机会。从更长期看,新兴产业的崛起将成为中国未来10—20年经济增长的最大动力,证券市场最大的投资机会也将来源于此。我们将充分张人研究。寻找那份业中长则成长的公司,力争为基金将有人创造特殊稳定收益。

本报告期本基金份额净值增长率为22.97%,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

序号		順目			金額(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资				2,937,109,908.25	85.
	其中:股票				2,937,109,908.25	85.
2	固定收益投资				140,094,157.94	4
	其中:债券				140,094,157.94	4
	资产支持证券				-	
3	贵金属投资				-	
4	金融衍生品投资				-	
5	买人返售金融资产				-	
	其中:买断式回购的买人返	售金融资产			-	
6	银行存款和钴算备付金合计	+			307,884,542.72	8
7	其他各项资产				59,494,563.50	1
8	合计				3,444,583,172.41	100
5.2	报告期末按行业分类的股票	投资组合				
代码	行	业类别		2	·允价值(元)	占基金资产净值比例(%
A	农、林、牧、渔业				-	
В	采矿业				-	
С	制造业				2,016,846,629.14	50
D	电力、热力、燃气及水生产和供	taizak			-	
E	建筑业				30,911,628.00	
F	批发和零售业	k				
G	交通运输、仓储和邮政业				79,138,289.00	
Н	住宿和餐饮业				-	
I	信息传输、软件和信息技术服	务业			303,276,413.86	
J	金融业				375,202.94	
K	房地产业				313,258,566.01	
L	租赁和商务服务业				197,322.81	
M	科学研究和技术服务业				68,782,920.36	
N	水利、环境和公共设施管理业				-	
0	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	文化、体育和娱乐业			121,570,574.00	
S	综合			-		
	合计				2,937,109,908.25	8
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	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	002466	天齐锂业		2,233,847	314,413,965.2	5
2	002236	大华股份		6,496,834	239,733,174.6	0
3	002292	奥飞动漫		4,425,145	228,824,247.9	5
4	600745	中茵股份		5,333,204	218,554,699.9	2
5	002701	奥瑞金	1	4,953,542	139.987.096.9	2

1	国家债券				-	-			
2	央行票	据			-	_			
3	3 金融债券 其中:政策性金融债				140,010,999.70	4.08			
					140,010,999.70	4.08			
4	企业债	#:			-	-			
5	企业短	明融资券			-	-			
6	中期票	居			-	-			
7	可转债				83,158.24	0.00			
8	同业存	<b></b>			-	-			
9	其他				-	-			
10	合计				140,094,157.94	4.09			
5.5 报告	期末按公	允价值占基金资产有	首比例大小排序的	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	1,399,970	140,010,999.70	4.08			
2		128009	歌尔特债	592	83,158.24	0.00			
本基金本 5.7 报告 本基金本 5.8报告捐 本基金本 5.9 报告 本基金本 5.10报告 本基金本 5.11投资	报告期5 报告期5 报未按别5 报告按公司 报告本期5 报告本期5 报告本期5 报告本期5 报告和5 报告报告报告报告报告报告报告报告报告报告报告报告报告	來未持有资产支持证法 允价值占基金资产的 於作人。 於价值占基金资产净 於价值占基金资产净 來未持有股指期货。 金投资的圆债期货必 金投资的国债期货必 来未持有国债期货。 例往	条。 移值比例大小排序的 值比例大小排序的前 总易情况说明 总易情况说明						
5.11.1批 付情形。	当期内本	** ** ** ** ** ** ** ** ** ** ** ** **	(牙的女仃王体本明)	文有出现教益官部 ] 立3	案调查,或在报告编制日前	一年内支到公井盧贡、处			
			票中没有在基金合同	可规定备选股票库之外的	的股票。				
序号	序号 名称 金額(元)								

序号		名称		金額(元)				
1	存出保证金				2,096,064.65			
2 应收证券清算款 3 应收股利				48,769,030.31 —				
4	应收利息				8,140,605.52			
5	应收申购款			488,863.0				
6	其他应收款							
7	待摊费用							
8	其他				_			
9	合计			59,494,563.				
5.11.4报告期末排	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		128009	歌尔转债	83,158.24	0.00			

			-
			-
			59,494,563.50
公允	允价值(元)	占基	5.金资产净值比例(%)
83,158.24		58.24	0.00
			单位:6
			2 502 314 942 75

81备查文件目录 1.中国证监会批准上投降相内需动力混合型证券投资基金设立的文件; 2.(上投降相内需动力混合型证券投资基金基金合同); 3.(上投降相内需动力混合型证券投资基金杆管协议); 4.(上投降相下放式基金业务规则); 5.基金管理人业务资格批准;每此规则; 6.基金柱管人业务资格批准;每此规则; 8.基金柱管人业务资格批准;每

8.2存放地点 基金管理人或基金托管人处。