上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金

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1月1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	上投摩根大盘蓝筹股票
基金主代码	376510
交易代码	376510
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12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	143,560,943.85份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资大盘蓝筹股票，力争最大程度的分享中国经济持续发展带来的中长期收益。在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
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，"自下而上"的精选个股，重点投资于在行业内占有领先地位、业绩良好且稳定增长、价值相对低估的大盘蓝筹上市公司。同时结合宏观经济运行状况和金融市场运行分析趋势的市场研判，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	本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金属于股票型基金产品，在开放式基金中，其预期风险和收益水平高于混合型基金、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。

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	125,261,546.70	39,263,431.03	203,468,074.71
本期利润	81,104,856.39	39,190,312.66	186,388,682.50
加权平均基金份额本期利润	0.4169	0.1343	0.3140
本期基金份额净值增长率	27.82%	18.33%	28.80%
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	0.5759	0.2327	0.0420
期末基金资产净值	226,235,029.51	275,212,229.35	357,413,351.15
期末基金份额净值	1.576	1.233	1.042

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。对期末可供分配利润，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

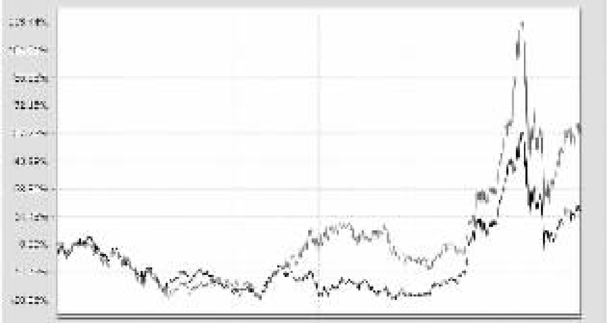
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	18.59%	1.86%	14.30%	1.42%	4.29%	0.44%
过去六个月	-6.08%	2.72%	-13.61%	2.28%	7.53%	0.44%
过去一年	27.82%	2.51%	5.66%	2.11%	22.16%	0.40%
过去三年	94.81%	1.82%	42.77%	1.52%	52.04%	0.30%
过去五年	57.13%	1.57%	19.74%	1.37%	37.39%	0.20%
自基金合同生效起至今	57.60%	1.57%	16.67%	1.36%	40.93%	0.21%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%

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

上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金
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
（2010年12月20日至2015年12月31日）

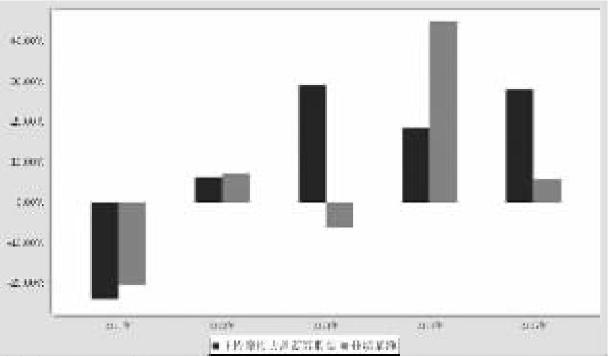


注：本基金建仓期自2010年12月20日至2011年6月19日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金合同生效日为2010年12月20日，图示时间段为2010年12月20日至2015年12月31日。

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

上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金
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：本基金于2010年12月20日正式成立，图示的时间段为2010年12月20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

本基金过去三年来未进行利润分配。

§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混合型证券投资基金、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		
征茂平	本基金基金经理	2013-07-22	-	15年	征茂平先生自2001年3月至2004年3月在上海证大投资管理有限公司任高级研究员从事证券研究的工作；2004年3月至2005年4月在平安证券有限公司任高级研究员从事证券研究的工作；2005年5月至2008年5月在大成基金管理有限公司任研究员从事成长股票组合的管理工作；2008年5月起加入上投摩根基金管理有限公司，担任行业专家兼基金经理助理，自2013年7月起担任上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金基金经理，自2013年9月起同时担任上投摩根红利回报混合型证券投资基金基金经理，2014年1月至2015年2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9月起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。

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。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、《上投摩根大盘蓝筹股票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。

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年国内证券市场跌宕起伏，必将注入中国资本市场史册：在经济持续低迷背景下，上半年市场主题投资活跃、中小板和创业板涨幅一度远超100%，但6月中下旬受清理场外配资引起的被动去杠杆、新股发行加速等负面因素影响，市场快速下跌，最终三季度市场大幅回调，各类投资者损失惨重；在政府持续救市后，四季度证券市场有所回升。上证综指和创业板指数全年分别上涨9.41%、84.41%。

