# 上投摩根天颐年丰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 | 上投摩根天颐年丰混合 |
| 基金主代码 | 000125 |
| 交易代码 | 000125 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年7月18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 | 1,811,992,140.21份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在有效控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值,力争为投资者提供稳定的现金分红。 |
| 投资策略 | 1、资产配置策略:本基金管理人将采用严格的仓位控制策略,根据基金单位净值的变化和对未来市场的判断,灵活控制股票仓位,控制下行风险。具体而言,本基金将以每一个会计年度作为仓位控制策略执行的周期,即:以上一年度年末的基金单位净值作为基准,根据基金当前净值与本年度单位累计分红金额之和确定股票仓位上限。<br>2、债券投资策略:本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下,根据对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪,结合不同债券品种的到期收益率、流动性、市场规模等情况,灵活运用久期策略、期限结构配置策略、信用债策略、可转债策略等多种投资策略,实施积极主动的组合管理,并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测,对债券组合进行动态调整。<br>3、股票投资策略:本基金将采用自下而上的分析方法,以企业基本面研究为核心,并结合股票价值评估,精选具有较强竞争优势且估值合理的股票构建投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 一年期银行定期存款利率(税后)+1% |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金产品,预期风险和收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于中等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7月18日(基金合同生效日)至2013年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 132,580,470.91 | 11,507,215.42 | 1,948,666.65 |
| 本期利润 | 136,823,376.83 | 15,271,265.85 | -238,371.33 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0550 | 0.1071 | -0.0006 |
| 本期基金份额净值增长率 | 7.58% | 19.07% | -0.30% |
| 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 | 0.0297 | 0.1162 | -0.0027 |
| 期末基金资产净值 | 1,865,850,620.55 | 48,493,827.09 | 299,550,650.81 |
| 期末基金份额净值 | 1.030 | 1.140 | 0.997 |

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

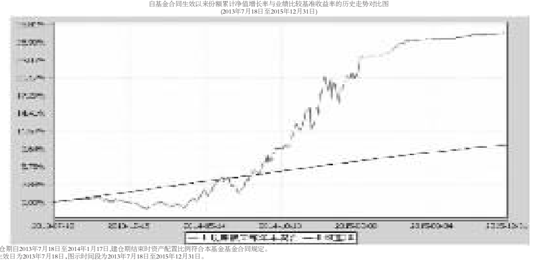
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.78% | 0.05% | 0.65% | 0.01% | 0.13% | 0.04% |
| 过去六个月 | 1.17% | 0.04% | 1.40% | 0.01% | -0.23% | 0.03% |
| 过去一年 | 7.58% | 0.29% | 3.16% | 0.01% | 4.42% | 0.28% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 27.71% | 0.29% | 9.04% | 0.01% | 18.67% | 0.28% |

注:本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)+1%

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

上投摩根天颐年丰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
(2013年7月18日至2015年12月31日)

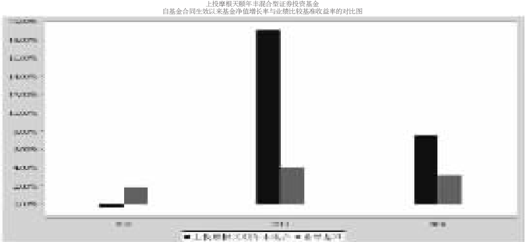


注:本基金建仓期自2013年7月18日至2014年1月17日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金合同生效日为2013年7月18日,图示时间段为2013年7月18日至2015年12月31日。

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

上投摩根天颐年丰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2013年7月18日正式成立,图示的时间段为2013年7月18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

单位:人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2015 | 1.890 | 224,693,562.58 | 182,268,739.18 | 406,962,301.76 | - |
| 2014 | 0.420 | 3,564,231.51 | 393,951.51 | 3,958,183.02 | - |
| 合计 | 2.310 | 228,257,794.09 | 182,662,690.69 | 410,920,484.78 | - |

### §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 | | |
| 聂曙光 | 本基金基金经理 | 2015-04-22 | - | 7年 | 聂曙光先生自2004年8月至2006年3月在南京银行任债券分析师;2006年3月至2009年9月在兴业银行任债券投资经理;2009年9月至2014年5月在中欧基金管理有限公司先后担任研究员、基金经理助理、基金经理、固定收益部总监、固定收益事业部临时负责人等职务,自2014年5月起加入上投摩根基金管理有限公司,自2014年8月起担任上投摩根纯债债券型证券投资基金基金经理,自2014年10月起担任上投摩根红利回报混合型证券投资基金基金经理,自2014年11月起担任上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金基金经理,自2015年1月起同时担任上投摩根稳进回报混合型证券投资基金基金经理,自2015年4月起同时担任上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金经理。 |
| 杨成 | 本基金基金经理 | 2013-07-18 | 2015-04-22 | 8年 | 上海财经大学管理学硕士研究生。2007年至2010年期间任信诚基金管理有限公司固定收益分析师。2010年2月起加入上投摩根基金管理有限公司,任基金经理助理,主要负责固定收益方面投资研究的相关工作。2011年8月至2015年4月任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理,2013年2月至2014年3月担任上投摩根轮动添利债券型证券投资基金基金经理,2013年7月至2015年4月担任上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金经理,2013年12月至2015年4月同时担任上投摩根双债增利债券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.杨成先生为本基金首任基金经理,其任职日期指本基金基金合同生效之日。

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对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、《上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金合同》的规定。除以下情况外,基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求:本基金曾出现个别由于市场原因引起的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形,但已在规定时间内调整完毕。

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,未发现利益输送的异常情况。

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上半年宏观经济继续面临向下压力,物价水平保持低迷。实体经济不振迫使货币政策保持宽松,继去年四季度不对称降息之后,央行进一步引导回购利率下行,并继续实施降准、降息等较宽松的货币政策,推动社会融资成本下行。在新增资金的买盘推动下,股票市场在上半年仍维持强势上涨势头,结构性估值过高问题日益突出,六月中下旬之后,股票市场开始大幅回调。上半年新股发行节奏稳步加快,新股上市后股价大幅上涨。本基金从二季度开始降低了二级市场股票和债券仓位,重点关注风险较低的新股投资机会。三季度通胀水平呈现小幅回升趋势,但经济增长水平却未如期企稳反弹,出口、投资、工业增加值、采购经理人指数等诸多经济指标继续下行,显示经济进一步下滑压力仍加大,与此同时,因担忧全球需求偏弱,能源原材料等大宗商品价格出现大幅下挫。股票市场在三季度出现大幅波动,前期狂热的氛围出现急剧转向;债券市场在经济基本面、货币政策等因素推动下继续上涨,信用利差不断压缩,市场乐观情绪明显占据上风,将利率水平和信用利差推至历史低位水平。三季度末基金在新股发行暂停后采取了偏保守的投资策略,降低了权益仓位以控制回撤,并维持较高的组合流动性。四季度权益市场逐步企稳,本基金在新股发行重启后重点参与了新股的投资机会,并维持较高的组合流动性。

