上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

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：二〇一六年三月三十日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年7月9日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	上投摩根科技前沿混合
基金主代码	001538
交易代码	001538
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月9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
报告期末基金份额总额	114,279,404.77份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	采用定量及定性研究方法，自下而上优选科技前沿主题上市公司，通过严格的风险控制，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过系统和深入的基本面研究，密切关注处于科技前沿、通过高精尖科学技术为经济发展带来新增长点的相关行业及公司，重点投资于科技前沿主题相关行业的上市公司，分享中国经济增长模式转变带来的投资机会。 在行业配置层面，本基金将从行业生命周期、行业景气度、行业竞争格局等多角度，综合评估各个行业的投资价值，对基金资产在行业间分配进行安排。 在个股选择层面，本基金将主要采用"自下而上"的方法，在备选行业内部通过定量与定性相结合的分析方法，综合分析上市公司的业绩质量、成长性和估值水平等，精选具有良好成长性、估值合理的个股。
业绩比较基准	中证800指数收益率*60%+中债总指数收益率*40%
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高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险收益水平的基金产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上投摩根基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡迪	王永民
	联系电话	021-38794888	010-66594896
	电子邮箱	services@cifm.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-889-4888	95566
传真		021-20628400	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cifm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年7月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日
本期已实现收益	28,064,221.04
本期利润	28,218,553.82
加权平均基金份额本期利润	0.1470
本期基金份额净值增长率	15.90%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.1591
期末基金资产净值	132,464,497.26
期末基金份额净值	1.159

注：1. 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。

2. 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

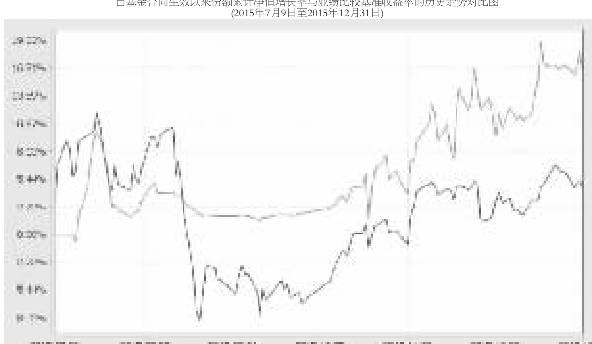
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	13.52%	1.63%	12.20%	1.03%	1.32%	0.60%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	15.90%	1.34%	4.59%	1.57%	11.31%	-0.23%

注：本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率*60%+中债总指数收益率*40%

3.2.2自基金合同生效以来基金份额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

上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金
自基金合同生效以来份额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
(2015年7月9日至2015年12月31日)

