# 上投摩根成长先锋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:中国建设银行股份有限公司**
**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。

基金托管人中国建设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1月1日起至12月31日止。

本基金的基金名称自2015年7月21日起由上投摩根成长先锋股票型证券投资基金变更为上投摩根成长先锋混合型证券投资基金。该变更不涉及基金份额持有人权利义务关系的变化,亦不涉及投资目标、投资范围和投资策略的变更,对本基金的投资及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 上投摩根成长先锋混合 |
| 基金主代码 | 378010 |
| 交易代码 | 378010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年9月20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 |
| 报告期末基金份额总额 | 882,454,104.24份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金主要投资于国内市场上展现最佳成长特质的股票,积极捕捉高成长性上市公司所带来的投资机会,努力实现基金资产长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 1)股票投资策略<br>本基金采取定量分析与定性分析相结合方式,挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司,主动出击、积极管理将是本基金运作的重要特色。<br>(2)固定收益类投资策略<br>本基金以股票投资为主,一般市场情况下,基金管理人不会积极追求大类资产配置,但为进一步控制投资风险,优化组合流动性管理,本基金将适度防御性资产配置,进行债券、货币市场工具等品种投资。<br>在券种选择上,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金是主动型混合型基金,属于证券投资基金的较高风险品种,预期风险收益水平低于股票型基金,高于债券基金和货币市场基金。 |

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 胡迪 | 田青 |
| | 联系电话 | 021-38794888 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | services@cifm.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-889-4888 | 010-67595096 |
| 传真 | | 021-20628400 | 010-66275853 |

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、基金托管人的办公场所 |

§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 | 2014年 | 2013年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 544,484,764.57 | 25,043,352.62 | 724,812,426.28 |
| 本期利润 | 510,750,619.62 | -304,698,131.43 | 752,288,966.46 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.4565 | -0.1469 | 0.2468 |
| 本期基金份额净值增长率 | 15.39% | -7.31% | 18.32% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015年末 | 2014年末 | 2013年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4781 | 0.2810 | 0.3820 |
| 期末基金资产净值 | 1,304,387,557.46 | 2,057,172,280.75 | 3,627,104,916.73 |
| 期末基金份额净值 | 1.4781 | 1.2810 | 1.3820 |

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,期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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 | 30.10% | 2.14% | 13.66% | 1.34% | 16.44% | 0.80% |
| 过去六个月 | -15.84% | 3.34% | -12.53% | 2.14% | -3.31% | 1.20% |
| 过去一年 | 15.39% | 2.99% | 5.37% | 1.99% | 10.02% | 1.00% |
| 过去三年 | 26.55% | 2.00% | 46.96% | 1.43% | -20.41% | 0.57% |
| 过去五年 | 10.08% | 1.66% | 16.64% | 1.31% | -6.56% | 0.35% |
| 自基金合同生效起至今 | 142.73% | 1.74% | 159.46% | 1.56% | -16.73% | 0.18% |

注:本基金的业绩比较基准于2013年12月7日由原"富时中国A600成长指数×80%+同业存款利率×20%"变更为"沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%"。

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

上投摩根成长先锋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

(2006年9月20日至2015年12月31日)

注:本基金合同生效日为2006年9月20日,图示时间段为2006年9月20日至2015年12月31日。

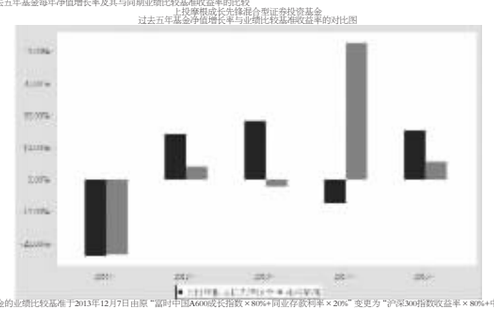
本基金建仓期自2006年9月20日至2007年3月19日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金的业绩比较基准于2013年12月7日由原"富时中国A600成长指数×80%+同业存款利率×20%"变更为"沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%"。

3.2.3 过去五年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

上投摩根成长先锋混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金的业绩比较基准于2013年12月7日由原"富时中国A600成长指数×80%+同业存款利率×20%"变更为"沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%"。