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7.58%,同期业绩比较基准收益率为3.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年,经济增长压力仍在。中央提出的"供给侧改革"意味着未来产能出清依然为重要目标,因而未来经济可能继续维持L型走势。本基金在下一阶段将稳健操作,注重控制回撤风险。控制股票仓位,加大低风险的固定收益资产投资力度,加大新股投资力度,同时加大对债券信用风险的甄别与管理。

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

根据基金实际运作情况,本基金以2014年12月31日为收益分配基准日,于2015年01月15日实施收益分配,每10份基金份额派发红利0.600元,合计发放红利2,461,580.20元;本基金以2015年03月31日为收益分配基准日,于2015年04月13日实施收益分配,每10份基金份额派发红利0.620元,合计发放红利205,076,020.36元;本基金以2015年06月30日为收益分配基准日,于2015年07月10日实施收益分配,每10份基金份额派发红利0.430元,合计发放红利162,026,536.70元;本基金以2015年09月30日为收益分配基准日,于2015年10月20日实施收益分配,每10份基金份额派发红利0.240元,合计发放红利37,398,164.50元。

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

报告期内,本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况,出现该情况的时间范围为2015年1月5日至2015年3月10日。

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 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,发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人,基金管理人在合理期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内,本基金实施利润分配406,962,301.76元。

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

上投摩根天颐年丰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21346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:上投摩根天颐年丰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<br>2015年12月31日 | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产: | | - | - |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 152,765,812.83 | 5,942,847.59 |
| 结算备付金 | | 53,793,976.88 | 1,327,705.55 |
| 存出保证金 | | 106,823.70 | 41,890.27 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 271,710,924.97 | 57,976,720.10 |
| 其中:股票投资 | | 36,337,958.07 | 6,440,527.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 235,372,966.90 | 51,536,193.10 |
| 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 | 1,092,000,000.00 | - |
| 应收证券清算款 | | 477,675,888.34 | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 6,869,594.77 | 1,358,601.11 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | 47,370.63 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 2,054,923,021.49 | 66,695,135.25 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末<br>2015年12月31日 | 上年度末<br>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 | | 157,499,535.00 | 12,400,000.00 |
| 应付证券清算款 | | - | 4,707,793.33 |
| 应付赎回款 | | 29,089,258.52 | 626,264.15 |
| 应付管理人报酬 | | 1,542,832.60 | 39,064.08 |
| 应付托管费 | | 428,564.61 | 10,851.15 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 288,924.40 | 111,274.84 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | 11,299.30 | 4,472.25 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 211,986.51 | 301,588.36 |
| 负债合计 | | 189,072,400.94 | 18,201,308.16 |
| 所有者权益: | | - | - |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 1,811,992,140.21 | 42,555,460.69 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 53,858,480.34 | 5,938,366.40 |
| 所有者权益合计 | | 1,865,850,620.55 | 48,493,827.09 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,054,923,021.49 | 66,695,135.25 |

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.030元,基金份额总额1,811,992,140.21份。

7.2 利润表

会计主体:上投摩根天颐年丰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<br>2015年1月1日至2015年12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 169,582,836.15 | 19,854,305.29 |
| 1.利息收入 | | 42,884,706.43 | 9,338,852.27 |
| 其中:存款利息收入 | 7.4.7.11 | 8,587,460.27 | 914,490.33 |
| 债券利息收入 | | 15,296,283.48 | 7,969,930.12 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 19,000,962.68 | 454,431.82 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | 116,299,147.70 | 6,456,669.79 |
| 其中:股票投资收益 | 7.4.7.12 | 114,764,525.02 | -1,705,473.52 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 1,439,183.15 | 8,117,761.84 |
| 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 | 95,439.53 | 44,381.47 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 7.4.7.16 | 4,242,905.92 | 3,764,050.43 |
| 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 | 6,156,076.10 | 294,732.80 |
| 减:二、费用 | | 32,759,459.32 | 4,583,039.44 |
| 1.管理人报酬 | | 23,219,224.98 | 1,316,839.54 |
| 2.托管费 | | 6,449,784.80 | 365,788.73 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | 7.4.7.18 | 2,212,199.20 | 464,296.01 |
| 5.利息支出 | | 652,683.14 | 2,115,013.31 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 652,683.14 | 2,115,013.31 |
| 6.其他费用 | 7.4.7.19 | 225,567.20 | 321,101.85 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | 136,823,376.83 | 15,271,265.85 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | 136,823,376.83 | 15,271,265.85 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上投摩根天颐年丰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<br>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) | 42,555,460.69 | 5,938,366.40 | 48,493,827.09 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 136,823,376.83 | 136,823,376.83 |
| 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) | 1,769,436,679.52 | 318,059,038.87 | 2,087,495,718.39 |
| 其中:1.基金申购款 | 6,327,042,692.70 | 595,456,006.62 | 6,922,498,699.32 |
| 2.基金赎回款 | -4,557,606,013.18 | -277,396,967.75 | -4,835,002,980.93 |
| 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) | - | -406,962,301.76 | -406,962,301.76 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,811,992,140.21 | 53,858,480.34 | 1,865,850,620.55 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>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) | 300,358,361.80 | -807,710.99 | 299,550,650.81 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 15,271,265.85 | 15,271,265.85 |
| 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) | -257,802,901.11 | -4,567,005.44 | -262,369,906.55 |
| 其中:1.基金申购款 | 20,663,689.67 | 1,265,069.34 | 21,928,759.01 |
| 2.基金赎回款 | -278,466,590.78 | -5,832,074.78 | -284,298,665.56 |
| 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) | - | -3,958,183.02 | -3,958,183.02 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 42,555,460.69 | 5,938,366.40 | 48,493,827.09 |

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

上投摩根天颐年丰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[2013]321号《关于核准上投摩根天颐年丰混合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《上投摩根天颐年丰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2013年6月17日至2013年7月12日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集439,211,938.71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(2013)第403号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金合同》于2013年7月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为439,284,482.30份基金份额,其中认购资金利息折合72,543.59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《上投摩根天颐年丰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、权证、债券等固定收益类金融工具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。本基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产的0%-40%;债券、现金等其他金融工具占基金资产的比例不低于60%,其中现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证投资占基金资产净值的0-3%。本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)+1%。

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03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《以下简称"中国基金业协会")《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根天颐年丰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相一致。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

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》、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,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. 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 8CS 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: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<br>2015年1月1日至2015年12月31日 | 上年度可比期间<br>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 | 23,219,224.98 | 1,316,839.54 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 599,229.31 | 738,550.07 |