基于判断国内经济将在较长时间内持续低迷，因此2015年上半年本基金组合严格按照基金契约，重点以低估值大盘蓝筹股作为核心品种，同时中长期持有部分业绩增长明确的中小市值优秀公司，并适当参与市场主题投资，以增加组合弹性。从投资结果看，该组合在三季度市场大幅调整时具有较好的防御性，并获得了较好的相对超额收益。在判断四季度市场或将适当反弹后，三季度后期对组合结构进行调整，适当降低大盘蓝筹持股比例、增持了中小板和创业板个股持股比例，取得比较明显的积极效果。尽管本基金全年跑赢业绩比较基准，但整体表现一般，需要认真反思和总结：一是对市场调整的幅度认识不够，没有及时调整，使得组合仓位在三季度市场调整期间维持在高位；二是没有充分认识到国内A股市场由于投资者结构和资金性质有了较为明显的不同，趋势投资和绝对收益投资者比例大幅增加导致市场的风险偏好变化节奏加快。

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27.82%，同期业绩比较基准收益率为5.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

伴随三期叠加和供给侧改革，我们预计国内经济增速未来一段时间内仍将难以明显回升，上市公司整体内生性盈利增速并不乐观，加之创业板上市公司平均市盈率仍处于较高水平，结合未来"供给侧改革"带来的信用风险暴露和人民币汇率波动，我们判断2016年A股市场整体风险偏好大幅回升的可能性不大，这也决定2016年市场上行空间有限。另一方面，考虑到10年期国债收益率水平已经接近2008年金融危机以来的最低水平，加之房地产投资属性逐步弱化，A股市场资金面呈现"结构性"宽松的格局继续存在，因此下行空间有限，2016年国内A股市场或将呈现"指数震荡，结构分化"箱体震荡格局。

我们判断2016年增量资金进入A股市场有限，以存量和获取绝对收益资金博弈为主，结合国内经济基本面因素，本基金将在市场风险偏好下降的背景下优化组合结构、寻找业绩增长比较明确的个股作为组合核心品种，适当配置低估值大盘蓝筹板块；重点关注成长能力持续性较强的电子、医药等板块，并重点关注行业景气持续向上、受益于经济转型的高端装备、环保等行业。

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，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，完全尽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，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

本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

上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金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21355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：上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金
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	1,767,861.85	25,284,451.08
结算备付金		2,268,639.60	1,234,525.17
存出保证金		462,221.39	207,077.44
交易性金融资产	7.4.7.2	221,003,354.85	250,234,332.83
其中：股票投资		209,852,239.85	250,234,332.83
基金投资		-	-
债券投资		11,151,115.00	-
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		3,620,171.12	-
应收利息	7.4.7.5	645,464.21	4,622.45
应收股利		-	-
应收申购款		147,029.69	4,810,463.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		229,914,742.71	281,775,472.19
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		1,617,055.50	4,962,417.25
应付管理人报酬		296,635.72	324,272.80
应付托管费		49,439.30	54,045.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,350,795.05	858,289.50
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	365,787.63	364,217.84
负债合计		3,679,713.20	6,563,242.84
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	143,560,943.85	223,261,908.32
未分配利润	7.4.7.10	82,674,085.66	51,950,321.03
所有者权益合计		226,235,029.51	275,212,229.35
负债和所有者权益总计		229,914,742.71	281,775,472.19

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.576元，基金份额总额143,560,943.85份。

7.2 利润表

会计主体：上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金
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		97,668,175.78	49,588,515.42
1.利息收入		953,588.31	578,087.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	166,877.48	234,642.05
债券利息收入		785,797.31	310,112.32
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		913.52	33,333.56
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）		140,225,781.42	49,022,053.12
其中：股票投资收益	7.4.7.12	137,273,444.35	47,200,610.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-73,613.62	102,923.20
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	3,025,950.69	1,718,519.48
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	7.4.7.16	-44,156,690.31	-73,118.37
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	645,496.36	61,492.74
减：二、费用		16,563,319.39	10,398,202.76
1.管理人报酬		4,420,869.28	4,282,648.13
2.托管费		736,811.63	713,774.56
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	11,023,595.12	5,017,143.89
5.利息支出		1,790.66	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,790.66	-
6.其他费用	7.4.7.19	380,252.70	384,636.18
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		81,104,856.39	39,190,312.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		81,104,856.39	39,190,312.66

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金
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）	223,261,908.32	51,950,321.03	275,212,229.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	81,104,856.39	81,104,856.39
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）	-79,700,964.47	-50,381,091.76	-130,082,056.23
其中：1.基金申购款	357,146,990.02	199,106,850.01	556,253,840.03
2.基金赎回款	-436,847,954.49	-249,487,941.77	-686,335,896.26
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）	143,560,943.85	82,674,085.66	226,235,029.51