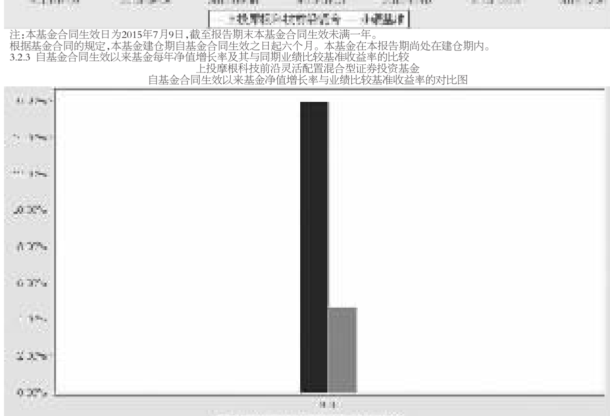


注：本基金合同生效日为2015年7月9日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

根据基金合同的规定，本基金建仓期自基金合同生效之日起六个月。本基金在本报告期期末尚处在建仓期内。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于2015年7月9日正式成立，图示的时间段为2015年7月9日至2015年12月31日。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于2004年5月12日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007年10月8日更名为"上海国际信托有限公司"）与摩根资产管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为2.5亿元人民币，注册地上海。截至2015年12月底，公司管理的基金共有四十七只，均为开放式基金，分别是：上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根阿尔法混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋混合型证券投资基金、上投摩根内需动力混合型证券投资基金、上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘混合型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金、上投摩根分红添利债券型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选混合型证券投资基金、上投摩根轮动添利债券型证券投资基金、上投摩根智选30混合型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金、上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金、上投摩根红利回报混合型证券投资基金、上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根优信增利债券型证券投资基金、上投摩根现金管理货币市场基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添盈货币市场基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根纯债添利债券型证券投资基金、上投摩根稳进回报混合型证券投资基金、上投摩根安全战略股票型证券投资基金、上投摩根卓越制造股票型证券投资基金、上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置证券投资基金、上投摩根智慧互联股票型证券投资基金、上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根新兴服务股票型证券投资基金、上投摩根医疗健康股票型证券投资基金和上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李博	本基金基金经理	2015-08-24	-	7年	李博先生，上海交通大学硕士，自2009年3月至2010年10月在中银国际证券有限公司是担任研究员，负责研究方面的工作，自2010年11月起加入上投摩根基金管理有限公司，担任基金经理助理兼行业专家一职，自2014年12月起担任上投摩根核心成长股票型证券投资基金基金经理，自2015年8月起担任上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2015年9月起同时担任上投摩根阿尔法混合型证券投资基金基金经理。
蔡晟	本基金基金经理	2015-7-9	2015-9-25	7年	蔡晟先生自2008年7月至2011年3月在华安基金管理有限公司先后担任助理研究员、研究员及高级研究员；2011年5月至2012年7月在国投瑞银基金管理有限公司任高级研究员；2012年8月至2014年8月在平安养老保险股份有限公司担任权益投资经理，自2014年9月起加入上投摩根基金管理有限公司，自2014年10月至2015年9月担任上投摩根阿尔法混合型证券投资基金基金经理，自2015年4月至2015年9月同时担任上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2015年7月至2015年9月同时担任上投摩根科技前沿灵活配置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.蔡晟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。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根科技前沿灵活配置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。

本报告期内中国证监会上海监管局对公司进行了常规全面现场检查，就公司内部控制提出了相应改进意见并采取责令改正的行政监管措施，公司已经按照要求完成了改进工作。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求，制订了《上投摩根基金管理有限公司公平交易制度》，规范了公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动，同时涵盖了授权、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各个环节，以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

公司执行自上而下的三级授权体系，依次为投资决策委员会、投资总监、经理人，经理人在其授权范围内自主决策，投资决策委员会和投资总监均不得干预其授权范围内的投资活动。公司已建立客观的研究方法，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。对于交易所市场投资活动，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机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易室询价机制，严格防范交易对手风险并抽检价格公允性；对于一级市场申购投资行为，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。

公司制订了《异常交易监控与报告制度》，通过系统和人工相结合的方式进行投资交易行为的监控分析，并执行异常交易行为监控分析记录工作机制，确保公平交易可稽核。公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查。

4.3.2公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行上述公平交易制度和控制方法，开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的收益率差异、以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易时机和交易价差等方面的监控分析，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

其中，在同向交易的监控和分析方面，根据法规要求，公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控，通过定期抽查前述的同向交易行为，定性分析交易时机、对比不同投资组合长期的交易趋势，重点关注任何可能导致不公平交易的情形。对于识别的异常情况，由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释。同时，公司根据法规的要求，通过系统模块定期对连续四个季度内不同投资组合在不同时间窗内（日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行分析，采用概率统计方法，主要关注不同投资组合之间同向交易价差均值为零的显著性检验，以及同向交易价格占优的交易次数占比分析。