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0.9%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 0.9% / 当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2015年1月1日至2015年12月31日 | 上年度可比期间<br>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 | 6,449,784.80 | 365,788.73 |

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 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<br>2015年1月1日至2015年12月31日 | | 上年度可比期间<br>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 | 152,765,812.83 | 6,480,224.21 | 5,942,847.59 | 62,383.90 |

注:本基金的活期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

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1受限证券类别:股票

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 002778 | 高科石化 | 2015-12-28 | 2016-01-06 | 网下中签 | 8.50 | 8.50 | 5,600.00 | 47,600.00 | 47,600.00 | - |

7.4.9.1.2受限证券类别:债券

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 123001 | 蓝标转债 | 2015-12-23 | 2016-01-08 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 4,660.00 | 466,000.00 | 466,000.00 | - |

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 300366 | 创意信息 | 2015-12-29 | 重大事项 | 77.70 | - | - | 10,000.00 | 769,206.00 | 777,000.00 | - |
| 600122 | 宏图高科 | 2015-12-25 | 重大事项 | 19.42 | - | - | 60,000.00 | 1,071,600.00 | 1,165,200.00 | - |

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

截至本报告期末2015年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额149,999,535.00元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|
| 41566009 | 15江铜CP001 | 2016-01-07 | 100.75 | 500,000.00 | 50,375,000.00 |
| 150206 | 15国开06 | 2016-01-07 | 100.43 | 1,000,000.00 | 100,430,000.00 |
| 合计 | | | | 1,500,000.00 | 150,805,000.00 |

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额7,500,000.00元,于2016年01月04日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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40,291,896.27元,属于第二层次的余额为231,419,028.70元,无属于第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次57,546,362.10元,第二层次430,358.00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 | 36,337,958.07 | 1.77 |
| | 其中:股票 | 36,337,958.07 | 1.77 |
| 2 | 固定收益投资 | 235,372,966.90 | 11.45 |
| | 其中:债券 | 235,372,966.90 | 11.45 |
| | 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 | 1,092,000,000.00 | 53.14 |
| | 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 | 206,559,789.71 | 10.05 |
| 7 | 其他各项资产 | 484,652,306.81 | 23.58 |
| 8 | 合计 | 2,054,923,021.49 | 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 | 15,619,737.70 | 0.84 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 1,002,328.20 | 0.05 |
| F | 批发和零售业 | 1,387,504.44 | 0.07 |
| 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 | 6,763,648.18 | 0.36 |
| J | 金融业 | 3,221,256.20 | 0.17 |
| K | 房地产业 | 5,666,595.00 | 0.30 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 109,392.21 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 907,171.74 | 0.05 |
| 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 | 1,660,324.40 | 0.09 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 36,337,958.07 | 1.95 |

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 | 002574 | 明牌珠宝 | 110,229 | 2,341,263.96 | 0.13 |
| 2 | 600837 | 海通证券 | 108,460 | 1,715,837.20 | 0.09 |
| 3 | 002466 | 天齐锂业 | 12,000 | 1,689,000.00 | 0.09 |
| 4 | 600745 | 中茵股份 | 39,000 | 1,598,220.00 | 0.09 |
| 5 | 000718 | 苏宁环球 | 112,500 | 1,483,875.00 | 0.08 |
| 6 | 002260 | 德奥通航 | 30,000 | 1,356,000.00 | 0.07 |
| 7 | 600122 | 宏图高科 | 60,000 | 1,165,200.00 | 0.06 |
| 8 | 002191 | 劲嘉股份 | 75,000 | 1,152,000.00 | 0.06 |
| 9 | 603508 | 思维列控 | 14,605 | 1,136,853.20 | 0.06 |
| 10 | 300368 | 汇金股份 | 20,000 | 1,134,400.00 | 0.06 |