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）	343,009,465.95	14,403,885.20	357,413,351.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,190,312.66	39,190,312.66
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）	-119,747,557.63	-1,643,876.83	-121,391,434.46
其中：1.基金申购款	58,084,573.70	3,152,338.94	61,236,912.64
2.基金赎回款	-177,832,131.33	-4,796,215.77	-182,628,347.10
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）	223,261,908.32	51,950,321.03	275,212,229.35

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

上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金（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"）证监基金字［2010］1245号《关于核准上投摩根大盘蓝筹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《上投摩根大盘蓝筹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1,190,182,910.59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（2010）第408号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金基金合同》于2010年12月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,190,330,307.52份基金份额，其中认购资金利息折合147,396.93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《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根大盘蓝筹股票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。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的80%-95%，债券类资产投资比例为基金资产的0-20%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金投资重点是大盘蓝筹股票，80%以上的股票类资产属于上述投资方向所确定的内容。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根大盘蓝筹股票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年度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年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.4.1 本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

7.4.4.2 本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

除以上会计估计变更外，本基金本报告期所采用的其他会计估计与最近一期年度报告一致。

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

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

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》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，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。自2013年1月1日起，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，暂减按25%计入应纳税所得额。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
中国建设银行股份有限公司（"中国建设银行"）	基金托管人、基金代销机构
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.MorganInvestmentManagementLimited	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.Morgan8CSInvestments（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：下述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
当期发生的基金应支付的管理费	4,420,869.28	4,282,648.13
其中：支付销售机构的客户维护费	1,297,405.34	1,629,476.98

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X1.5%/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
当期发生的基金应支付的托管费	736,811.63	713,774.56

注：支付基金托管人中国建设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X0.25%/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

份额单位：份

项目	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
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	1,280,852.54	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	1,280,852.54	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.89%	-

注：基金管理人上投摩根基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易直销上投摩根基金管理有限公司办理，适用费率为1.00%。

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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,767,861.85	114,391.88	25,284,451.08	207,888.89

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300011	鼎汉技术	15/12/31	重大事项	29.80	16/01/22	26.82	174,500	4,529,011.44	5,200,100.00	
002544	杰赛科技	15/08/31	重大事项	41.36	未知	未知	72,200	2,070,637.66	2,986,192.00	

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201,665,947.85元，属于第二层次的余额为19,337,407.00元，无属于第三层次的余额（2014年12月31日：第一层次239,145,539.90元，第二层次11,088,792.93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和债券，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。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本基金于2015年3月23日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值（附注7.4.5.2），并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

（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（2014年12月31日：同）。

（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	209,852,239.85	91.27
	其中：股票	209,852,239.85	91.27
2	固定收益投资	11,151,115.00	4.85
	其中：债券	11,151,115.00	4.85
	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	4,036,501.45	1.76
7	其他各项资产	4,874,886.41	2.12
8	合计	229,914,742.71	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	1,339,152.00	0.59
C	制造业	101,165,884.33	44.72
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	2,423,810.00	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,159,223.75	0.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,010,544.77	3.54
J	金融业	61,058,280.00	26.99
K	房地产业	30,541,125.00	13.50
L	租赁和商务服务业	2,102,220.00	0.93
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	2,052,000.00	0.91
S	综合	-	-
	合计	209,852,239.85	92.76

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	002236	大华股份	306,152	11,297,008.80	4.99
2	300368	汇金股份	179,000	10,152,880.00	4.49
3	002572	索菲亚	224,933	9,694,612.30	4.29
4	600240	华业资本	482,200	7,257,110.00	3.21
5	601336	新华保险	130,700	6,823,847.00	3.02
6	600745	中茵股份	165,700	6,790,386.00	3.00
7	601169	北京银行	643,200	6,772,896.00	2.99
8	000718	苏宁环球	512,600	6,761,194.00	2.99
9	002292	奥飞动漫	128,000	6,618,880.00	2.93
10	601688	华泰证券	329,200	6,491,824.00	2.87

