上投摩根新兴动力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：中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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。

本基金的基金名称自2015年7月21日起由上投摩根新兴动力股票型证券投资基金变更为上投摩根新兴动力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。

本基金乃依据中港基金互认安排已获香港证券及期货事务监察委员会（下称“香港证监会”）之认可在香港公开发售的内地基金。香港证监会认可不等于对该产品作出推介或认许，亦不是对该产品的商业利弊或表现作出保证，更不代表该产品适合所有投资者，或认许该产品适合任何个别投资者或任何类别的投资者。

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	上投摩根新兴动力混合
基金主代码	377240
交易代码	377240
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年7月13日
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,002,881,036.45份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在把握经济结构调整和产业升级的发展趋势基础上，充分挖掘新兴产业发展中的投资机会，重点关注新兴产业中的优质上市公司，并兼顾传统产业中具备新成长动力的上市公司进行投资，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金管理人认为，从经济发展的中长期趋势看，转变经济发展方式实现经济转型已经成为我国在相当长一段时期内经济发展的首要任务。在后金融危机时期，我国经济面临外需放缓、内部经济结构矛盾突出等问题，要实现经济持续健康的发展必须加快经济结构和产业结构的调整。 纵观世界各国和地区的经济发展历程，新兴产业的崛起和传统产业的升级换代是经济转型的主要驱动力。可以预见的是，新兴产业内生的市场潜力在政府大力扶持的激发下，将带动相关行业上下游全面发展，其间蕴藏着巨大的投资机会。而部分传统产业也将通过新技术、新的商业模式或生产方式等实现产业升级，获取新的成长驱动力。本基金一方面将从新兴产业出发，深入挖掘新兴产业发展过程中带来的投资机会，另一方面将关注传统产业中成长公司的投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡迪	李芳菲
	联系电话	021-38794888	010-66060069
	电子邮箱	services@cifm.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-889-4888	95599
传真		021-20628400	010-68121816

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	972,868,439.33	139,554,948.50	562,331,584.15
本期利润	1,152,862,430.71	-114,972,538.32	858,012,699.35
加权平均基金份额本期利润	1.0197	-0.0927	0.4945
本期基金份额净值增长率	65.39%	-5.50%	47.15%
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	1.2069	0.3748	0.2514
期末基金资产净值	2,592,525,647.55	1,180,558,659.58	2,524,619,183.03
期末基金份额净值	2.585	1.563	1.654

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	31.28%	2.15%	13.57%	1.34%	17.71%	0.81%
过去六个月	-4.05%	3.12%	-12.62%	2.14%	8.57%	0.98%
过去一年	65.39%	2.94%	5.68%	1.99%	59.71%	0.95%
过去三年	129.98%	2.09%	41.07%	1.43%	88.91%	0.66%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	158.50%	1.82%	21.66%	1.32%	136.84%	0.50%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×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

上投摩根新兴动力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
（2011年7月13日至2015年12月31日）

注：本基金建仓期自2011年7月13日至2012年1月12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2011年7月13日，图示时间段为2011年7月13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

上投摩根新兴动力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2011年7月13日正式成立，图示的时间段为2011年7月13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过利润分配。

§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		
杜猛	本基金基金经理、国内权益投资一部投资总监、总经理助理	2011-07-13	-	14年	南京大学经济学硕士，先后任职于天同证券、中原证券、国信证券和中银国际证券，任研究员。2007年10月起加入上投摩根基金管理有限公司，历任行业专家、上投摩根中国优势证券投资基金基金经理助理。自2011年7月起担任上投摩根新兴动力混合型证券投资基金基金经理，自2013年3月至2015年9月同时担任上投摩根智选30混合型证券投资基金基金经理，自2013年5月至2014年12月同时担任上投摩根成长动力混合型证券投资基金基金经理，2014年12月起同时担任上投摩根内需动力混合型证券投资基金基金经理。
杨景喻	本基金基金经理助理	2014-12-29	2015-8-3	8年	2009年07月至2011年03月在广发基金管理有限公司担任研究员，自2011年3月起加入上投摩根基金管理有限公司，担任我公司国内权益投资一部基金经理助理，自2015年8月起担任上投摩根中国优势证券投资基金基金经理，2015年12月起同时担任上投摩根新兴服务股票型证券投资基金基金经理。

注：1. 任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
2. 杜猛先生为本基金首任基金经理，其任职日期指本基金基金合同生效之日。
3. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根新兴动力混合型证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