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 | 600030 | 中信证券 | 16,070,692.91 | 33.14 |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 14,310,763.00 | 29.51 |
| 3 | 600837 | 海通证券 | 14,204,319.00 | 29.29 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 12,968,233.73 | 26.74 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 11,676,186.70 | 24.08 |
| 6 | 000651 | 格力电器 | 11,598,693.25 | 23.92 |
| 7 | 600000 | 浦发银行 | 9,275,444.38 | 19.13 |
| 8 | 000002 | 万科A | 9,247,013.75 | 19.07 |
| 9 | 000776 | 广发证券 | 9,019,093.36 | 18.60 |
| 10 | 601857 | 中国石油 | 8,483,079.00 | 17.49 |
| 11 | 000001 | 平安银行 | 8,013,520.15 | 16.52 |
| 12 | 000783 | 长江证券 | 7,512,736.64 | 15.49 |
| 13 | 000333 | 美的集团 | 7,367,156.53 | 15.19 |
| 14 | 601398 | 工商银行 | 6,750,553.00 | 13.92 |
| 15 | 600519 | 贵州茅台 | 6,589,687.53 | 13.59 |
| 16 | 600887 | 伊利股份 | 6,399,079.64 | 13.20 |
| 17 | 601169 | 北京银行 | 6,356,441.00 | 13.11 |
| 18 | 600138 | 中青旅 | 6,032,249.50 | 12.44 |
| 19 | 002024 | 苏宁云商 | 5,649,319.43 | 11.65 |
| 20 | 601006 | 大秦铁路 | 5,265,458.13 | 10.86 |
| 21 | 601328 | 交通银行 | 5,197,005.00 | 10.72 |
| 22 | 002241 | 歌尔声学 | 4,965,402.17 | 10.24 |
| 23 | 601288 | 农业银行 | 4,940,058.00 | 10.19 |
| 24 | 000063 | 中兴通讯 | 4,821,548.88 | 9.94 |
| 25 | 000858 | 五粮液 | 4,710,206.02 | 9.71 |
| 26 | 000100 | TCL集团 | 4,699,810.00 | 9.69 |
| 27 | 002415 | 海康威视 | 4,675,554.26 | 9.64 |
| 28 | 600048 | 保利地产 | 4,643,751.00 | 9.58 |
| 29 | 601628 | 中国人寿 | 4,295,825.00 | 8.86 |
| 30 | 002230 | 科大讯飞 | 4,182,624.36 | 8.63 |
| 31 | 002081 | 金螳螂 | 4,165,871.15 | 8.59 |
| 32 | 002345 | 潮宏基 | 4,077,762.97 | 8.41 |
| 33 | 600104 | 上汽集团 | 4,039,283.58 | 8.33 |
| 34 | 002236 | 大华股份 | 4,004,559.28 | 8.26 |
| 35 | 000768 | 中航飞机 | 3,896,864.20 | 8.04 |
| 36 | 600999 | 招商证券 | 3,893,547.00 | 8.03 |
| 37 | 600015 | 华夏银行 | 3,851,061.00 | 7.94 |
| 38 | 601989 | 中国重工 | 3,767,172.30 | 7.77 |
| 39 | 600111 | 北方稀土 | 3,712,229.00 | 7.66 |
| 40 | 000725 | 京东方A | 3,708,728.00 | 7.65 |
| 41 | 300070 | 碧水源 | 3,674,501.10 | 7.58 |
| 42 | 002594 | 比亚迪 | 3,668,670.00 | 7.57 |
| 43 | 600959 | 江苏有线 | 3,628,431.51 | 7.48 |
| 44 | 000338 | 潍柴动力 | 3,625,868.82 | 7.48 |
| 45 | 002304 | 洋河股份 | 3,567,381.74 | 7.36 |
| 46 | 600585 | 海螺水泥 | 3,507,315.97 | 7.23 |
| 47 | 601088 | 中国神华 | 3,504,472.51 | 7.23 |
| 48 | 601601 | 中国太保 | 3,465,502.00 | 7.15 |
| 49 | 600728 | 佳都科技 | 3,347,554.35 | 6.90 |
| 50 | 600518 | 康美药业 | 3,329,330.00 | 6.87 |
| 51 | 000157 | 中联重科 | 3,314,043.00 | 6.83 |
| 52 | 603555 | 贵人鸟 | 3,284,964.99 | 6.77 |
| 53 | 600690 | 青岛海尔 | 3,260,660.78 | 6.72 |
| 54 | 601166 | 兴业银行 | 3,187,183.00 | 6.57 |
| 55 | 300016 | 北陆药业 | 3,115,430.00 | 6.42 |
| 56 | 000538 | 云南白药 | 3,012,575.00 | 6.21 |
| 57 | 603766 | 隆鑫通用 | 3,008,049.00 | 6.20 |
| 58 | 000166 | 申万宏源 | 2,979,109.80 | 6.14 |
| 59 | 600028 | 中国石化 | 2,842,079.00 | 5.86 |
| 60 | 300059 | 东方财富 | 2,830,416.00 | 5.84 |
| 61 | 300027 | 华谊兄弟 | 2,821,748.00 | 5.82 |
| 62 | 000895 | 双汇发展 | 2,713,522.96 | 5.60 |
| 63 | 000793 | 华闻传媒 | 2,669,935.03 | 5.51 |
| 64 | 002292 | 奥飞动漫 | 2,625,461.64 | 5.41 |
| 65 | 601668 | 中国建筑 | 2,571,271.00 | 5.30 |
| 66 | 000718 | 苏宁环球 | 2,569,912.44 | 5.30 |
| 67 | 000423 | 东阿阿胶 | 2,469,469.99 | 5.09 |
| 68 | 002574 | 明牌珠宝 | 2,423,701.71 | 5.00 |
| 69 | 600654 | 中安消 | 2,357,915.00 | 4.86 |
| 70 | 300085 | 银之杰 | 2,355,433.00 | 4.86 |
| 71 | 600010 | 包钢股份 | 2,335,018.00 | 4.82 |
| 72 | 002657 | 中科金财 | 2,298,768.62 | 4.74 |
| 73 | 000568 | 泸州老窖 | 2,140,243.91 | 4.41 |
| 74 | 002077 | 大港股份 | 2,097,814.00 | 4.33 |
| 75 | 002152 | 广电运通 | 2,092,444.00 | 4.31 |
| 76 | 600517 | 置信电气 | 2,078,519.96 | 4.29 |
| 77 | 600358 | 国旅联合 | 2,065,881.03 | 4.26 |
| 78 | 002142 | 宁波银行 | 2,061,483.13 | 4.25 |
| 79 | 300033 | 同花顺 | 2,033,195.30 | 4.19 |
| 80 | 603989 | 艾华集团 | 2,009,642.12 | 4.14 |
| 81 | 600436 | 片仔癀 | 2,001,183.30 | 4.13 |
| 82 | 300339 | 润和软件 | 2,000,534.00 | 4.13 |
| 83 | 600050 | 中国联通 | 1,986,058.00 | 4.10 |
| 84 | 600406 | 国电南瑞 | 1,982,400.00 | 4.09 |
| 85 | 300429 | 强力新材 | 1,981,055.00 | 4.09 |
| 86 | 000581 | 威孚高科 | 1,972,742.67 | 4.07 |
| 87 | 300104 | 乐视网 | 1,967,200.99 | 4.06 |
| 88 | 600562 | 国睿科技 | 1,955,480.00 | 4.03 |
| 89 | 603019 | 中科曙光 | 1,948,537.10 | 4.02 |
| 90 | 600588 | 用友网络 | 1,902,206.20 | 3.92 |
| 91 | 002467 | 二六三 | 1,882,658.08 | 3.88 |
| 92 | 000792 | 盐湖股份 | 1,868,276.00 | 3.85 |
| 93 | 002466 | 天齐锂业 | 1,842,882.00 | 3.80 |