报告期内，通过前述分析方法，未发现不同投资组合之间同向交易价差异常的情况。

4.3.3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、交易方向等的抽样分析，公司未发现存在异常交易行为。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年，市场出现了较大幅度波动，沪深300全年上涨5.6%，振幅却高达68.7%。上半年，A股不断创出反弹新高，但进入6月中旬后，出现了急剧的调整，位于历史新高的创业板领跌，回调幅度超过30%。这次下跌的幅度与速度均历史罕见，我们认为主要与杠杆资金有关。板块方面，计算机、轻工、纺织服装、休闲服务、传媒、通信涨幅居前，除TMT板块外，传统产业转型个股也表现突出。

本基金于2015年7月份成立，在精选个股的同时，三季度重点进行了仓位的控制，在指数暴跌的情况下成功实现了正收益；四季度及时加仓，把握了当季的反弹。

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15.90%，同期业绩比较基准收益率为4.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入2016年，我们判断市场走势以震荡为主，但A股仍然会有结构性的投资机会。我们将继续以精选个股作为首要方向。一方面，重点关注高速增长行业，看好电子、新能源、医药生物等行业；另一方面，在个股选择中，关注行业龙头，或是具有较强竞争优势、成长性高的公司，尤其是拥有新技术、新商业模式的公司。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员，参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未实施利润分配。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在对上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金2015年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所审计、注册会计师陈玲、曹阳签字出具了"无保留意见的审计报告"（编号：普华永道中天审字(2016)第21373号）。投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	31,611,294.68
结算备付金		2,199,895.14
存出保证金		244,272.39
交易性金融资产	7.4.7.2	97,927,089.01
其中：股票投资		97,927,089.01
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		3,189,067.20
应收利息	7.4.7.5	19,346.68
应收股利		-
应收申购款		199,650.18
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		135,390,615.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		1,532,897.18
应付管理人报酬		175,479.67
应付托管费		29,246.60
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	974,791.09
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	213,703.48
负债合计		2,926,118.02
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	114,279,404.77
未分配利润	7.4.7.10	18,185,092.49
所有者权益合计		132,464,497.26
负债和所有者权益总计		135,390,615.28

注：1. 报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.159元，基金份额总额114,279,404.77份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2015年7月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2015年7月9日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年7月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入		32,821,362.53
1.利息收入		506,348.13
其中：存款利息收入	7.4.7.11	506,348.13
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益(损失以"-"填列)		31,615,194.74
其中：股票投资收益	7.4.7.12	31,615,194.74
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	-
3. 公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	154,332.78
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5. 其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	545,486.88
减：二、费用		4,602,808.71
1.管理人报酬		1,455,044.44
2.托管费		242,507.40
3.销售服务费		-
4.交易费用	7.4.7.18	2,685,304.05
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用	7.4.7.19	219,952.82
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		28,218,553.82
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		28,218,553.82

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2015年7月9日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	261,039,332.66	-	261,039,332.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,218,553.82	28,218,553.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-146,759,927.89	-10,033,461.33	-156,793,389.22
其中：1.基金申购款	15,425,452.17	1,251,663.80	16,677,115.97
2.基金赎回款	-162,185,380.06	-11,285,125.13	-173,470,505.19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	114,279,404.77	18,185,092.49	132,464,497.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：章硕麟主管会计工作负责人：胡志强会计机构负责人：张璐

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]第1259号《关于准予上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由上投摩根基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为2015年7月1日至2015年7月7日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集261,016,960.41元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第921号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年7月9日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为261,039,332.66份基金份额，其中认购资金利息折合22,372.25份基金份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的0%-95%，投资于本基金所定义的科技前沿主题相关的证券不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率 × 60%+中债总指数收益率 × 40%。

本财务报表由本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于2016年3月29日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年7月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年7月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2015年7月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易收盘价确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上投摩根基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金销售机构
上海国际信托有限公司("上海信托")	基金管理人的股东
摩根资产管理(英国)有限公司	基金管理人的股东
上信资产管理有限公司	基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司
上海国利货币经纪有限公司	基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司
J.P. Morgan Investment Management Limited	基金管理人的股东摩根资产管理(英国)有限公司控制的公司
J.P. Morgan SCS Investments (GP) Limited	基金管理人的股东摩根资产管理(英国)有限公司控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,455,044.44
其中：支付销售机构的客户维护费	649,795.35