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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600048	保利地产	99,311,276.43	36.09
2	002241	歌尔声学	90,610,431.54	32.92
3	601166	兴业银行	58,493,691.22	21.25
4	600030	中信证券	55,532,133.16	20.18
5	601336	新华保险	50,908,601.20	18.50
6	000001	平安银行	50,456,024.96	18.33
7	600999	招商证券	47,090,466.44	17.11
8	600000	浦发银行	46,054,145.59	16.73
9	300115	长盈精密	42,796,784.73	15.55
10	601688	华泰证券	42,072,468.04	15.29
11	002081	金螳螂	37,608,618.34	13.67
12	601601	中国太保	37,209,372.92	13.52
13	601628	中国人寿	36,948,999.62	13.43
14	002236	大华股份	36,857,772.09	13.39
15	002104	恒宝股份	35,864,964.37	13.03
16	600837	海通证券	35,728,268.62	12.98
17	600369	西南证券	33,663,155.52	12.23
18	600016	民生银行	33,289,858.59	12.10
19	600036	招商银行	32,064,281.97	11.65
20	601398	工商银行	31,699,917.58	11.52
21	600240	华业资本	31,578,147.95	11.47
22	000024	招商地产	30,750,128.95	11.17
23	601169	北京银行	30,115,440.71	10.94
24	300075	数字政通	28,999,323.10	10.54
25	000958	东方能源	28,768,878.27	10.45
26	601328	交通银行	24,875,368.00	9.04
27	300145	南方泵业	24,403,599.57	8.87
28	600015	华夏银行	24,155,592.87	8.78
29	601988	中国银行	23,952,335.00	8.70
30	600276	恒瑞医药	21,810,071.37	7.92
31	002030	达安基因	21,796,583.74	7.92
32	600587	新华医疗	21,239,459.66	7.72
33	600050	中国联通	21,035,786.90	7.64
34	300011	鼎汉技术	20,978,135.49	7.62
35	000712	锦龙股份	20,954,204.70	7.61
36	601021	春秋航空	20,767,121.84	7.55
37	601998	中信银行	20,558,296.00	7.47
38	601288	农业银行	20,160,737.00	7.33
39	600958	东方证券	18,262,795.68	6.64
40	002475	立讯精密	18,237,831.23	6.63
41	002405	四维图新	18,214,852.12	6.62
42	601318	中国平安	18,117,155.00	6.58
43	600420	现代制药	17,714,531.56	6.44
44	300284	苏交科	17,640,926.30	6.41
45	601788	光大证券	17,418,104.50	6.33
46	000776	广发证券	17,222,986.67	6.26
47	600337	美克家居	16,790,758.79	6.10
48	601009	南京银行	16,662,875.72	6.05
49	000728	国元证券	16,594,621.49	6.03
50	601377	兴业证券	16,239,138.11	5.90
51	300287	飞利信	16,154,969.65	5.87
52	002572	索菲亚	15,892,242.32	5.77
53	600325	华发股份	15,716,344.64	5.71
54	300206	理邦仪器	15,652,248.72	5.69
55	300065	海兰信	15,573,800.64	5.66
56	000002	万科A	15,198,046.58	5.52
57	002077	大港股份	15,184,857.65	5.52
58	601388	怡球资源	14,822,365.50	5.39
59	601818	光大银行	14,509,325.00	5.27
60	002345	潮宏基	14,113,586.54	5.13
61	002244	滨江集团	14,080,300.46	5.12
62	600104	上汽集团	13,995,423.36	5.09
63	600518	康美药业	13,975,518.90	5.08
64	002400	省广股份	13,729,932.32	4.99
65	000810	创维数字	13,652,633.70	4.96
66	601668	中国建筑	13,651,763.00	4.96
67	300063	天龙集团	13,630,237.39	4.95
68	600741	华域汽车	13,406,902.60	4.87
69	300392	腾信股份	13,403,637.91	4.87
70	600466	蓝光发展	13,398,947.56	4.87
71	300168	万达信息	13,342,953.00	4.85
72	002701	奥瑞金	13,205,691.84	4.80
73	600642	申能股份	12,879,251.51	4.68
74	000078	海王生物	12,828,617.00	4.66
75	600501	航天晨光	12,468,696.79	4.53
76	300017	网宿科技	12,364,589.03	4.49
77	601186	中国铁建	12,306,965.10	4.47
78	300072	三聚环保	12,294,482.95	4.47
79	002375	亚厦股份	12,249,453.89	4.45
80	000090	天健集团	12,069,656.34	4.39
81	600705	中航资本	11,761,013.00	4.27
82	002312	三泰控股	11,511,495.76	4.18
83	002657	中科金财	11,429,267.94	4.15
84	600583	海油工程	11,374,443.50	4.13
85	601555	东吴证券	11,255,752.37	4.09
86	002462	嘉事堂	11,240,426.06	4.08
87	000555	神州信息	10,885,287.07	3.96
88	002508	老板电器	10,863,731.68	3.95
89	002447	壹桥海参	10,697,455.96	3.89
90	600887	伊利股份	10,674,110.40	3.88
91	002202	金风科技	10,646,017.80	3.87