| 94 | 000721 | 西安饮食 | 1,829,965.00 | 3.77 |
| 95 | 002234 | 民和股份 | 1,807,579.00 | 3.73 |
| 96 | 300178 | 腾邦国际 | 1,780,877.00 | 3.67 |
| 97 | 000848 | 承德露露 | 1,739,515.00 | 3.59 |
| 98 | 002308 | 威创股份 | 1,739,482.00 | 3.59 |
| 99 | 600018 | 上港集团 | 1,736,059.00 | 3.58 |
| 100 | 300212 | 易华录 | 1,730,291.55 | 3.57 |
| 101 | 601988 | 中国银行 | 1,722,363.00 | 3.55 |
| 102 | 300202 | 聚龙股份 | 1,699,257.00 | 3.50 |
| 103 | 600129 | 太极集团 | 1,698,122.80 | 3.50 |
| 104 | 000503 | 海虹控股 | 1,696,630.00 | 3.50 |
| 105 | 002170 | 芭田股份 | 1,689,705.00 | 3.48 |
| 106 | 300168 | 万达信息 | 1,663,762.00 | 3.43 |
| 107 | 002474 | 榕基软件 | 1,655,850.00 | 3.41 |
| 108 | 000638 | 万方发展 | 1,623,812.98 | 3.35 |
| 109 | 600958 | 东方证券 | 1,617,090.00 | 3.33 |
| 110 | 300206 | 理邦仪器 | 1,607,058.00 | 3.31 |
| 111 | 000888 | 峨眉山A | 1,599,703.04 | 3.30 |
| 112 | 600745 | 中茵股份 | 1,584,093.00 | 3.27 |
| 113 | 600446 | 金证股份 | 1,580,460.00 | 3.26 |
| 114 | 002456 | 欧菲光 | 1,560,196.57 | 3.22 |
| 115 | 603001 | 奥康国际 | 1,555,619.88 | 3.21 |
| 116 | 603678 | 火炬电子 | 1,553,911.24 | 3.20 |
| 117 | 300227 | 光韵达 | 1,552,798.00 | 3.20 |
| 118 | 002353 | 杰瑞股份 | 1,545,360.00 | 3.19 |
| 119 | 300363 | 博腾股份 | 1,542,074.60 | 3.18 |
| 120 | 300008 | 上海佳豪 | 1,536,050.00 | 3.17 |
| 121 | 300351 | 永贵电器 | 1,521,572.00 | 3.14 |
| 122 | 600501 | 航天晨光 | 1,518,690.00 | 3.13 |
| 123 | 600256 | 广汇能源 | 1,518,087.00 | 3.13 |
| 124 | 300310 | 宜通世纪 | 1,515,195.00 | 3.12 |
| 125 | 000738 | 中航动控 | 1,510,440.00 | 3.11 |
| 126 | 600060 | 海信电器 | 1,509,016.00 | 3.11 |
| 127 | 600536 | 中国软件 | 1,505,674.00 | 3.10 |
| 128 | 000629 | 攀钢钒钛 | 1,499,610.00 | 3.09 |
| 129 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,497,267.61 | 3.09 |
| 130 | 300005 | 探路者 | 1,495,022.00 | 3.08 |
| 131 | 601555 | 东吴证券 | 1,489,925.00 | 3.07 |
| 132 | 601515 | 东风股份 | 1,489,507.00 | 3.07 |
| 133 | 000021 | 深科技 | 1,481,499.13 | 3.06 |
| 134 | 002668 | 奥马电器 | 1,478,302.00 | 3.05 |
| 135 | 600879 | 航天电子 | 1,433,768.00 | 2.96 |
| 136 | 300011 | 鼎汉技术 | 1,418,350.00 | 2.92 |
| 137 | 300017 | 网宿科技 | 1,417,855.00 | 2.92 |
| 138 | 600150 | 中国船舶 | 1,413,553.00 | 2.91 |
| 139 | 002260 | 德奥通航 | 1,396,661.52 | 2.88 |
| 140 | 002280 | 联络互动 | 1,382,501.70 | 2.85 |
| 141 | 600708 | 光明地产 | 1,370,041.00 | 2.83 |
| 142 | 601901 | 方正证券 | 1,359,423.00 | 2.80 |
| 143 | 300463 | 迈克生物 | 1,359,163.56 | 2.80 |
| 144 | 601313 | 江南嘉捷 | 1,355,414.80 | 2.80 |
| 145 | 300367 | 东方网力 | 1,348,526.00 | 2.78 |
| 146 | 300392 | 腾信股份 | 1,326,130.00 | 2.73 |
| 147 | 600271 | 航天信息 | 1,310,941.00 | 2.70 |
| 148 | 300013 | 新宁物流 | 1,307,601.70 | 2.70 |
| 149 | 002189 | 利达光电 | 1,285,624.00 | 2.65 |
| 150 | 002332 | 仙琚制药 | 1,253,930.00 | 2.59 |
| 151 | 600332 | 白云山 | 1,252,645.34 | 2.58 |
| 152 | 000810 | 创维数字 | 1,234,331.00 | 2.55 |
| 153 | 300359 | 全通教育 | 1,225,004.00 | 2.53 |
| 154 | 601788 | 光大证券 | 1,223,268.00 | 2.52 |
| 155 | 600089 | 特变电工 | 1,220,267.00 | 2.52 |
| 156 | 601199 | 江南水务 | 1,215,761.00 | 2.51 |
| 157 | 002381 | 双箭股份 | 1,165,722.00 | 2.40 |
| 158 | 300109 | 新开源 | 1,158,459.68 | 2.39 |
| 159 | 002191 | 劲嘉股份 | 1,142,241.67 | 2.36 |
| 160 | 603979 | 金诚信 | 1,135,622.97 | 2.34 |
| 161 | 600521 | 华海药业 | 1,128,561.08 | 2.33 |
| 162 | 002763 | 汇洁股份 | 1,101,238.40 | 2.27 |
| 163 | 600986 | 科达股份 | 1,092,787.00 | 2.25 |
| 164 | 002063 | 远光软件 | 1,076,712.00 | 2.22 |
| 165 | 300235 | 方直科技 | 1,074,189.26 | 2.22 |
| 166 | 600122 | 宏图高科 | 1,071,600.00 | 2.21 |
| 167 | 002373 | 千方科技 | 1,066,140.00 | 2.20 |
| 168 | 000043 | 中航地产 | 1,062,891.00 | 2.19 |
| 169 | 300431 | 暴风科技 | 1,060,000.00 | 2.19 |
| 170 | 300181 | 佐力药业 | 1,046,500.29 | 2.16 |
| 171 | 000987 | 广州友谊 | 1,046,302.00 | 2.16 |
| 172 | 000402 | 金融街 | 1,041,657.00 | 2.15 |
| 173 | 300295 | 三六五网 | 1,035,032.00 | 2.13 |
| 174 | 002458 | 益生股份 | 1,025,109.43 | 2.11 |
| 175 | 600409 | 三友化工 | 1,024,371.00 | 2.11 |
| 176 | 000615 | 湖北金环 | 1,022,790.25 | 2.11 |
| 177 | 600379 | 宝光股份 | 1,018,074.00 | 2.10 |
| 178 | 002206 | 海利得 | 1,013,551.00 | 2.09 |
| 179 | 000069 | 华侨城A | 1,009,328.00 | 2.08 |
| 180 | 002148 | 北纬通信 | 1,009,000.00 | 2.08 |
| 181 | 300345 | 红宇新材 | 1,001,569.00 | 2.07 |
| 182 | 000967 | 上风高科 | 1,000,381.40 | 2.06 |
| 183 | 000961 | 中南建设 | 999,845.00 | 2.06 |
| 184 | 600643 | 爱建集团 | 997,690.00 | 2.06 |
| 185 | 601336 | 新华保险 | 995,438.00 | 2.05 |
| 186 | 600433 | 冠豪高新 | 982,203.00 | 2.03 |
| 187 | 601998 | 中信银行 | 981,675.69 | 2.02 |
| 188 | 601368 | 绿城水务 | 980,877.21 | 2.02 |