注：支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	242,507.40

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年7月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	31,611,294.68	495,685.95

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002053	云南盐化	2015-11-19	重大事项	25.84	2016-3-14	23.26	114,500.00	3,104,653.38	2,958,680.00	-
300104	乐视网	2015-12-07	重大事项	60.18	-	-	24,700.00	1,388,140.00	1,486,446.00	-

注：本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

无。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为93,481,963.01元，属于第二层次的余额为4,445,126.00元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8投资组合报告

8.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	97,927,089.01	72.33
	其中：股票	97,927,089.01	72.33
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	33,811,189.82	24.97
7	其他各项资产	3,652,336.45	2.70
8	合计	135,390,615.28	100.00

8.2期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	75,282,812.27	56.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,818,380.00	2.13
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	7,188,119.94	5.43
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,003,746.00	3.02
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	7,382,491.80	5.57
S	综合	1,251,539.00	0.94
	合计	97,927,089.01	73.93

8.3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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002475	立讯精密	366,201.00	11,700,121.95	8.83
2	300109	新开源	42,800.00	4,453,340.00	3.36
3	000967	上风高科	164,728.00	4,426,241.36	3.34
4	002273	水晶光电	101,000.00	4,100,600.00	3.10
5	600745	中茵股份	97,700.00	4,003,746.00	3.02
6	002241	歌尔声学	114,300.00	3,954,780.00	2.99
7	002450	康得新	100,200.00	3,817,620.00	2.88
8	300113	顺网科技	37,362.00	3,787,385.94	2.86
9	002668	奥马电器	42,800.00	3,565,240.00	2.69
10	002094	青岛金王	97,300.00	3,030,895.00	2.29

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于http://www.cifm.com网站的年度报告正文。

