上投摩根中国优势证券投资基金

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	上投摩根中国优势混合
基金主代码	375010
交易代码	375010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年9月15日
报告期末基金份额总额	687,529,439.20份
投资目标	本基金在以长期投资为基本原则的基础上,通过严格的投资纪律约束和风险管理手段,将战略资产配置与投资时机有效结合,精心选择在经济全球化趋势下具有国际比较优势的中国企业,通过精选证券和适度主动投资,为国内投资者提供国际水平的理财服务,谋求基金资产的长期稳定增值。
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,以国际视野审视中国经济发展,将国内行业发展趋势与上市公司价值判断纳入全球经济综合考量的范畴,通过定性定量严谨分析的有机结合,准确把握国家地区与上市公司的比较优势,最终实现上市公司内在价值的合理评估。投资组合资产配置与风险管理的正确实施,本基金以股票投资为主体,在股票选择和资产配置上分别采取“自下到上”和“自上到下”的投资策略。根据国内市场的具体特点,本基金积极利用摩根资产管理集团在全球市场的研究资源,用其国际视野蕴的优势价值评估体系甄别个股素质,并结合本地长期深入的公司调研和严格审慎的基本面与市场面分析,筛选出重点关注的上市公司股票。资产配置层面包括类别资产配置和行业资产配置,本基金不仅在股票、债券和现金三大资产类别间实施策略性调控,也通过对全球区域行业效应进行评估后,确定行业资产配置权重,总体紧密监控组合风险与收益特征,以最终切实提高组合的流动性、稳定性与收益性。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中债总指数收益率×30%
风险收益特征	本基金努力追求资产配置动态平衡,在风险预算目标下使基金收益最大化,属于中等风险证券投资基金产品。
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	201,764,833.79
2.本期利润	395,039,941.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.5618
4.期末基金资产净值	1,786,028,544.19
5.期末基金份额净值	2.5977

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

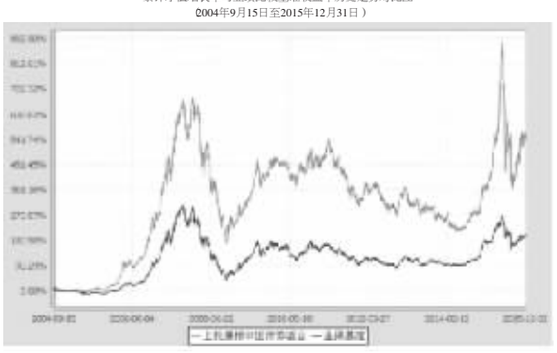
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	27.12%	2.17%	12.25%	1.17%	14.87%	1.00%

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

上投摩根中国优势证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2004年9月15日至2015年12月31日)



注:本基金合同生效时间为2004年9月15日,图示时间段为2004年9月15日至2015年12月31日。

本基金建仓期自2004年9月15日至2005年3月14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2013年12月7日起,将基金业绩比较基准由“富时中国A600指数收益率×70%+上证国债指数收益率×25%+同业存款利率×5%”变更为“沪深300指数收益率×70%+中债总指数收益率×30%”。

§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		
乐琪	本基金基金经理	2015-02-16	-	9年	乐琪先生,美国克拉里恩大学硕士研究生,自2007年3月至2010年8月在中银基金管理有限公司担任研究员,自2010年8月起加入上投摩根基金管理有限公司,自2014年11月起担任上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金经理,自2014年12月起担任上投摩根成长动力混合型证券投资基金基金经理,自2015年2月起同时担任中国优势证券投资基金基金经理。
杨锐瑜	本基金基金经理	2015-08-04	-	8年	2009年07月至2011年03月在广发基金管理有限公司担任研究员,自2011年3月起加入上投摩根基金管理有限公司,担任我公司国内权益投资一部基金经理助理,自2015年8月起担任上投摩根中国优势证券投资基金基金经理,2015年12月起同时担任上投摩根新兴服务股票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、《上投摩根中国优势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

在经历了2015年三季度的剧烈调整之后,四季度市场逐渐恢复了正常交易状态,杠杆资金被严格限制,市场以场内资金博弈为主,中小盘成长股及各种主题的机会更大。四季度的经济基本面依然比较平淡,美联储如期加息,大宗商品继续颓势,人民币汇率波动加大,但是基本保持稳定。

本基金在剧烈震荡之后对市场恢复正常充满信心,在市场的低位坚定加仓,四季度业绩表现良好。随着市场逐步恢复到正常的节奏,我们的投资策略回到正常状态,中国经济已经逐步走出了高投入高增长的阶段,未来经济的长期背景应该是依靠改革和技术进步维持中速增长的新常态。在这种背景下,中小盘成长股的机会更大,本基金也继续坚持成长股为主的配置,精选优质行业、优秀公司进行配置。

