上投摩根新兴动力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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	上投摩根新兴动力混合
基金主代码	377240
交易代码	377240
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年7月13日
报告期末基金份额总额	1,002,881,036.45份
投资目标	本基金在把握经济结构调整和产业升级的发展趋势基础上,充分挖掘新兴产业发展中的投资机会,重点关注新兴产业中的优质上市公司,并兼顾传统产业中具备新成长动力的上市公司进行投资,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金管理人认为,从经济发展的中长期趋势看,转变经济发展方式实现经济转型已经成为我国在相当长一段时期内经济发展的首要任务。在后金融危机时期,我国经济面临外需放缓、内部经济结构矛盾可出等问题,要实现经济持续健康的发展必须加快经济结构和产业结构的调整。 纵观世界各国和地区的经济发展历程,新兴产业的崛起和传统产业的升级换代是经济转型的主要驱动力。可以预见的是,新兴产业内生的市场潜力在政府大力扶持的激发下,将带动相关行业上下游全面发展,其间蕴藏着巨大的投资机会。而部分传统产业也将通过新技术、新的商业模式成生产方式等实现产业升级,获取新的成长驱动力。本基金一方面将从新兴产业出发,寻入投掷新兴产业发展过程中带来的投资机会,另一方面将关注传统产业中成长公司的投资。
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	本基金属于混合型基金产品,预期风险和收益水平低于股票型基金,高于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	中国农业银行股份有限公司

§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	312,068,805.35
2.本期利润	654,084,476.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.6302
4.期末基金资产净值	2,592,525,647.55
5.期末基金份额净值	2.585

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。

上述基金业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	31.28%	2.15%	13.57%	1.34%	17.71%	0.81%

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

上投摩根新兴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
(2011年7月13日至2015年12月31日)

注:本基金建仓期自2011年7月13日至2012年1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。

本基金合同生效日为2011年7月13日,图示时间段为2011年7月13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		
杜猛	本基金基金经理,投资一部投资总监	2011-07-13	-	14年	南京大学经济学硕士,先后任职于天同证券、中原证券、国信证券和中银国际证券,任研究员、2007年10月起加入上投摩根基金管理有限公司,历任行业专家、上投摩根中国优势证券投资基金基金经理助理。自2011年7月起担任上投摩根新兴动力混合型证券投资基金基金经理,自2013年3月至2015年9月同时担任上投摩根智选30混合型证券投资基金基金经理,自2013年5月至2014年12月同时担任上投摩根成长动力混合型证券投资基金基金经理,2014年12月起同时担任上投摩根内需动力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.杜猛先生为本基金首任基金经理,其任职日期指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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2管理人对投资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,《上投摩根新兴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 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A股市场的波动性问题逐步得到改善,市场机制也不断修复。虽然中国宏观经济仍然处在下行阶段,但我们观察到政府也在做出相应的对策,并对此抱有期望。回顾1,我们地发现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。本基金依照契约,重点投资了新兴行业的优势公司,取得了明显的超额收益。

市场在2015年跌宕起伏,相信每位投资者都会对这一年记忆深刻,这里面有经验也有教训。展望2016年,市场依旧扑朔迷离,传统经济的低迷可能依然持续。受制于汇率、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。我们将充分深入研究,寻找新兴产业中长期成长的公司,力争为基金持有人创造持续稳定收益。

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31.28%,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	2,231,483,192.59	83.96
	其中:股票	2,231,483,192.59	83.96
2	固定收益投资	105,094,312.69	3.95
	其中:债券	105,094,312.69	3.95
	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	311,061,356.49	11.70
7	其他各项资产	10,143,199.34	0.38
8	合计	2,657,782,061.11	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	2,762.56	0.00
C	制造业	1,561,668,284.61	60.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	52,164,311.86	2.01
F	批发和零售业	27,040,524.52	1.04
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	299,954,865.50	11.57
J	金融业	192.00	0.00
K	房地产业	239,878,208.17	9.25
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	49,341,159.78	1.90
N	水利、环境和公共设施管理业	1,353,511.06	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	77,644.71	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,727.82	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,231,483,192.59	86.07