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 | 600959 | 江苏有线 | 35,478,650.65 | 73.16 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 16,159,520.98 | 33.32 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 15,034,806.03 | 31.00 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 12,972,686.08 | 26.75 |
| 5 | 600837 | 海通证券 | 12,490,960.13 | 25.76 |
| 6 | 000651 | 格力电器 | 11,780,159.63 | 24.29 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 11,563,825.40 | 23.85 |
| 8 | 600000 | 浦发银行 | 9,561,832.18 | 19.72 |
| 9 | 000776 | 广发证券 | 9,311,123.00 | 19.20 |
| 10 | 000002 | 万科A | 9,267,162.46 | 19.11 |
| 11 | 601857 | 中国石油 | 8,367,475.01 | 17.25 |
| 12 | 000001 | 平安银行 | 7,845,849.26 | 16.18 |
| 13 | 000783 | 长江证券 | 7,703,490.00 | 15.89 |
| 14 | 000333 | 美的集团 | 7,233,016.65 | 14.92 |
| 15 | 601398 | 工商银行 | 6,791,068.38 | 14.00 |
| 16 | 600519 | 贵州茅台 | 6,677,369.47 | 13.77 |
| 17 | 600887 | 伊利股份 | 6,434,635.70 | 13.27 |
| 18 | 601169 | 北京银行 | 6,246,513.44 | 12.88 |
| 19 | 600138 | 中青旅 | 6,088,093.87 | 12.55 |
| 20 | 601006 | 大秦铁路 | 5,698,841.22 | 11.75 |
| 21 | 002024 | 苏宁云商 | 5,647,504.87 | 11.65 |
| 22 | 601628 | 中国人寿 | 5,285,960.09 | 10.90 |
| 23 | 601328 | 交通银行 | 5,232,092.94 | 10.79 |
| 24 | 000063 | 中兴通讯 | 5,199,960.76 | 10.72 |
| 25 | 002241 | 歌尔声学 | 5,019,953.40 | 10.35 |
| 26 | 601288 | 农业银行 | 4,979,490.60 | 10.27 |
| 27 | 600048 | 保利地产 | 4,979,050.00 | 10.27 |
| 28 | 300463 | 迈克生物 | 4,911,469.72 | 10.13 |
| 29 | 000100 | TCL集团 | 4,841,018.88 | 9.98 |
| 30 | 000858 | 五粮液 | 4,725,111.99 | 9.74 |
| 31 | 002415 | 海康威视 | 4,680,919.00 | 9.65 |
| 32 | 603989 | 艾华集团 | 4,439,520.56 | 9.16 |
| 33 | 002230 | 科大讯飞 | 4,272,905.74 | 8.81 |
| 34 | 002236 | 大华股份 | 4,128,972.62 | 8.51 |
| 35 | 600104 | 上汽集团 | 4,091,925.86 | 8.44 |
| 36 | 603555 | 贵人鸟 | 4,041,389.00 | 8.33 |
| 37 | 000768 | 中航飞机 | 4,023,266.37 | 8.30 |
| 38 | 002081 | 金螳螂 | 4,001,014.00 | 8.25 |
| 39 | 600999 | 招商证券 | 3,937,027.00 | 8.12 |
| 40 | 600015 | 华夏银行 | 3,907,333.00 | 8.06 |
| 41 | 000725 | 京东方A | 3,788,419.40 | 7.81 |
| 42 | 002763 | 汇洁股份 | 3,767,163.12 | 7.77 |
| 43 | 000338 | 潍柴动力 | 3,762,853.00 | 7.76 |
| 44 | 600111 | 北方稀土 | 3,760,412.00 | 7.75 |
| 45 | 002594 | 比亚迪 | 3,751,318.96 | 7.74 |
| 46 | 601989 | 中国重工 | 3,744,493.15 | 7.72 |
| 47 | 300070 | 碧水源 | 3,702,093.91 | 7.63 |
| 48 | 002304 | 洋河股份 | 3,604,711.92 | 7.43 |
| 49 | 600728 | 佳都科技 | 3,585,524.50 | 7.39 |
| 50 | 601601 | 中国太保 | 3,559,199.28 | 7.34 |
| 51 | 601088 | 中国神华 | 3,552,292.14 | 7.33 |
| 52 | 600585 | 海螺水泥 | 3,497,152.27 | 7.21 |
| 53 | 000157 | 中联重科 | 3,471,599.60 | 7.16 |
| 54 | 600690 | 青岛海尔 | 3,416,922.31 | 7.05 |
| 55 | 002345 | 潮宏基 | 3,414,936.79 | 7.04 |
| 56 | 600518 | 康美药业 | 3,332,985.40 | 6.87 |
| 57 | 601166 | 兴业银行 | 3,225,683.00 | 6.65 |
| 58 | 603766 | 隆鑫通用 | 3,160,082.80 | 6.52 |
| 59 | 002756 | 永兴特钢 | 3,086,624.94 | 6.36 |
| 60 | 000166 | 申万宏源 | 3,071,877.00 | 6.33 |
| 61 | 000538 | 云南白药 | 3,048,021.84 | 6.29 |
| 62 | 601368 | 绿城水务 | 3,000,641.49 | 6.19 |
| 63 | 300458 | 全志科技 | 2,960,336.00 | 6.10 |
| 64 | 300027 | 华谊兄弟 | 2,957,141.60 | 6.10 |
| 65 | 300437 | 清水源 | 2,882,650.00 | 5.94 |
| 66 | 603227 | 雪峰科技 | 2,826,837.92 | 5.83 |
| 67 | 603355 | 莱克电气 | 2,762,640.36 | 5.70 |
| 68 | 000895 | 双汇发展 | 2,746,557.78 | 5.66 |
| 69 | 600028 | 中国石化 | 2,730,165.00 | 5.63 |
| 70 | 002657 | 中科金财 | 2,725,295.70 | 5.62 |
| 71 | 000793 | 华闻传媒 | 2,671,684.60 | 5.51 |
| 72 | 300059 | 东方财富 | 2,647,368.00 | 5.46 |
| 73 | 002751 | 易尚展示 | 2,606,100.00 | 5.37 |
| 74 | 601668 | 中国建筑 | 2,572,733.95 | 5.31 |
| 75 | 000423 | 东阿阿胶 | 2,555,535.00 | 5.27 |
| 76 | 603599 | 广信股份 | 2,484,625.30 | 5.12 |
| 77 | 603885 | 吉祥航空 | 2,443,382.42 | 5.04 |
| 78 | 300016 | 北陆药业 | 2,394,375.50 | 4.94 |
| 79 | 603198 | 迎驾贡酒 | 2,383,424.00 | 4.91 |
| 80 | 600010 | 包钢股份 | 2,311,927.00 | 4.77 |
| 81 | 600654 | 中安消 | 2,287,684.85 | 4.72 |
| 82 | 601968 | 宝钢包装 | 2,287,167.20 | 4.72 |
| 83 | 600517 | 置信电气 | 2,261,574.56 | 4.66 |
| 84 | 300429 | 强力新材 | 2,242,063.80 | 4.62 |
| 85 | 600562 | 国睿科技 | 2,139,295.00 | 4.41 |
| 86 | 002142 | 宁波银行 | 2,119,831.00 | 4.37 |
| 87 | 000568 | 泸州老窖 | 2,115,196.00 | 4.36 |
| 88 | 300441 | 鲍斯股份 | 2,112,856.78 | 4.36 |
| 89 | 300011 | 鼎汉技术 | 2,107,024.50 | 4.34 |
| 90 | 600436 | 片仔癀 | 2,105,671.96 | 4.34 |
| 91 | 300104 | 乐视网 | 2,083,991.80 | 4.30 |
| 92 | 603979 | 金诚信 | 2,046,011.39 | 4.22 |
| 93 | 300033 | 同花顺 | 2,042,224.70 | 4.21 |
| 94 | 300310 | 宜通世纪 | 2,006,575.00 | 4.14 |
| 95 | 300339 | 润和软件 | 2,004,535.00 | 4.13 |
| 96 | 600050 | 中国联通 | 1,990,764.00 | 4.11 |
| 97 | 002152 | 广电运通 | 1,975,092.00 | 4.07 |
| 98 | 600406 | 国电南瑞 | 1,973,604.19 | 4.07 |
| 99 | 600588 | 用友网络 | 1,942,127.20 | 4.00 |
| 100 | 000581 | 威孚高科 | 1,938,448.74 | 4.00 |
| 101 | 300450 | 先导智能 | 1,927,503.00 | 3.97 |
| 102 | 300476 | 胜宏科技 | 1,926,682.32 | 3.97 |
| 103 | 600358 | 国旅联合 | 1,883,986.70 | 3.89 |
| 104 | 603669 | 灵康药业 | 1,883,727.16 | 3.88 |
| 105 | 603019 | 中科曙光 | 1,876,611.00 | 3.87 |
| 106 | 000792 | 盐湖股份 | 1,858,534.50 | 3.83 |
| 107 | 300438 | 鹏辉能源 | 1,853,427.33 | 3.82 |
| 108 | 002292 | 奥飞动漫 | 1,837,548.00 | 3.79 |