92	000948	南天信息	10,392,056.62	3.78
93	002170	芭田股份	10,262,874.02	3.73
94	002465	海格通信	10,224,508.34	3.72
95	600340	华夏幸福	10,002,099.16	3.63
96	002321	华英农业	9,988,889.08	3.63
97	600571	信雅达	9,987,268.00	3.63
98	002063	远光软件	9,939,599.24	3.61
99	002546	新联电子	9,861,320.90	3.58
100	600271	航天信息	9,849,841.14	3.58
101	600011	华能国际	9,732,154.50	3.54
102	300085	银之杰	9,641,035.86	3.50
103	000718	苏宁环球	9,615,493.59	3.49
104	000983	西山煤电	9,479,388.10	3.44
105	000069	华侨城A	9,358,872.12	3.40
106	002736	国信证券	9,317,483.55	3.39
107	300133	华策影视	9,295,939.30	3.38
108	002292	奥飞动漫	9,261,620.96	3.37
109	000523	广州浪奇	8,848,952.72	3.22
110	000902	新洋丰	8,732,883.76	3.17
111	002339	积成电子	8,560,729.20	3.11
112	300274	阳光电源	8,506,674.40	3.09
113	002235	安妮股份	8,319,779.50	3.02
114	600823	世茂股份	8,308,983.50	3.02
115	601006	大秦铁路	8,258,893.76	3.00
116	601058	赛轮金宇	8,257,625.36	3.00
117	600109	国金证券	8,084,282.00	2.94
118	603766	隆鑫通用	8,026,520.38	2.92
119	002518	科士达	8,024,982.06	2.92
120	002152	广电运通	8,018,088.00	2.91
121	000651	格力电器	7,929,713.00	2.88
122	000786	北新建材	7,832,738.44	2.85
123	600138	中青旅	7,823,513.33	2.84
124	000709	河钢股份	7,738,554.60	2.81
125	002353	杰瑞股份	7,733,465.77	2.81
126	000671	阳光城	7,666,037.49	2.79
127	601198	东兴证券	7,502,826.00	2.73
128	001696	宗申动力	7,393,904.50	2.69
129	600028	中国石化	7,198,524.00	2.62
130	600079	人福医药	7,187,224.66	2.61
131	600867	通化东宝	7,172,232.18	2.61
132	600703	三安光电	7,162,355.10	2.60
133	002183	怡亚通	7,111,129.00	2.58
134	300012	华测检测	7,081,387.87	2.57
135	000544	中原环保	6,941,573.00	2.52
136	600745	中茵股份	6,895,520.15	2.51
137	600037	歌华有线	6,842,946.00	2.49
138	002175	东方网络	6,835,448.00	2.48
139	002049	同方国芯	6,830,851.63	2.48
140	002101	广东鸿图	6,827,732.55	2.48
141	601699	潞安环能	6,825,899.81	2.48
142	300295	三六五网	6,765,678.10	2.46
143	002073	软控股份	6,759,686.47	2.46
144	000657	中钨高新	6,741,359.84	2.45
145	300345	红宇新材	6,731,374.22	2.45
146	002089	新海宜	6,719,255.41	2.44
147	300182	捷成股份	6,673,053.30	2.42
148	002208	合肥城建	6,651,849.69	2.42
149	002466	天齐锂业	6,613,086.68	2.40
150	300178	腾邦国际	6,613,035.00	2.40
151	600198	大唐电信	6,517,366.98	2.37
152	300013	新宁物流	6,493,553.00	2.36
153	600570	恒生电子	6,467,468.00	2.35
154	000333	美的集团	6,450,896.00	2.34
155	600280	中央商场	6,421,981.95	2.33
156	300020	银江股份	6,389,771.04	2.32
157	002673	西部证券	6,385,186.00	2.32
158	002154	报喜鸟	6,340,956.00	2.30
159	300101	振芯科技	6,327,703.56	2.30
160	600585	海螺水泥	6,309,143.00	2.29
161	600358	国旅联合	6,267,915.86	2.28
162	600153	建发股份	6,242,849.91	2.27
163	000488	晨鸣纸业	6,212,245.65	2.26
164	000061	农产品	6,109,071.00	2.22
165	600804	鹏博士	6,086,895.00	2.21
166	002668	奥马电器	6,056,415.00	2.20
167	000028	国药一致	6,030,163.00	2.19
168	002450	康得新	6,000,319.76	2.18
169	000638	万方发展	5,968,623.71	2.17
170	002612	朗姿股份	5,965,454.90	2.17
171	300166	东方国信	5,949,717.50	2.16
172	300368	汇金股份	5,919,875.00	2.15
173	000987	广州友谊	5,898,541.00	2.14
174	002681	奋达科技	5,846,199.24	2.12
175	002327	富安娜	5,833,971.56	2.12
176	603128	华贸物流	5,805,662.08	2.11
177	600008	首创股份	5,800,993.65	2.11
178	300016	北陆药业	5,784,689.00	2.10
179	600066	宇通客车	5,755,856.00	2.09
180	002020	京新药业	5,745,329.04	2.09
181	600536	中国软件	5,649,894.00	2.05
182	002090	金智科技	5,642,929.00	2.05
183	601919	中国远洋	5,599,330.00	2.03
184	002171	楚江新材	5,598,867.21	2.03
185	000802	北京文化	5,596,807.00	2.03