8.4报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300133	华策影视	19,892,330.81	15.02
2	601599	鹿港科技	17,137,403.91	12.94
3	002292	奥飞动漫	13,462,550.79	10.16
4	300113	顺网科技	12,159,039.72	9.18
5	300059	东方财富	11,872,013.14	8.96
6	002475	立讯精密	11,461,279.91	8.65
7	002104	恒宝股份	11,154,518.60	8.42
8	002273	水晶光电	11,125,238.00	8.40
9	300345	红宇新材	11,088,996.00	8.37
10	300335	迪森股份	11,009,256.59	8.31
11	002717	岭南园林	10,765,862.22	8.13
12	300053	欧比特	10,461,685.00	7.90
13	002241	歌尔声学	9,874,519.62	7.45
14	002668	奥马电器	9,693,403.00	7.32
15	300359	全通教育	9,151,924.00	6.91
16	300017	网宿科技	9,118,732.00	6.88
17	002354	天神娱乐	8,502,482.66	6.42
18	300434	金石东方	8,323,933.40	6.28
19	300022	吉峰农机	8,262,617.13	6.24
20	002343	慈文传媒	8,261,324.44	6.24
21	300251	光线传媒	8,246,960.44	6.23
22	300013	新宁物流	8,216,495.16	6.20
23	300027	华谊兄弟	8,165,170.00	6.16
24	000925	众合科技	8,088,620.05	6.11
25	002502	骅威股份	8,024,935.96	6.06
26	300018	中元华电	8,024,483.30	6.06
27	002290	禾盛新材	7,996,751.34	6.04
28	300078	思创医惠	7,994,709.00	6.04
29	300011	鼎汉技术	7,827,020.00	5.91
30	002472	双环传动	7,823,630.00	5.91
31	300049	福瑞股份	7,785,084.00	5.88
32	300098	高新兴	7,758,058.44	5.86
33	300165	天瑞仪器	7,516,852.98	5.67
34	002325	洪涛股份	7,516,316.25	5.67
35	300144	宋城演艺	7,108,232.46	5.37
36	600358	国旅联合	6,824,972.00	5.15
37	002445	中南重工	6,666,213.61	5.03
38	300024	机器人	6,514,863.26	4.92
39	002189	利达光电	6,356,130.30	4.80
40	603567	珍宝岛	5,803,100.00	4.38
41	300447	全信股份	5,781,364.50	4.36
42	000690	宝新能源	5,754,707.82	4.34
43	000558	莱茵体育	5,740,737.16	4.33
44	300274	阳光电源	5,704,200.64	4.31
45	000802	北京文化	5,700,603.00	4.30
46	603789	星光农机	5,682,861.02	4.29
47	300356	光一科技	5,678,883.00	4.29
48	300014	亿纬锂能	5,677,364.86	4.29
49	002202	金风科技	5,646,733.32	4.26
50	002308	威创股份	5,636,806.36	4.26
51	002175	东方网络	5,572,080.00	4.21
52	002171	楚江新材	5,561,582.28	4.20
53	300020	银江股份	5,557,871.55	4.20
54	600804	鹏博士	5,553,425.98	4.19
55	300365	恒华科技	5,551,106.50	4.19
56	002115	三维通信	5,550,766.44	4.19
57	002236	大华股份	5,486,833.00	4.14
58	000793	华闻传媒	5,460,082.35	4.12
59	002635	安洁科技	5,436,533.23	4.10
60	002450	康得新	5,423,940.00	4.09
61	002466	天齐锂业	5,382,939.56	4.06
62	000901	航天科技	5,362,200.00	4.05
63	300300	汉鼎股份	5,357,990.00	4.04
64	002230	科大讯飞	5,348,991.37	4.04
65	002350	北京科锐	5,336,610.00	4.03
66	600861	北京城乡	5,329,488.55	4.02
67	300125	易世达	5,319,660.31	4.02
68	300193	佳士科技	5,308,284.00	4.01
69	300054	鼎龙股份	5,285,608.00	3.99
70	300458	全志科技	5,284,219.00	3.99