展望2016年一季度,本基金认为市场维持震荡的概率较大。目前场内的杠杆资金保持稳定,市场以存量资金为主;经济基本面大概率保持这种不温不火的状态,美国进入新的加息周期,对全球新兴市场保持压力。这种情况下,市场预计将以震荡市、结构性行情为主流。本基金依然长期看好中小盘成长股,但对成长股的精选更加重要。合理的估值、业绩增速以及成长的确定性将重新被投资者看重。大盘蓝筹股也可能会有波段机会,但是要求投资者有较强的交易能力。

结构性行情是机构投资者更加擅长的,未来我们将以追求超额收益作为主要目标,在震荡市中寻找新兴行业中的优质龙头公司,同时根据市场情况增加波段操作和在不同板块之间的切换。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内基金份额净值增长率为21.36%。

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	1,565,463,240.09	84.84
	其中:股票	1,565,463,240.09	84.84
2	固定收益投资	75,083,000.00	4.07
	其中:债券	75,083,000.00	4.07
	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	180,836,939.00	9.80
7	其他各项资产	23,909,640.10	1.30
8	合计	1,845,292,819.19	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	641,313,611.02	35.91
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	14,166,810.00	0.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	175,454,545.36	9.82
J	金融业	267,769,146.77	14.99
K	房地产业	378,622,313.40	21.20
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	35,798,164.94	2.00
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	52,338,648.60	2.93
S	综合	-	-
	合计	1,565,463,240.09	87.65

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	000558	莱茵体育	5,458,099	151,189,342.30	8.47
2	002466	天齐锂业	752,828	105,960,541.00	5.93
3	000718	苏宁环球	6,954,996	91,736,397.24	5.14
4	000555	神州信息	1,992,261	83,874,188.10	4.70
5	601336	新华保险	1,047,438	54,686,737.98	3.06
6	600340	华夏幸福	1,752,481	53,836,216.32	3.01
7	603019	中科曙光	588,487	53,652,359.79	3.00
8	600837	海通证券	3,379,556	53,464,575.92	2.99
9	002292	奥飞动漫	1,030,409	53,282,449.39	2.98
10	002456	欧菲光	1,679,499	52,098,058.98	2.92

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	15,033,000.00	0.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,050,000.00	3.36
	其中:政策性金融债	60,050,000.00	3.36
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	75,083,000.00	4.20

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	300,000	30,003,000.00	1.68
2	019509	15国债09	150,000	15,033,000.00	0.84
3	150416	15农发16	100,000	10,023,000.00	0.56
4	150215	15国开15	100,000	10,013,000.00	0.56
5	150413	15农发13	100,000	10,011,000.00	0.56

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本基金投资的海通证券股份有限公司(以下简称“海通证券”,股票代码600837)于2015年11月26日收到中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《调查通知书》(稽查总队调查通字153122号)。海通证券因在融资融券业务中涉嫌违反《证券公司监督管理条例》第八十四条“未按规定与客户签订业务合同”的规定,被中国证监会立案调查。

对上述股票投资决策程序的说明:本基金管理人在投资海通证券前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库,由研究员跟踪并分析。上述事件发生后,本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

除上述股票外,本基金投资的其余前九名证券的发行主体本期未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	1,674,767.77
2	应收证券清算款	19,199,067.60
3	应收股利	-
4	应收利息	2,439,792.60
5	应收申购款	596,012.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,909,640.10

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	714,772,343.67
报告期基金总申购份额	18,417,717.33
减:报告期基金总赎回份额	45,660,621.80
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	687,529,439.20

§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中国优势证券投资基金设立的文件;

2、《上投摩根中国优势证券投资基金基金合同》;

3、《上投摩根中国优势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

上投摩根中小盘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	上投摩根中小盘混合
基金主代码	379010
交易代码	379010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年1月21日
报告期末基金份额总额	255,384,083.17份
投资目标	本基金重点投资于中国A股市场上的中小盘股票,通过缜密的资产配置原则和严格的行业个股选择,分享中国经济高速增长给优势中小市值上市公司带来的机遇,并积极运用战略和技术资产配置策略,动态优化投资组合,力求实现基金资产长期稳健增值。
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,运用“自下而上”精选个股与“自上而下”资产配置相结合的投资策略,重点投资于具有行业优势、公司优势和估值优势的中小市值上市公司股票。同时结合市场研判,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	40%×大相中盘指数收益率+40%×大相小盘指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金,预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。
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	81,361,431.18
2.本期利润	159,958,980.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.6252
4.期末基金资产净值	611,493,324.67
5.期末基金份额净值	2.394

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

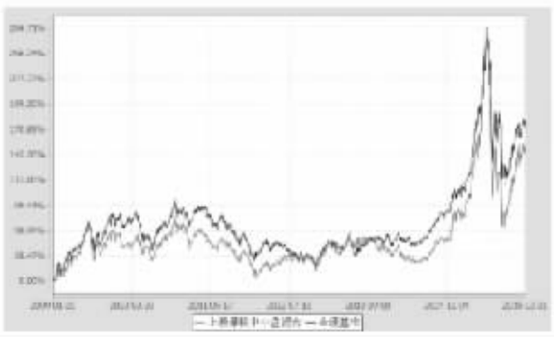
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	35.41%	2.46%	21.36%	1.52%	14.05%	0.94%