| 109 | 002668 | 奥马电器 | 1,835,634.60 | 3.79 |
| 110 | 002467 | 二六三 | 1,802,512.93 | 3.72 |
| 111 | 002234 | 民和股份 | 1,802,065.00 | 3.72 |
| 112 | 600986 | 科达股份 | 1,800,223.00 | 3.71 |
| 113 | 002308 | 威创股份 | 1,796,949.00 | 3.71 |
| 114 | 300212 | 易华录 | 1,796,834.71 | 3.71 |
| 115 | 300008 | 上海佳豪 | 1,788,750.00 | 3.69 |
| 116 | 300414 | 中光防雷 | 1,776,702.00 | 3.66 |
| 117 | 000721 | 西安饮食 | 1,736,888.00 | 3.58 |
| 118 | 000638 | 万方发展 | 1,732,854.26 | 3.57 |
| 119 | 601988 | 中国银行 | 1,731,095.32 | 3.57 |
| 120 | 600018 | 上港集团 | 1,729,236.90 | 3.57 |
| 121 | 002170 | 芭田股份 | 1,708,999.64 | 3.52 |
| 122 | 300473 | 德尔股份 | 1,705,835.70 | 3.52 |
| 123 | 300202 | 聚龙股份 | 1,680,260.00 | 3.46 |
| 124 | 300168 | 万达信息 | 1,672,576.00 | 3.45 |
| 125 | 600958 | 东方证券 | 1,627,080.00 | 3.36 |
| 126 | 000558 | 莱茵体育 | 1,626,439.00 | 3.35 |
| 127 | 300178 | 腾邦国际 | 1,624,554.00 | 3.35 |
| 128 | 300475 | 聚隆科技 | 1,598,869.40 | 3.30 |
| 129 | 000629 | 攀钢钒钛 | 1,588,270.00 | 3.28 |
| 130 | 002765 | 蓝黛传动 | 1,585,868.50 | 3.27 |
| 131 | 600271 | 航天信息 | 1,582,226.00 | 3.26 |
| 132 | 600501 | 航天晨光 | 1,577,956.00 | 3.25 |
| 133 | 002456 | 欧菲光 | 1,576,730.39 | 3.25 |
| 134 | 002474 | 榕基软件 | 1,554,793.25 | 3.21 |
| 135 | 300485 | 赛升药业 | 1,549,485.76 | 3.20 |
| 136 | 000021 | 深科技 | 1,543,949.00 | 3.18 |
| 137 | 002353 | 杰瑞股份 | 1,543,860.91 | 3.18 |
| 138 | 300227 | 光韵达 | 1,540,617.26 | 3.18 |
| 139 | 300005 | 探路者 | 1,533,275.00 | 3.16 |
| 140 | 600060 | 海信电器 | 1,512,221.40 | 3.12 |
| 141 | 000738 | 中航动控 | 1,506,885.00 | 3.11 |
| 142 | 600446 | 金证股份 | 1,502,820.00 | 3.10 |
| 143 | 600256 | 广汇能源 | 1,502,687.00 | 3.10 |
| 144 | 300404 | 博济医药 | 1,502,632.80 | 3.10 |
| 145 | 603001 | 奥康国际 | 1,495,429.00 | 3.08 |
| 146 | 300477 | 合纵科技 | 1,495,318.00 | 3.08 |
| 147 | 002762 | 金发拉比 | 1,494,426.60 | 3.08 |
| 148 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,493,041.85 | 3.08 |
| 149 | 300456 | 耐威科技 | 1,467,126.00 | 3.03 |
| 150 | 300085 | 银之杰 | 1,456,060.75 | 3.00 |
| 151 | 600536 | 中国软件 | 1,455,995.49 | 3.00 |
| 152 | 300013 | 新宁物流 | 1,437,909.00 | 2.97 |
| 153 | 300468 | 四方精创 | 1,436,209.22 | 2.96 |
| 154 | 002332 | 仙琚制药 | 1,428,713.96 | 2.95 |
| 155 | 000810 | 创维数字 | 1,426,456.00 | 2.94 |
| 156 | 600150 | 中国船舶 | 1,402,063.00 | 2.89 |
| 157 | 300017 | 网宿科技 | 1,396,985.38 | 2.88 |
| 158 | 601515 | 东风股份 | 1,396,028.00 | 2.88 |
| 159 | 600879 | 航天电子 | 1,389,709.98 | 2.87 |
| 160 | 601901 | 方正证券 | 1,377,731.73 | 2.84 |
| 161 | 601313 | 江南嘉捷 | 1,369,768.00 | 2.82 |
| 162 | 000718 | 苏宁环球 | 1,318,381.00 | 2.72 |
| 163 | 601788 | 光大证券 | 1,312,663.33 | 2.71 |
| 164 | 603568 | 伟明环保 | 1,301,356.20 | 2.68 |
| 165 | 600332 | 白云山 | 1,292,572.82 | 2.67 |
| 166 | 601555 | 东吴证券 | 1,276,000.00 | 2.63 |
| 167 | 300065 | 海兰信 | 1,253,794.11 | 2.59 |
| 168 | 603678 | 火炬电子 | 1,253,765.14 | 2.59 |
| 169 | 002189 | 利达光电 | 1,252,545.00 | 2.58 |
| 170 | 300206 | 理邦仪器 | 1,248,883.40 | 2.58 |
| 171 | 300465 | 高伟达 | 1,248,660.00 | 2.57 |
| 172 | 002381 | 双箭股份 | 1,234,102.97 | 2.54 |
| 173 | 002339 | 积成电子 | 1,227,412.00 | 2.53 |
| 174 | 300209 | 天泽信息 | 1,226,418.40 | 2.53 |
| 175 | 300453 | 三鑫医疗 | 1,226,103.60 | 2.53 |
| 176 | 600089 | 特变电工 | 1,223,411.85 | 2.52 |
| 177 | 002077 | 大港股份 | 1,221,579.00 | 2.52 |
| 178 | 300109 | 新开源 | 1,215,408.80 | 2.51 |
| 179 | 002753 | 永东股份 | 1,207,899.50 | 2.49 |
| 180 | 600521 | 华海药业 | 1,204,297.98 | 2.48 |
| 181 | 600708 | 光明地产 | 1,192,664.00 | 2.46 |
| 182 | 603022 | 新通联 | 1,186,175.00 | 2.45 |
| 183 | 300295 | 三六五网 | 1,174,144.00 | 2.42 |
| 184 | 000503 | 海虹控股 | 1,172,317.00 | 2.42 |
| 185 | 300451 | 创业软件 | 1,162,396.00 | 2.40 |
| 186 | 601199 | 江南水务 | 1,132,729.89 | 2.34 |
| 187 | 300431 | 暴风科技 | 1,114,542.00 | 2.30 |
| 188 | 002776 | 柏堡龙 | 1,101,902.60 | 2.27 |
| 189 | 002772 | 众兴菌业 | 1,090,431.00 | 2.25 |
| 190 | 000987 | 广州友谊 | 1,090,000.00 | 2.25 |
| 191 | 002767 | 先锋电子 | 1,067,340.65 | 2.20 |
| 192 | 002206 | 海利得 | 1,065,820.00 | 2.20 |
| 193 | 300347 | 泰格医药 | 1,064,241.60 | 2.19 |
| 194 | 300235 | 方直科技 | 1,063,167.00 | 2.19 |
| 195 | 300170 | 汉得信息 | 1,059,598.00 | 2.19 |
| 196 | 600409 | 三友化工 | 1,048,744.63 | 2.16 |
| 197 | 000967 | 上风高科 | 1,040,354.80 | 2.15 |
| 198 | 002148 | 北纬通信 | 1,036,909.00 | 2.14 |
| 199 | 000402 | 金融街 | 1,028,036.28 | 2.12 |
| 200 | 300363 | 博腾股份 | 1,018,240.00 | 2.10 |
| 201 | 002458 | 益生股份 | 1,015,473.00 | 2.09 |
| 202 | 000848 | 承德露露 | 1,012,405.00 | 2.09 |
| 203 | 300478 | 杭州高新 | 1,009,864.60 | 2.08 |
| 204 | 600379 | 宝光股份 | 1,004,052.13 | 2.07 |
| 205 | 600143 | 金发科技 | 999,144.60 | 2.06 |
| 206 | 002568 | 百润股份 | 996,326.00 | 2.05 |
| 207 | 601336 | 新华保险 | 996,265.43 | 2.05 |
| 208 | 600129 | 太极集团 | 996,097.00 | 2.05 |
| 209 | 300392 | 腾信股份 | 993,419.40 | 2.05 |
| 210 | 601818 | 光大银行 | 990,346.00 | 2.04 |
| 211 | 601998 | 中信银行 | 988,127.00 | 2.04 |
| 212 | 000069 | 华侨城A | 987,539.00 | 2.04 |
| 213 | 300345 | 红宇新材 | 987,301.00 | 2.04 |
| 214 | 002701 | 奥瑞金 | 986,162.72 | 2.03 |
| 215 | 300359 | 全通教育 | 980,955.80 | 2.02 |
| 216 | 000961 | 中南建设 | 980,600.00 | 2.02 |
| 217 | 300367 | 东方网力 | 976,884.33 | 2.01 |