71	300371	汇中股份	5,225,269.70	3.94
72	300151	昌红科技	5,214,744.00	3.94
73	300148	天舟文化	5,213,658.00	3.94
74	300404	博济医药	5,201,234.20	3.93
75	300045	华力创通	5,199,449.58	3.93
76	002271	东方雨虹	5,186,782.00	3.92
77	300086	康芝药业	5,158,980.25	3.89
78	002255	海陆重工	5,141,051.00	3.88
79	002159	三特索道	5,124,662.22	3.87
80	300329	海伦钢琴	5,100,506.00	3.85
81	600331	宏达股份	5,087,392.50	3.84
82	300229	拓尔思	5,020,912.16	3.79
83	002573	清新环境	5,010,402.90	3.78
84	300004	南风股份	4,940,375.02	3.73
85	600801	华新水泥	4,910,593.76	3.71
86	300182	捷成股份	4,833,642.60	3.65
87	600359	新农开发	4,814,802.44	3.63
88	300136	信维通信	4,809,241.88	3.63
89	002339	积成电子	4,753,459.00	3.59
90	002572	索菲亚	4,695,867.51	3.55
91	002657	中科金财	4,535,799.40	3.42
92	002583	海能达	4,447,201.60	3.36
93	000958	东方能源	4,339,752.00	3.28
94	002036	汉麻产业	4,260,144.00	3.22
95	300031	宝通科技	4,230,281.00	3.19
96	300145	南方泵业	4,216,928.00	3.18
97	600388	龙净环保	4,171,743.40	3.15
98	600122	宏图高科	4,167,023.80	3.15
99	300296	利亚德	4,106,812.65	3.10
100	300124	汇川技术	4,081,589.00	3.08
101	000967	上风高科	4,025,050.38	3.04
102	600745	中茵股份	4,021,189.00	3.04
103	601908	京运通	3,975,152.00	3.00
104	300109	新开源	3,974,929.93	3.00
105	600240	华业资本	3,953,917.00	2.98
106	300364	中文在线	3,918,541.00	2.96
107	002429	兆驰股份	3,858,290.95	2.91
108	002222	福晶科技	3,827,832.00	2.89
109	600865	百大集团	3,772,601.50	2.85
110	600270	外运发展	3,766,370.15	2.84
111	002433	太安堂	3,685,172.00	2.78
112	002280	联络互动	3,648,788.00	2.75
113	300070	碧水源	3,644,586.95	2.75
114	002667	鞍重股份	3,543,644.00	2.68
115	600085	同仁堂	3,507,017.40	2.65
116	000049	德赛电池	3,401,810.00	2.57
117	300367	东方网力	3,317,043.47	2.50
118	300232	洲明科技	3,284,907.00	2.48
119	002370	亚太药业	3,279,380.89	2.48
120	002381	双箭股份	3,227,488.00	2.44
121	300033	同花顺	3,155,164.99	2.38
122	002053	云南盐化	3,104,653.38	2.34
123	000526	银润投资	3,101,174.87	2.34
124	002335	科华恒盛	3,084,451.00	2.33
125	600517	置信电气	3,037,095.44	2.29
126	000718	苏宁环球	2,951,774.40	2.23
127	300449	汉邦高科	2,890,990.00	2.18
128	300448	浩云科技	2,885,341.00	2.18
129	300465	高伟达	2,883,337.50	2.18
130	002173	千足珍珠	2,859,750.00	2.16
131	002417	*ST元达	2,817,405.00	2.13
132	300376	易事特	2,787,181.00	2.10
133	300389	艾比森	2,784,673.90	2.10
134	600526	菲达环保	2,761,092.00	2.08
135	300056	三维丝	2,758,346.76	2.08
136	002394	联发股份	2,754,024.23	2.08
137	600292	中电远达	2,752,859.20	2.08
138	002467	二六三	2,747,101.66	2.07
139	002655	共达电声	2,672,078.00	2.02
140	002094	青岛金王	2,669,591.00	2.02
141	000638	万方发展	2,650,371.58	2.00