186	600730	中国高科	5,581,776.77	2.03
187	000008	神州高铁	5,521,100.60	2.01
188	000402	金融街	5,505,917.64	2.00
189	600203	福日电子	5,505,306.10	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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600048	保利地产	119,134,420.79	43.29
2	002241	歌尔声学	85,583,322.64	31.10
3	600000	浦发银行	58,947,721.48	21.42
4	600030	中信证券	58,395,020.94	21.22
5	000001	平安银行	56,050,357.22	20.37
6	601166	兴业银行	52,035,792.70	18.91
7	000024	招商地产	51,119,113.21	18.57
8	601628	中国人寿	48,451,930.64	17.61
9	600016	民生银行	46,943,471.73	17.06
10	300115	长盈精密	46,001,178.43	16.71
11	601336	新华保险	45,532,170.76	16.54
12	601601	中国太保	42,893,008.16	15.59
13	002081	金螳螂	41,293,061.90	15.00
14	600999	招商证券	40,460,952.87	14.70
15	002104	恒宝股份	40,396,705.02	14.68
16	600837	海通证券	37,088,179.86	13.48
17	601318	中国平安	35,554,160.35	12.92
18	601688	华泰证券	35,267,057.34	12.81
19	600036	招商银行	31,255,954.43	11.36
20	601328	交通银行	30,545,932.12	11.10
21	600369	西南证券	29,843,933.21	10.84
22	601398	工商银行	29,742,087.98	10.81
23	300063	天龙集团	29,345,549.34	10.66
24	000712	锦龙股份	28,077,675.43	10.20
25	300075	数字政通	26,699,193.09	9.70
26	000002	万科A	26,574,132.51	9.66
27	300145	南方泵业	26,211,560.28	9.52
28	601988	中国银行	26,211,417.50	9.52
29	000958	东方能源	26,110,982.50	9.49
30	002236	大华股份	24,977,990.92	9.08
31	600240	华业资本	24,592,985.08	8.94
32	600015	华夏银行	23,423,531.11	8.51
33	600571	信雅达	23,198,350.00	8.43
34	601021	春秋航空	22,440,490.48	8.15
35	600276	恒瑞医药	21,960,724.00	7.98
36	601169	北京银行	21,661,031.86	7.87
37	600337	美克家居	21,404,282.91	7.78
38	600587	新华医疗	21,203,775.47	7.70
39	601818	光大银行	20,702,023.22	7.52
40	002030	达安基因	20,699,489.75	7.52
41	600958	东方证券	20,269,463.09	7.37
42	601788	光大证券	19,741,439.78	7.17
43	002475	立讯精密	19,551,096.29	7.10
44	601288	农业银行	18,851,089.00	6.85
45	600050	中国联通	18,825,208.52	6.84
46	600104	上汽集团	18,455,843.07	6.71
47	002405	四维图新	18,380,678.46	6.68
48	601998	中信银行	18,332,241.03	6.66
49	002077	大港股份	17,971,482.99	6.53
50	300287	飞利信	17,958,621.31	6.53
51	300206	理邦仪器	17,781,144.42	6.46
52	600804	鹏博士	17,653,660.15	6.41
53	300065	海兰信	17,557,735.65	6.38
54	000810	创维数字	17,331,990.20	6.30
55	600420	现代制药	17,272,957.70	6.28
56	000555	神州信息	17,256,458.00	6.27
57	600887	伊利股份	17,119,426.44	6.22
58	300284	苏交科	17,031,914.89	6.19
59	601555	东吴证券	16,900,406.88	6.14
60	000776	广发证券	16,879,837.81	6.13
61	300011	鼎汉技术	16,827,011.73	6.11
62	601009	南京银行	16,793,337.89	6.10
63	600741	华域汽车	16,270,677.50	5.91
64	601377	兴业证券	14,688,945.86	5.34
65	600518	康美药业	14,404,787.67	5.23
66	002400	省广股份	13,703,493.81	4.98
67	600642	申能股份	13,643,652.00	4.96
68	002657	中科金财	13,473,415.80	4.90
69	300072	三聚环保	13,446,752.00	4.89
70	002312	三泰控股	13,445,848.10	4.89
71	601668	中国建筑	13,272,385.00	4.82
72	300392	腾信股份	13,128,540.00	4.77
73	002462	嘉事堂	13,044,697.73	4.74
74	002701	奥瑞金	12,941,176.19	4.70
75	300017	网宿科技	12,800,024.49	4.65
76	002546	新联电子	12,637,808.00	4.59
77	000078	海王生物	12,637,351.91	4.59
78	300168	万达信息	12,446,894.93	4.52
79	600583	海油工程	12,403,926.50	4.51
80	600466	蓝光发展	12,254,054.69	4.45
81	000728	国元证券	12,075,709.04	4.39
82	002345	潮宏基	12,042,278.94	4.38
83	600325	华发股份	11,906,391.71	4.33
84	601186	中国铁建	11,678,085.00	4.24
85	002244	滨江集团	11,410,158.06	4.15
86	002321	华英农业	11,337,631.34	4.12
87	601388	怡球资源	11,118,853.50	4.04