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

公司执行自上而下的三级授权体系，依次为投资决策委员会、投资总监、经理人，经理人在其授权范围内自主决策，投资决策委员会和投资总监均不得干预其授权范围内的投资活动。公司已建立客观的研究方法，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。对于交易所市场投资活动，不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易询价机制，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A股市场先扬后抑，经历了巨大的震荡，年内波动幅度之大在过去的历史中从未发生过。这不仅意味着A股的宏观环境在发生深刻变化，微观环境同样也发生了巨大变化，在未来投资者必须意识并理解这种变化。

虽然中国宏观经济增速仍然处在下行阶段，但我们观察到政府也在做出相应的对策，并对此抱有期望。同时，我们也发现国内的一些新兴产业正在发生积极向上的变化，未来将成为中国经济增长的新动力。本基金依照契约，重点投资了新兴行业的优势公司，取得了明显的超额收益。

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65.39%，同期业绩比较基准收益率为5.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场在2015年跌宕起伏，相信每位投资者都会对这一年记忆深刻，这里面有经验也有教训。展望2016年，市场依旧扑朔迷离，传统经济的低迷可能依然持续。受制于汇率，货币政策可腾挪的空间已经不大，2016年经济将更多的需要财政政策的发力，我们将持续的关注政策可能带来的投资机会。从更长期看，新兴产业的崛起将成为中国未来10-20年经济增长的最大动力，证券市场最大的投资机会也将来源于此。我们将充分深入研究，寻找新兴产业中长期成长的公司，力争为基金持有人创造持续稳定收益。

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、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收益分配。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—上投摩根基金管理有限公司2015年1月1日至2015年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，上投摩根基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，上投摩根基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

上投摩根新兴动力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有限公司审计、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21336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：上投摩根新兴动力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	290,835,156.15	79,018,306.25
结算备付金		20,226,200.34	4,779,988.95
存出保证金		3,268,162.70	808,857.98
交易性金融资产	7.4.7.2	2,336,577,505.28	1,117,909,146.67
其中：股票投资		2,231,483,192.59	1,067,180,178.55
基金投资		-	-
债券投资		105,094,312.69	50,728,968.12
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	-	47,200,000.00
应收证券清算款		-	33,735,284.32
应收利息	7.4.7.5	6,088,352.20	1,664,619.48
应收股利		-	-
应收申购款		786,684.44	687,803.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,657,782,061.11	1,285,804,006.81
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		-	9,999,865.00
应付证券清算款		46,113,536.74	77,621,810.83
应付赎回款		4,346,580.57	11,868,774.64
应付管理人报酬		3,357,702.78	1,761,847.15
应付托管费		559,617.13	293,641.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	10,213,411.71	2,985,146.74
应交税费		-	-
应付利息		-	32,480.28
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	665,564.63	681,781.43
负债合计		65,256,413.56	105,245,347.23
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	1,002,881,036.45	755,408,273.09
未分配利润	7.4.7.10	1,589,644,611.10	425,150,386.49
所有者权益合计		2,592,525,647.55	1,180,558,659.58
负债和所有者权益总计		2,657,782,061.11	1,285,804,006.81

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值2.585元，基金份额总额1,002,881,036.45份，均为A类基金份额。

7.2 利润表

会计主体：上投摩根新兴动力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		1,251,621,047.06	-65,104,701.68
1.利息收入		7,283,060.09	2,819,659.38
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,189,443.61	1,147,426.76
债券利息收入		5,012,913.07	1,239,042.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		80,703.41	433,190.14
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,060,986,739.67	183,966,019.02
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,057,082,109.34	173,936,182.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-137,070.00	1,462,650.66
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	4,041,700.33	8,567,185.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	179,993,991.38	-254,527,486.82
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	3,357,255.92	2,637,106.74
减：二、费用		98,758,616.35	49,867,836.64
1.管理人报酬		40,784,809.24	28,937,219.75
2.托管费		6,797,468.26	4,822,869.88
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	50,702,410.48	15,628,009.60
5.利息支出		17,013.62	32,480.28
其中：卖出回购金融资产支出		17,013.62	32,480.28
6.其他费用	7.4.7.19	456,914.75	447,257.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,152,862,430.71	-114,972,538.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,152,862,430.71	-114,972,538.32

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根新兴动力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）	755,408,273.09	425,150,386.49	1,180,558,659.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,152,862,430.71	1,152,862,430.71
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）	247,472,763.36	11,631,793.90	259,104,557.26
其中：1.基金申购款	1,537,671,971.34	1,945,162,133.33	3,482,834,104.67
2.基金赎回款	-1,290,199,207.98	-1,933,530,339.43	-3,223,729,547.41
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）	1,002,881,036.45	1,589,644,611.10	2,592,525,647.55
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）	1,526,171,449.59	998,447,733.44	2,524,619,183.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-114,972,538.32	-114,972,538.32
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）	-770,763,176.50	-458,324,808.63	-1,229,087,985.13
其中：1.基金申购款	780,214,286.92	430,332,889.99	1,210,547,176.91
2.基金赎回款	-1,550,977,463.42	-888,657,698.62	-2,439,635,162.04
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）	755,408,273.09	425,150,386.49	1,180,558,659.58