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 | 642,703,544.80 |
| 卖出股票的收入(成交)总额 | 732,586,515.98 |

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 | 1,037,500.00 | 0.06 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 135,046,461.30 | 7.24 |
| | 其中:政策性金融债 | 135,046,461.30 | 7.24 |
| 4 | 企业债券 | 22,374,267.40 | 1.20 |
| 5 | 企业短期融资券 | 70,505,000.00 | 3.78 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 6,409,738.20 | 0.34 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 235,372,966.90 | 12.61 |

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 | 150206 | 15国开06 | 1,000,000 | 100,430,000.00 | 5.38 |
| 2 | 041566009 | 15江铜CP001 | 500,000 | 50,375,000.00 | 2.70 |
| 3 | 018001 | 国开1301 | 346,130 | 34,616,461.30 | 1.86 |
| 4 | 041569025 | 15中材工程CP001 | 200,000 | 20,130,000.00 | 1.08 |
| 5 | 132004 | 15国盛EB | 25,990 | 2,892,687.00 | 0.16 |

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。

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 | 106,823.70 |
| 2 | 应收证券清算款 | 477,675,888.34 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,869,594.77 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 484,652,306.81 |

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600122 | 宏图高科 | 1,165,200.00 | 0.06 | 筹划重大事项 |

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 |
| 1,221 | 1,484,023.05 | 1,715,501,950.23 | 94.67% | 96,490,189.98 | 5.33% |

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 | 29,315.05 | 0.0016% |

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(2013年7月18日)基金份额总额 | 439,284,482.30 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 42,555,460.69 |
| 本报告期基金总申购份额 | 6,327,042,692.70 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 4,557,606,013.18 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,811,992,140.21 |

### §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85,000元,目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为3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 | |
| 国金证券 | 1 | 683,673,232.87 | 50.87% | 628,052.90 | 47.58% | - |
| 中信证券 | 1 | 660,311,346.51 | 49.13% | 691,858.83 | 52.42% | - |

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. 本基金本报告期无新增席位,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 |
| 国金证券 | 11,059,552.90 | 2.44% | - | - | - | - |
| 中信证券 | 441,358,627.91 | 97.56% | 87,759,500,000.00 | 100.00% | - | - |

### §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