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")、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、上投摩根安心回报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、上投摩根大中华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、上投摩根内需增长混合型证券投资基金、上投摩根强债券型证券投资基金、上投摩根盈利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、上投摩根优势精选混合型证券投资基金、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、上投摩根灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根转型增长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ROE指数证券投资基金、上投摩根天添一年期定期开放债券型证券投资基金、上投摩根罗素宏观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、上投摩根稳健回报混合型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根稳丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根稳盈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、上投摩根卓越新趋势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、上投摩根混合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)及其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 | | |
| 吴文哲 | 本基金基金经理 | 2015-01-09 | - | 12年 | 吴文哲先生,曰2001年7月至2002年7月在招商银行上海分行担任联员,2004年6月至2007年7月在华宏兴业基金管理有限公司担任研究员,2007年7月至2014年1月在交银施罗德基金管理有限公司担任高级研究员,曰2014年1月起加入上投摩根基金管理有限公司,担任研究部副总监兼高级行业专家一职,曰2015年1月起担任上投摩根成长先锋混合型证券投资基金基金经理,曰2015年4月起同时担任上投摩根卓越制造股票型证券投资基金基金经理。 |
| 罗建辉 | 本基金基金经理 | 2013-6-20 | 2015-1-30 | 16年 | 南京大学管理学硕士,1999年7月至2002年9月在东方证券有限责任公司资产管理部从事投资研究工作;2002年10月至2005年5月在金鹰基金管理有限公司从事投资研究工作;2005年5月至2009年7月在华安资产管理有限责任公司从事或长期管理组合的管理工作;2009年7月加入上投摩根基金管理有限公司,主要从事股票市场及上市公司基础及相关产业的研究的工作。2009年10月至2015年1月任上投摩根双核平衡混合型证券投资基金基金经理,2010年12月至2013年8月担任上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金基金经理,2013年6月至2015年1月担任上投摩根成长先锋混合型证券投资基金基金经理,2013年11月至2015年1月担任上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 朱晓龙 | 本基金基金经理助理 | 2015-6-29 | - | 9年 | 清华大学工商管理硕士,2007年7月至2011年8月在平安资产管理有限责任公司担任研究员,2011年8月起加入上投摩根基金管理有限公司,任行业专家。 |

注:1.上述职日期和离任日期均按照公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的年限计算按基金法人管理人员管理办法(证监会令第22号)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、《上投摩根成长先锋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公平交易制度和执行方法

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投票、债券等投资品种的投资管理活动,同时涵盖了投权、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投资决策公平对待。

公司执行日上而下的三级投权体系,依次为投资决策委员会、投资总监、经理人在其投权范围内自主决策,投资决策委员会和投资总监均不得干预其投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,执行公平合理的交易价格,公平交易制度适用于公司管理的所有投资组合,不同投资组合在买卖同一证券品种,相同投资品种公平分配及配售,公司不设置任何例外情况,通过交易对于库存控制和交易实施计划执行、规避冲击成本、提高交易效率等方面的作用,根据市场情况,合理安排交易时间,通过价格优先、比例分配的方式,公平合理地分配投资机会。

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,确保公平交易可追溯性。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,通过定期抽查相关的同向交易行为,定性分析公平交易结果,对比不同投资组合投资决策时间、交易价格等因素的差异情况,对于异常的异常情况,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异情况等宏观层面数据差异检验,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,均发生在短期投资组合与主动管理投资组合之间。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

本报告期本基金份额净值增长率为15.39%,同期业绩比较基准收益率为5.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年我们预期的主旋律更加复杂,宏观经济及货币政策变化较大,在供给端改革的短期下,大宗商品价格出现了探底回升的迹象。如果大宗价格慢慢回升的趋势得到延续,企业可能会重新积累库存,导致流动性从金融市场重回实体经济。对股票市场而言,可能体现为整体估值下移;对实体经济而言,则可能起到稳定增速的作用。2016年经济情况错综复杂,我们会加强对市场的预判,对各类变化做出相应反应。

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。估值委员会成员由公司管理层、督察长、基金会计、风控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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全履职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,发现个别监督指标受市场影响被动超出监管比例,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

托管人复核审查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。

§6 审计报告

上投摩根成长先锋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21331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:上投摩根成长先锋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 | 上年度末 2014年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产: | | - | - |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 126,838,041.97 | 233,642,410.01 |
| 结算备付金 | | 16,663,848.91 | 9,469,499.21 |
| 存出保证金 | | 1,648,224.27 | 1,150,534.25 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 1,097,869,901.32 | 1,805,216,179.03 |
| 其中:股票投资 | | 1,051,229,121.82 | 1,729,077,984.59 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 46,640,779.50 | 76,138,194.44 |
| 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 | | 72,318,572.67 | 25,041,593.23 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 1,631,379.56 | 1,981,962.04 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 13,171.72 | 47,407.18 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,316,983,140.42 | 2,076,549,584.95 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2015年12月31日 | 上年度末 2014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 | | 1,562,597.06 | 9,230,460.59 |
| 应付管理人报酬 | | 1,660,245.51 | 2,804,073.37 |
| 应付托管费 | | 276,707.61 | 467,345.57 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 7,819,288.04 | 5,588,043.63 |
| 应交税费 | | 626,000.00 | 626,000.00 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 650,744.74 | 661,381.04 |
| 负债合计 | | 12,595,582.96 | 19,377,304.20 |
| 所有者权益: | | - | - |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 882,454,104.24 | 1,605,874,695.59 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 421,933,453.22 | 451,297,585.16 |
| 所有者权益合计 | | 1,304,387,557.46 | 2,057,172,280.75 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,316,983,140.42 | 2,076,549,584.95 |