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：张璐

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上投摩根新兴动力混合型证券投资基金（原名为上投摩根新兴动力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”）证监许可［2011］604号《关于核准上投摩根新兴动力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《上投摩根新兴动力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，首次募集期间为2011年6月15日至2011年7月8日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集459,128,666.54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（2011）第277号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根新兴动力股票型证券投资基金基金合同》于2011年7月13日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为459,174,298.92份基金份额，其中认购资金利息折合45,632.38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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根新兴动力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国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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的比例范围为基金资产的60%-95%，债券等固定收益类资产占基金资产的0-40%，权证投资占基金资产净值的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。本基金将不低于80%的股票资产投资于新兴产业中的优质上市公司和传统产业中具备新成长动力的上市公司股票。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，上投摩根新兴动力股票型证券投资基金于2015年7月21日公告后更名为上投摩根新兴动力混合型证券投资基金。

根据《关于上投摩根新兴动力混合型证券投资基金增设基金份额类别并修改基金合同的公告》以及经修改的《上投摩根新兴动力混合型证券投资基金基金合同》，自2015年7月24日起，本基金根据基金销售地及申购赎回费率的不同，将基金份额分为不同的类别。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值。仅在中国大陆地区销售，并收取申购和赎回费用的基金份额，称为A类基金份额；仅在中国香港地区销售，并收取申购和赎回费用的基金份额，称为H类基金份额。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根新兴动力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》、财税［2015］101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

7.4.7关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上投摩根基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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	40,784,809.24	28,937,219.75
其中：支付销售机构的客户维护费	4,478,606.30	7,210,183.40

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	6,797,468.26	4,822,869.88

注：支付基金托管人中国农业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

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
基金合同生效日持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	1,075,259.57	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	1,075,259.57	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.11%	-

注：基金管理人上投摩根基金管理有限公司在本会计期间认购本基金的交易委托上投摩根基金直销办理，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
中国农业银行	290,835,156.15	1,883,607.67	79,018,306.25	1,036,952.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600645	中源协和	15/12/30	重大事项	65.01	16/01/04	63.90	758,978	50,352,347.84	49,341,159.78	
600122	宏图高科	15/12/25	重大事项	19.42	未知	未知	1,392,406	24,285,557.09	27,040,524.52	
600271	航天信息	15/10/12	重大事项	71.46	未知	未知	17,054	369,064.53	1,218,678.84	
000002	万科A	15/12/18	重大事项	24.43	未知	未知	44,605	348,227.25	1,089,700.15	
002219	恒康医疗	15/07/08	重大事项	14.90	未知	未知	53,792	527,600.47	801,500.80	
300242	明家科技	15/12/18	重大事项	49.96	16/01/22	44.96	8,445	137,914.85	421,912.20	
600237	铜峰电子	15/09/29	重大事项	5.73	16/01/27	6.30	8,736	57,499.60	50,057.28	

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2,152,266,538.01元，属于第二层次的余额为184,310,967.27元，无属于第三层次的余额（2014年12月31日：第一层次839,215,423.07元，第二层次278,693,723.60元，无第三层次）。

（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	2,231,483,192.59	83.96
	其中：股票	2,231,483,192.59	83.96
2	固定收益投资	105,094,312.69	3.95
	其中：债券	105,094,312.69	3.95
	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	311,061,356.49	11.70
7	其他各项资产	10,143,199.34	0.38
8	合计	2,657,782,061.11	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	2,762.56	0.00
C	制造业	1,561,668,284.61	60.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	52,164,311.86	2.01
F	批发和零售业	27,040,524.52	1.04
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	299,954,865.50	11.57
J	金融业	192.00	0.00
K	房地产业	239,878,208.17	9.25
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	49,341,159.78	1.90
N	水利、环境和公共设施管理业	1,353,511.06	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	77,644.71	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,727.82	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,231,483,192.59	86.07

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	002466	天齐锂业	1,674,366	235,667,014.50	9.09
2	002292	奥飞动漫	3,293,443	170,303,937.53	6.57
3	600745	中茵股份	3,985,779	163,337,223.42	6.30
4	300368	汇金股份	1,664,021	94,383,271.12	3.64
5	002236	大华股份	2,269,733	83,753,147.70	3.23
6	002241	歌尔声学	2,339,720	80,954,312.00	3.12
7	300109	新开源	764,554	79,551,843.70	3.07
8	002709	天赐材料	949,608	78,722,503.20	3.04
9	000687	华讯方舟	2,874,621	77,672,259.42	3.00
10	000718	苏宁环球	5,720,340	75,451,284.60	2.91