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	002466	天齐锂业	1,674,366	235,667,014.50	9.09
2	002292	奥飞动漫	3,293,443	170,303,937.53	6.57
3	600745	中茵股份	3,985,779	163,337,223.42	6.30
4	300368	汇金股份	1,664,021	94,383,271.12	3.64
5	002236	大华股份	2,269,733	83,753,147.70	3.23
6	002241	歌尔声学	2,339,720	80,954,312.00	3.12
7	300109	新开源	764,554	79,551,843.70	3.07
8	002709	天赐材料	949,668	78,722,503.20	3.04
9	000687	华讯方舟	2,874,621	77,672,259.42	3.00
10	000718	苏宁环球	5,720,340	75,451,284.60	2.91

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	104,347,433.70	4.02
	其中:政策性金融债	104,347,433.70	4.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	746,878.99	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	105,094,312.69	4.05

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	1,043,370	104,347,433.70	4.02
2	128009	歌尔转债	5,317	746,878.99	0.03

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	3,268,162.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,088,352.20
5	应收申购款	786,684.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,143,199.34

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	128009	歌尔转债	746,878.99	0.03

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	1,091,798,625.92
报告期基金总申购份额	61,177,955.43
减,报告期基金总赎回份额	150,095,544.90
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,002,881,036.45

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 报告期人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	1,075,259.57
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,075,259.57
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.27

§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新兴动力混合型证券投资基金设立的文件;
2.《上投摩根新兴动力混合型证券投资基金基金合同》;
3.《上投摩根新兴动力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

上投摩根智选30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: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	上投摩根智选30混合
基金主代码	370027
交易代码	370027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月6日
报告期末基金份额总额	257,044,566.87份
投资目标	本基金主要投资于受益于国家经济转型,具有较高增长潜力的上市公司股票,在有效控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	从长期来看,盈利的增长是推动公司股价上涨的重要因素。本基金将集中投资于具有良好业绩支撑和确定性成长的公司,以分享其股价上涨带来的收益。从具体操作上,本基金将通过严格的个股精选,筛选出具有较高竞争优势和成长能力的上市公司,并从中挑选出基金管理人认定的最具投资价值的30只左右的股票构建投资组合,以实现对优质股票的集中持股。
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
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	49,876,151.49
2.本期利润	111,210,831.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.4729
4.期末基金资产净值	470,108,329.10
5.期末基金份额净值	1.829

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。

上述基金业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。

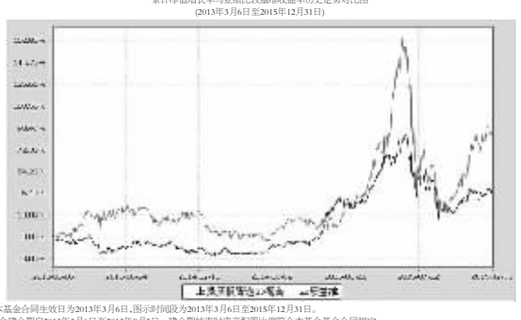
3.2 基金净值表现

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	38.46%	2.33%	13.57%	1.34%	24.89%	0.99%

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

上投摩根智选30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
(2013年3月6日至2015年12月31日)



注:本基金合同生效日为2013年3月6日,图示时间段为2013年3月6日至2015年12月31日。

本基金建仓期自2013年3月6日至2013年9月5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

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		
帅虎	本基金基金经理	2014-12-30	-	12年	帅虎先生,复旦大学硕士研究生,自2007年5月至2010年6月在海通证券担任分析师,自2010年6月至2011年6月在国投瑞银基金任投资经理,自2011年6月起加入上投摩根基金管理有限公司,自2014年11月起担任上投摩根双倍增利债券型证券投资基金基金经理,自2014年12月起担任上投摩根智选30混合型证券投资基金基金经理,自2015年1月起同时担任上投摩根民生需求股票型证券投资基金基金经理
孟亮	本基金基金经理	2015-09-29	-	11年	孟亮先生自2005年9月至2010年4月在上投摩根基金管理有限公司担任研究员,2010年4月至2015年3月在国投瑞银基金管理有限公司担任投资副总监、基金经理,自2015年3月起加入上投摩根基金管理有限公司,现担任指数与量化投资一部副总监一职,自2015年9月起担任上投摩根智选30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管理人对投资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、《上投摩根智选30混合型证券投资基金基金合同》的规定。除以下情况外,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;本基金曾出现个别由于市场原因引起的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形,但已在规定时间内调整完毕。