注："买入金额"（或"买入股票成本"）、"卖出金额"（或"卖出股票收入"）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300133	华策影视	21,959,816.01	16.58
2	601599	鹿港科技	16,677,646.65	12.59
3	002292	奥飞动漫	15,473,417.94	11.68
4	300345	红宇新材	11,892,861.05	8.98
5	300053	欧比特	11,689,760.33	8.82
6	300059	东方财富	11,270,357.22	8.51
7	002104	恒宝股份	10,552,356.02	7.97
8	300335	迪森股份	10,368,670.26	7.83
9	300078	思创医惠	10,100,692.80	7.63
10	002502	骅威股份	9,631,408.60	7.27
11	300017	网宿科技	9,569,316.14	7.22
12	300359	全通教育	9,412,326.50	7.11
13	300022	吉峰农机	9,343,207.60	7.05
14	002290	禾盛新材	9,154,071.08	6.91
15	300113	顺网科技	9,004,747.19	6.80
16	002717	岭南园林	8,741,455.26	6.60
17	300049	福瑞股份	8,705,176.90	6.57
18	000925	众合科技	8,683,677.00	6.56
19	300011	鼎汉技术	8,662,512.44	6.54
20	002354	天神娱乐	8,388,947.90	6.33
21	300027	华谊兄弟	8,227,091.63	6.21
22	300013	新宁物流	8,145,891.10	6.15
23	002472	双环传动	8,084,676.14	6.10
24	300434	金石东方	7,875,498.38	5.95
25	300144	宋城演艺	7,861,351.47	5.93
26	002273	水晶光电	7,723,230.82	5.83
27	300018	中元华电	7,622,425.00	5.75
28	300251	光线传媒	7,601,729.82	5.74
29	002325	洪涛股份	7,594,904.79	5.73
30	300151	昌红科技	7,528,133.50	5.68
31	300165	天瑞仪器	7,324,033.12	5.53
32	002350	北京科锐	6,837,220.95	5.16
33	600358	国旅联合	6,586,237.83	4.97
34	300024	机器人	6,545,381.89	4.94
35	002668	奥马电器	6,515,451.00	4.92
36	300086	康芝药业	6,430,331.02	4.85
37	002241	歌尔声学	6,408,779.03	4.84
38	300045	华力创通	6,388,285.67	4.82
39	002308	威创股份	6,325,483.38	4.78
40	002255	海陆重工	6,282,550.00	4.74
41	300125	易世达	6,267,197.00	4.73
42	300193	佳士科技	6,178,718.60	4.66
43	300274	阳光电源	6,160,049.95	4.65
44	000901	航天科技	6,153,661.50	4.65
45	300300	汉鼎股份	6,108,961.00	4.61
46	002635	安洁科技	6,027,291.75	4.55
47	002343	慈文传媒	6,023,737.80	4.55
48	002202	金风科技	5,968,970.76	4.51
49	600804	鹏博士	5,953,857.70	4.49
50	300404	博济医药	5,867,277.00	4.43
51	600331	宏达股份	5,747,958.79	4.34
52	002236	大华股份	5,730,671.12	4.33
53	603789	星光农机	5,730,466.00	4.33
54	300148	天舟文化	5,685,508.90	4.29
55	600861	北京城乡	5,528,934.65	4.17
56	300054	鼎龙股份	5,527,258.00	4.17
57	002271	东方雨虹	5,461,980.00	4.12
58	000802	北京文化	5,396,508.00	4.07
59	300447	全信股份	5,351,014.00	4.04
60	300365	恒华科技	5,334,816.20	4.03
61	300371	汇中股份	5,325,703.44	4.02
62	002230	科大讯飞	5,315,696.80	4.01
63	300329	海伦钢琴	5,290,435.62	3.99
64	000690	宝新能源	5,289,403.00	3.99
65	603567	珍宝岛	5,179,399.00	3.91
66	300020	银江股份	5,121,520.08	3.87
67	300136	信维通信	5,092,562.40	3.84
68	300182	捷成股份	5,057,136.20	3.82
69	002573	清新环境	5,024,255.62	3.79
70	002339	积成电子	4,825,573.00	3.64
71	002572	索菲亚	4,807,042.60	3.63
72	002175	东方网络	4,805,592.00	3.63
73	300014	亿纬锂能	4,791,358.75	3.62
74	300229	拓尔思	4,789,324.00	3.62
75	300004	南风股份	4,673,794.00	3.53
76	002583	海能达	4,664,515.00	3.52
77	000558	莱茵体育	4,620,889.84	3.49
78	002429	兆驰股份	4,599,388.56	3.47
79	300098	高新兴	4,520,797.61	3.41
80	002159	三特索道	4,434,293.06	3.35
81	002657	中科金财	4,431,299.98	3.35
82	300232	洲明科技	4,425,491.00	3.34
83	002171	楚江新材	4,351,423.85	3.28
84	300296	利亚德	4,323,391.16	3.26
85	601908	京运通	4,317,725.42	3.26
86	300145	南方泵业	4,281,537.77	3.23
87	002466	天齐锂业	4,247,213.89	3.21
88	600359	新农开发	4,217,442.90	3.18
89	300124	汇川技术	4,103,514.04	3.10
90	300356	光一科技	4,088,477.50	3.09
91	002433	太安堂	4,073,357.82	3.08
92	600122	宏图高科	4,011,427.83	3.03
93	600240	华业资本	3,960,819.00	2.99
94	600388	龙净环保	3,950,185.20	2.98
95	002445	中南重工	3,939,665.00	2.97
96	002115	三维通信	3,928,125.99	2.97
97	600865	百大集团	3,857,696.25	2.91
98	300458	全志科技	3,805,571.00	2.87
99	600270	外运发展	3,791,814.05	2.86
100	000958	东方能源	3,734,318.38	2.82
101	600801	华新水泥	3,705,618.94	2.80
102	300070	碧水源	3,671,910.24	2.77
103	000049	德赛电池	3,554,869.00	2.68
104	002381	双箭股份	3,542,610.03	2.67
105	002280	联络互动	3,519,148.00	2.66
106	002189	利达光电	3,479,887.84	2.63
107	600085	同仁堂	3,442,471.20	2.60
108	000718	苏宁环球	3,262,422.16	2.46
109	000638	万方发展	3,192,543.00	2.41
110	300033	同花顺	3,146,782.00	2.38
111	300376	易事特	3,080,842.56	2.33
112	300465	高伟达	3,078,437.00	2.32
113	002335	科华恒盛	3,072,009.56	2.32
114	002370	亚太药业	3,067,738.40	2.32
115	000526	银润投资	3,061,529.00	2.31
116	002417	*ST元达	3,040,460.00	2.30
117	002036	汉麻产业	3,003,515.00	2.27
118	600517	置信电气	2,934,817.60	2.22
119	300369	绿盟科技	2,902,336.65	2.19
120	600884	杉杉股份	2,827,040.88	2.13
121	600756	浪潮软件	2,819,967.46	2.13
122	002394	联发股份	2,799,084.90	2.11
123	002467	二六三	2,757,292.41	2.08
124	300448	浩云科技	2,740,833.00	2.07
125	300449	汉邦高科	2,714,091.50	2.05
126	000793	华闻传媒	2,671,753.00	2.02
127	002222	福晶科技	2,650,050.00	2.00