88	000651	格力电器	10,978,142.20	3.99
89	601006	大秦铁路	10,769,251.46	3.91
90	002375	亚厦股份	10,613,651.42	3.86
91	600271	航天信息	10,601,624.48	3.85
92	000090	天健集团	10,431,327.54	3.79
93	601633	长城汽车	10,364,761.48	3.77
94	002235	安妮股份	10,218,679.80	3.71
95	600340	华夏幸福	10,048,146.47	3.65
96	000983	西山煤电	10,002,527.22	3.63
97	000638	万方发展	9,892,906.00	3.59
98	002063	远光软件	9,605,476.18	3.49
99	002465	海格通信	9,571,828.62	3.48
100	000523	广州浪奇	9,466,955.00	3.44
101	603766	隆鑫通用	9,456,726.49	3.44
102	300020	银江股份	9,444,170.00	3.43
103	000069	华侨城A	9,166,427.62	3.33
104	601058	赛轮金宇	9,106,515.96	3.31
105	002175	东方网络	9,045,000.00	3.29
106	300133	华策影视	8,915,995.95	3.24
107	002202	金风科技	8,834,089.49	3.21
108	600730	中国高科	8,830,335.07	3.21
109	002353	杰瑞股份	8,805,506.12	3.20
110	300101	振芯科技	8,681,619.00	3.15
111	002271	东方雨虹	8,624,540.63	3.13
112	000948	南天信息	8,545,133.58	3.10
113	300012	华测检测	8,510,106.94	3.09
114	300085	银之杰	8,495,074.30	3.09
115	002339	积成电子	8,452,371.12	3.07
116	002447	壹桥海参	8,396,461.90	3.05
117	600011	华能国际	8,334,648.00	3.03
118	600138	中青旅	8,317,133.12	3.02
119	600109	国金证券	8,299,107.00	3.02
120	002089	新海宜	8,289,561.59	3.01
121	002154	报喜鸟	8,226,450.16	2.99
122	600501	航天晨光	8,191,519.80	2.98
123	600823	世茂股份	8,190,402.00	2.98
124	600867	通化东宝	7,979,215.57	2.90
125	000671	阳光城	7,966,852.04	2.89
126	002466	天齐锂业	7,814,355.79	2.84
127	600705	中航资本	7,771,417.00	2.82
128	002170	芭田股份	7,650,405.00	2.78
129	000402	金融街	7,616,744.15	2.77
130	601699	潞安环能	7,586,859.19	2.76
131	002101	广东鸿图	7,530,558.47	2.74
132	601198	东兴证券	7,517,977.00	2.73
133	002508	老板电器	7,501,865.01	2.73
134	000061	农产品	7,497,513.25	2.72
135	001696	宗申动力	7,484,317.70	2.72
136	002572	索菲亚	7,478,125.79	2.72
137	600519	贵州茅台	7,475,076.22	2.72
138	600079	人福医药	7,472,008.33	2.71
139	002152	广电运通	7,340,086.31	2.67
140	600570	恒生电子	7,328,829.00	2.66
141	000902	新洋丰	7,328,687.84	2.66
142	000488	晨鸣纸业	7,284,879.78	2.65
143	000786	北新建材	7,218,927.00	2.62
144	300182	捷成股份	7,147,385.89	2.60
145	300274	阳光电源	7,067,696.96	2.57
146	002276	万马股份	7,049,673.66	2.56
147	002325	洪涛股份	7,025,618.87	2.55
148	300004	南风股份	6,957,899.18	2.53
149	002673	西部证券	6,928,537.04	2.52
150	600280	中央商场	6,922,500.00	2.52
151	600703	三安光电	6,906,611.68	2.51
152	002668	奥马电器	6,880,103.22	2.50
153	300178	腾邦国际	6,721,652.90	2.44
154	600585	海螺水泥	6,627,025.54	2.41
155	300345	红宇新材	6,620,485.78	2.41
156	600037	歌华有线	6,558,917.50	2.38
157	600153	建发股份	6,517,219.34	2.37
158	601669	中国电建	6,473,105.00	2.35
159	002518	科士达	6,453,332.84	2.34
160	002020	京新药业	6,420,594.99	2.33
161	600028	中国石化	6,413,555.00	2.33
162	002331	皖通科技	6,388,269.14	2.32
163	000657	中钨高新	6,338,337.62	2.30
164	000333	美的集团	6,298,713.38	2.29
165	000625	长安汽车	6,296,768.17	2.29
166	603128	华贸物流	6,289,752.17	2.29
167	002073	软控股份	6,287,762.00	2.28
168	002208	合肥城建	6,286,472.31	2.28
169	002327	富安娜	6,083,770.43	2.21
170	000987	广州友谊	6,022,879.00	2.19
171	300016	北陆药业	6,008,560.00	2.18
172	000544	中原环保	5,988,670.39	2.18
173	000596	古井贡酒	5,958,792.00	2.17
174	300295	三六五网	5,910,756.28	2.15
175	300013	新宁物流	5,908,104.29	2.15
176	002612	朗姿股份	5,883,988.84	2.14
177	002681	奋达科技	5,784,236.67	2.10
178	000975	银泰资源	5,777,082.72	2.10
179	300166	东方国信	5,735,761.61	2.08
180	600066	宇通客车	5,656,196.82	2.06
181	000028	国药一致	5,639,901.50	2.05
182	002450	康得新	5,628,570.01	2.05