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季度以来基金累计净值增长率为38.46%,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	408,820,271.77	85.41
	其中:股票	408,820,271.77	85.41
2	固定收益投资	10,001,000.00	2.09
	其中:债券	10,001,000.00	2.09
	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	53,648,436.20	11.21
7	其他各项资产	6,196,438.96	1.29
8	合计	478,666,146.93	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	271,458,458.84	57.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,291,505.70	3.89
F	批发和零售业	2,694,510.00	0.57
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	53,522,782.93	11.39
J	金融业	-	-
K	房地产业	49,121,408.30	10.45
L	租赁和商务服务业	8,802,066.00	1.87
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	4,929,540.00	1.05
S	综合	-	-
	合计	408,820,271.77	86.96

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	002466	天齐锂业	301,447	42,428,665.25	9.03
2	600745	中茵股份	860,485	35,262,675.30	7.50
3	002292	奥飞动漫	579,000	29,940,090.00	6.37
4	300368	汇金股份	373,560	21,188,323.20	4.51
5	000687	华讯方舟	729,004	19,697,688.08	4.19
6	002717	岭南园林	416,663	18,291,505.70	3.89
7	002668	奥马电器	196,086	16,333,963.80	3.47
8	002460	赣锋锂业	228,750	14,395,237.50	3.06
9	000718	苏宁环球	1,050,700	13,858,733.00	2.95
10	002418	康盛股份	394,094	13,797,230.94	2.93

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	10,001,000.00	2.13
	其中:政策性金融债	10,001,000.00	2.13
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,001,000.00	2.13

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	100,000	10,001,000.00	2.13

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	385,901.80
2	应收证券清算款	4,037,263.93
3	应收股利	-
4	应收利息	590,640.80
5	应收申购款	1,182,632.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,196,438.96

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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	250,403,453.81
报告期基金总申购份额	83,589,290.17
减,报告期基金总赎回份额	76,948,177.11
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	257,044,566.87

§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智选30混合型证券投资基金设立的文件;
2.《上投摩根智选30混合型证券投资基金基金合同》;
3.《上投摩根智选30混合型证券投资基金托管协议》;
4.《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
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

上投摩根亚太优势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: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

§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。

基金托管人中国工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	上投摩根亚太优势混合(QDII)
基金主代码	377016
交易代码	377016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月22日
报告期末基金份额总额	8,171,380,093.39份
投资目标	本基金主要投资于亚太地区证券市场以及在其他证券市场交易的亚太企业,投资市场包括但不限于澳大利亚、韩国、香港、印度及新加坡等区域证券市场(日本除外),分散投资风险并追求基金资产稳定增值。
投资策略	本基金在投资过程中注重各区域市场环境、政经前景分析,并强调公司品质与成长性的结合。首先在亚太地区经济发展格局下,通过自上而下分析,甄别不同国家与地区、行业与板块的投资机会,首先考虑国家与地区的资产配置,决定行业与板块的基本布局,并从中初步筛选出具有国际比较优势的大盘蓝筹公司,同时采取自下而上的选股策略,注重个股成长性指标分析,挖掘拥有要值或长特性的公司,构建成长型公司股票池。最后通过深入的相对价值评估,形成优化的核心投资组合。在固定收益类投资部分,其资产布局坚持安全性、流动性和收益性为资产配置原则,并结合现金管理、货币市场工具等来制订具体策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:摩根斯坦利综合亚太指数(不含日本)(MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan)。
风险收益特征	本基金为区域性混合型证券投资基金,基金投资风险收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和平衡型基金。由于投资国家与地区市场的分散,风险低于投资单一市场的混合型基金。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
境外投资顾问英文名称	JF Asset Management Limited
境外投资顾问中文名称	JF资产管理有限公司
境外资产托管人英文名称	The Bank of New York Mellon Company
境外资产托管人中文名称	纽约梅隆银行

§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	-12,993,543.37
2.本期利润	197,800,796.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0238
4.期末基金资产净值	4,621,038,266.60
5.期末基金份额净值	0.566

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。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,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	4.43%	1.08%	6.83%	1.22%	-2.40%	-0.14%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

上投摩根亚太优势混合型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2007年10月22日至2015年12月31日)

注:本基金合同生效日为2007年10月22日,图示时间段为2007年10月22日至2015年12月31日。

本基金建仓期自2007 年10 月22 日至2008 年4 月21 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

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		
张军	本基金基金经理	2008-03-08	-	11年(金融领域从业经验22年)	毕业于上海复