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

上投摩根中小盘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

(2009年1月21日至2015年12月31日)



注:本基金合同生效日为2009年1月21日,图示时间段为2009年1月21日至2015年12月31日。本基金建仓期自2009年1月21日至2009年7月20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		
郭晓	本基金基金经理	2015-01-30	-	9年	郭晓先生,自2007年5月至2008年4月在平安资产管理有限公司担任分析师;2008年4月至2009年11月在东吴基金管理有限公司担任研究员;2009年11月至2014年10月在华富基金管理有限公司先后担任基金经理助理、基金经理,自2014年10月起加入上投摩根基金管理有限公司,自2015年1月起担任上投摩根中小盘混合型证券投资基金基金经理,自2015年6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,自2015年8月起同时担任上投摩根新兴服务股票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、《上投摩根中小盘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

市场在国庆节后出现了反弹,整个四季度市场呈现普涨格局,沪深300上涨16.5%,中证500上涨24.4%,创业板上涨30.3%。分行业看,计算机、通信、传媒等行业对基金业绩贡献较大,而银行、食品饮料等行业对业绩有所拖累。4季度本基金在跟踪误差和偏离度等方面都达到了预定目标,较好地跟踪了基准。

展望2016年,实体经济将继续承受降速转型的压力,企业盈利尚难以看到明显好转,但低利率环境有望延续,流动性将推动市场震荡向上。经历了过去两年的上涨,小盘成长股的估值到了相对高位,而随着未来股票发行注册制逐步落实,股票供给逐步增大,对市场整体估值将形成抑制,使得个股表现将出现分化。本基金主要配置与民生改善相关的消费类行业,将持续受益于政策环境的宽松和消费结构的升级。

在投资操作上,本基金仍将采取按照标的指数进行完全复制的策略,力争使跟踪误差最小化。

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18.98%,同期业绩比较基准收益率为16.35%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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,方案已报监管机关。

§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	561,079,478.98	90.41
	其中:股票	561,079,478.98	90.41
2	固定收益投资	24,719,870.90	3.98
	其中:债券	24,719,870.90	3.98
	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	32,341,796.56	5.21
7	其他各项资产	2,439,806.56	0.39
8	合计	620,580,953.00	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	401,650,305.14	65.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	12,120,394.90	1.98
F	批发和零售业	6,695,278.04	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	6,912,000.00	1.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,961,994.00	6.54
J	金融业	-	-
K	房地产业	59,307,539.10	9.70
L	租赁和商务服务业	13,186,866.00	2.16
M	科学研究和技术服务业	5,581,112.80	0.91
N	水利、环境和公共设施管理业	6,192,495.00	1.01
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	9,471,494.00	1.55
	合计	561,079,478.98	91.76

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	256,015	36,034,111.25	5.89
2	300367	东方网力	478,385	33,343,434.50	5.45
3	002494	华斯股份	901,274	23,883,761.00	3.91
4	300310	宜通世纪	371,900	23,180,527.00	3.79
5	002668	奥马电器	278,277	23,180,474.10	3.79
6	600745	中茵股份	503,403	20,629,454.94	3.37
7	600589	广东榕泰	1,031,851	17,324,778.29	2.83
8	002612	朗姿股份	227,151	17,140,814.46	2.80
9	601388	怡球资源	824,701	17,087,804.72	2.79
10	002292	奥飞动漫	324,800	16,795,408.00	2.75

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	4,008,800.00	0.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,711,070.90	3.39
	其中:政策性金融债	20,711,070.90	3.39
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	24,719,870.90	4.04

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	207,090	20,711,070.90	3.39
2	019509	15国债09	40,000	4,008,800.00	0.66

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	700,029.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,271,842.88
5	应收申购款	467,933.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,439,806.56

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002612	朗姿股份	17,140,814.46	2.80	筹划重大事项
2	601388	怡球资源	17,087,804.72	2.79	筹划重大事项

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	253,668,036.82
报告期基金总申购份额	27,204,454.28
减:报告期基金总赎回份额	25,488,407.93
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	255,384,083.17

§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中小盘混合型证券投资基金设立的文件;
2. 《上投摩根中小盘混合型证券投资基金合同》;
3. 《上投摩根中小盘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

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金

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	上投摩根中证消费服务指数
基金主代码	370023
交易代码	370023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月25日
报告期末基金份额总额	15,717,927.32份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,以实现对中证消费服务领先指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用完全复制策略,按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化对投资组合进行动态调整,但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时,本基金将运用其他方法建立实际组合,力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。
业绩比较基准	95%×中证消费服务领先指数收益率+5%×税后银行活期存款收益率
风险收益特征	本基金为指数型基金,长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金等,为高风险、高收益产品。
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