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	3,533,576,874.25
卖出股票的收入（成交）总额	3,667,376,362.75

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,151,115.00	4.93
	其中：政策性金融债	11,151,115.00	4.93
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	11,151,115.00	4.93

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018001	国开1301	111,500	11,151,115.00	4.93

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本基金投资的华泰证券股份有限公司（以下简称"华泰证券"，股票代码601688）于2015年9月10日收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》（处罚字［2015］72号）。华泰证券对于外部接入的第三方交易终端软件，未进行软件认证许可，未对外部系统接入实施有效管理，对相关客户身份情况缺乏了解。对上述客户，华泰证券未按要求采集客户交易终端信息，未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性，未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。华泰证券的上述行为违反了《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条，《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定。依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项的规定，中国证券监督管理委员会拟决定：一、对华泰证券责令改正，给予警告，没收违法所得18,235,275.00元，并处以54,705,825.00元罚款；二、对相关责任人给予警告，并处以10万元罚款。

对上述股票投资决策程序的说明：本基金管理人在投资华泰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。

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	462,221.39
2	应收证券清算款	3,620,171.12
3	应收股利	-
4	应收利息	645,464.21
5	应收申购款	147,029.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,874,886.41

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

本基金本报告期末前十名股票无流通受限情况。

8.12.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

§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
6,637	21,630.40	4,657,650.84	3.24%	138,903,293.01	96.76%

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	125,734.44	0.0876%

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	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年12月20日）基金份额总额	1,190,330,307.52
本报告期期初基金份额总额	223,261,908.32
本报告期基金总申购份额	357,146,990.02
减：本报告期基金总赎回份额	436,847,954.49
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	143,560,943.85

§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：

本基金托管人2015年1月4日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人2015年9月18日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

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

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。报告年度应支付给聘任普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为60,000元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为5年。

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	
上海证券	1	2,546,076,018.63	35.36%	2,340,685.02	35.45%	-
广发证券	1	1,828,778,652.68	25.40%	1,679,682.09	25.44%	-
海通证券	1	1,367,804,995.09	18.99%	1,245,246.42	18.86%	-
招商证券	1	1,143,521,051.41	15.88%	1,043,144.02	15.80%	-
华创证券	1	314,772,519.19	4.37%	293,148.65	4.44%	-

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. 2015年度本基金新增华创证券1个席位，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
上海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	15,397,591.30	44.35%	25,700,000.00	46.14%	-	-
海通证券	15,292,690.20	44.05%	30,000,000.00	53.86%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	4,028,400.00	11.60%	-	-	-	-

§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