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.4781元,基金份额总额882,454,104.24份。

7.2 利润表

会计主体:上投摩根成长先锋混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2015年1月1日至2015年12月31日 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 585,507,811.07 | -217,682,497.99 |
| 1.利息收入 | | 3,531,005.04 | 6,533,488.97 |
| 其中:存款利息收入 | 7.4.7.11 | 1,404,103.62 | 1,536,192.39 |
| 债券利息收入 | | 1,932,093.56 | 4,716,824.41 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 194,807.86 | 280,472.17 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | 615,513,113.75 | 104,693,917.49 |
| 其中:股票投资收益 | 7.4.7.12 | 608,900,009.39 | 91,130,366.50 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 2,775,009.62 | 421,620.69 |
| 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 | 3,838,094.74 | 13,141,930.30 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 7.4.7.16 | -33,734,144.95 | -329,741,484.05 |
| 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 | 197,837.23 | 831,579.60 |
| 减:二、费用 | | 74,757,191.45 | 87,015,633.44 |
| 1. 管理人报酬 | | 25,975,454.00 | 38,778,678.14 |
| 2. 托管费 | | 4,329,242.38 | 6,463,112.99 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | 44,024,299.84 | 41,243,476.23 |
| 5. 利息支出 | | - | 88,790.87 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | - | 88,790.87 |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.19 | 428,195.23 | 441,575.21 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | 510,750,619.62 | -304,698,131.43 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | 510,750,619.62 | -304,698,131.43 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上投摩根成长先锋混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1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) | 1,605,874,695.59 | 451,297,585.16 | 2,057,172,280.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 510,750,619.62 | 510,750,619.62 |
| 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) | -723,420,591.35 | -540,114,751.56 | -1,263,535,342.91 |
| 其中:1.基金申购款 | 67,570,838.80 | 39,805,185.51 | 107,376,024.31 |
| 2.基金赎回款 | -790,991,430.15 | -579,919,937.07 | -1,370,911,367.22 |
| 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) | 882,454,104.24 | 421,933,453.22 | 1,304,387,557.46 |

| 项目 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014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) | 2,624,575,875.38 | 1,002,529,041.35 | 3,627,104,916.73 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -304,698,131.43 | -304,698,131.43 |
| 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) | -1,018,701,179.79 | -246,533,324.76 | -1,265,234,504.55 |
| 其中:1.基金申购款 | 131,805,894.38 | 25,896,755.16 | 157,702,649.54 |
| 2.基金赎回款 | -1,150,507,074.17 | -272,430,079.92 | -1,422,937,154.09 |
| 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) | 1,605,874,695.59 | 451,297,585.16 | 2,057,172,280.75 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从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:张鹏

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

上投摩根成长先锋混合型证券投资基金(原上投摩根成长先锋股票型证券投资基金,以下简称"本基金")经中国证监会监督管理委员会以下简称"中国证监会")证监基金字2006第182号《关于同意上投摩根成长先锋股票型证券投资基金募集的批复》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《上投摩根成长先锋股票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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币5,480,643,191.07元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第305验资报告予以验证。经中国证监会备案,《上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金合同》于2006年9月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,480,692,618.04份基金份额,其中认购资金利息折合49,426.97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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据2014年中国证监会"关于核准上投摩根阿尔法混合型证券投资基金等基金募集申请的批复"(证监许可[2014]616号)及《上投摩根成长先锋混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金自2014年6月23日公告后更名为上投摩根成长先锋混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根成长先锋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,包括债券(包括发行上市的企业债、公司债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、可转换债券、可分离交易可转换债券(分离交易可转换债券的权证部分应当在基金合同约定的投资品种范围内)、国债期货、中小企业私募债券、证券公司短期公司债券、证券公司发行的次级债券、证券公司发行的普通股、证券公司发行的优先股、证券公司发行的证券衍生品、证券公司发行的证券类资产管理产品、证券公司发行的证券类资产管理产品的收益权、证券公司发行的证券类资产管理产品的次级、劣级、中级、优级、证券公司发行的证券类资产管理产品的次级、劣级、中级、优级的收益权、证券公司发行的证券类资产管理产品的次级、劣级、中级、优级的收益权的收益权、证券公司发行的证券类资产管理产品的次级、劣级、中级、优级的收益权