注："买入金额"（或"买入股票成本"）、"卖出金额"（或"卖出股票收入"）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本(成交)总额	926,449,458.00
卖出股票的收入(成交)总额	860,291,896.51

注："买入金额"（或"买入股票成本"）、"卖出金额"（或"卖出股票收入"）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7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。

8.8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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9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。

8.10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。

8.11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。

8.12投资组合报告附注

8.12.1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。

8.12.2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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	244,272.39
2	应收证券清算款	3,189,067.20
3	应收股利	-
4	应收利息	19,346.68
5	应收申购款	199,650.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,652,336.45

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,346	48,712.45	1,984,366.98	1.74%	112,295,037.79	98.26%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年7月9日)基金份额总额	261,039,332.66
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	15,425,452.17
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	162,185,380.06
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	114,279,404.77

§11 重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

本公司于2015年1月17日发布公告：因个人原因，冯刚先生自2015年1月15日起不再担任本公司副总经理。

本公司于2015年12月2日发布公告：因个人原因，陈星德先生自2015年11月30日起不再担任本公司副总经理。

基金托管人：

2015年4月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所本年度第一次为本基金提供审计服务，报告年度应支付给聘任普华永道中天会计师事务所的报酬为60,000元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人、托管人未受稽查或处罚，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	786,580,816.98	44.02%	723,985.42	43.81%	-
方正证券	1	649,990,013.95	36.38%	605,245.50	36.62%	-
东方证券	1	175,224,609.64	9.81%	163,186.83	9.87%	-
上海证券	1	102,486,228.33	5.74%	94,270.89	5.70%	-
高华证券	1	72,459,685.61	4.06%	65,967.47	3.99%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 交易单元的选择标准：

1）资本金雄厚，信誉良好。

2）财务状况良好，经营行为规范。

3）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度。

4）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。

5）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 交易单元的选择程序：

1）本基金管理人定期召开会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进行评估，确定选用交易单元的券商。

2）本基金管理人与券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

4. 本基金于2015年7月9日正式成立，以上均为本期新增席位，无注销席位。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一六年三月三十日