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（www.cifm.com）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	002236	大华股份	430,703,224.59	36.48
2	300359	全通教育	257,079,326.37	21.78
3	601021	春秋航空	250,556,776.96	21.22
4	002030	达安基因	249,744,325.68	21.15
5	002450	康得新	212,558,994.01	18.00
6	002657	中科金财	205,995,943.46	17.45
7	002241	歌尔声学	192,474,758.34	16.30
8	000559	万向钱潮	187,115,893.08	15.85
9	300244	迪安诊断	186,312,391.94	15.78
10	300113	顺网科技	176,759,238.00	14.97
11	300017	网宿科技	171,655,675.62	14.54
12	600048	保利地产	170,795,490.79	14.47
13	600745	中茵股份	166,389,569.34	14.09
14	002292	奥飞动漫	164,102,927.79	13.90
15	300109	新开源	151,919,620.94	12.87
16	300016	北陆药业	148,529,367.67	12.58
17	000958	东方能源	145,572,981.71	12.33
18	002466	天齐锂业	145,039,377.40	12.29
19	002189	利达光电	138,329,245.06	11.72
20	300032	金龙机电	137,776,709.82	11.67
21	002273	水晶光电	134,813,441.38	11.42
22	600198	大唐电信	134,118,108.86	11.36
23	300104	乐视网	131,355,118.19	11.13
24	300085	银之杰	128,913,603.34	10.92
25	002175	东方网络	124,637,857.39	10.56
26	000831	五矿稀土	121,976,264.11	10.33
27	000687	华讯方舟	111,189,951.24	9.42
28	002081	金螳螂	110,843,554.69	9.39
29	603766	隆鑫通用	102,369,970.35	8.67
30	300168	万达信息	102,279,220.02	8.66
31	300011	鼎汉技术	101,676,970.16	8.61
32	002538	司尔特	101,408,363.99	8.59
33	600518	康美药业	95,725,011.36	8.11
34	600446	金证股份	95,454,467.62	8.09
35	002280	联络互动	95,396,283.90	8.08
36	601886	江河创建	94,035,509.44	7.97
37	300006	莱美药业	92,605,787.49	7.84
38	000733	振华科技	92,383,087.19	7.83
39	002640	跨境通	91,444,957.82	7.75
40	600122	宏图高科	90,207,986.33	7.64
41	600398	海澜之家	88,663,056.92	7.51
42	300049	福瑞股份	87,480,372.28	7.41
43	002049	同方国芯	87,401,778.41	7.40
44	002467	二六三	86,298,146.07	7.31
45	300004	南风股份	81,960,746.32	6.94
46	600536	中国软件	81,294,634.46	6.89
47	002460	赣锋锂业	80,386,044.84	6.81
48	300392	腾信股份	79,098,489.32	6.70
49	600645	中源协和	78,801,452.42	6.67
50	002276	万马股份	75,868,053.23	6.43
51	300399	京天利	74,679,842.89	6.33
52	601688	华泰证券	74,550,030.63	6.31
53	300351	永贵电器	74,319,363.88	6.30
54	600050	中国联通	73,986,583.90	6.27
55	300101	振芯科技	73,437,532.48	6.22
56	000902	新洋丰	73,427,875.28	6.22
57	600831	广电网络	73,180,931.18	6.20
58	000977	浪潮信息	72,352,078.84	6.13
59	002668	奥马电器	71,764,577.49	6.08
60	002751	易尚展示	71,651,641.19	6.07
61	002635	安洁科技	71,619,896.84	6.07
62	000829	天音控股	69,808,439.10	5.91
63	002400	省广股份	69,532,618.71	5.89
64	300144	宋城演艺	69,528,716.04	5.89
65	600850	华东电脑	68,982,843.48	5.84
66	000718	苏宁环球	67,060,152.18	5.68
67	300203	聚光科技	66,239,695.51	5.61
68	600750	江中药业	65,810,613.72	5.57
69	000738	中航动控	64,282,223.38	5.45
70	002709	天赐材料	64,073,738.48	5.43
71	300235	方直科技	63,902,568.71	5.41
72	600376	首开股份	62,558,233.25	5.30
73	600391	成发科技	62,541,119.58	5.30
74	300231	银信科技	62,255,288.76	5.27
75	300458	全志科技	61,530,390.26	5.21
76	002183	怡亚通	60,920,574.87	5.16
77	601633	长城汽车	60,684,384.35	5.14
78	600369	西南证券	60,168,557.01	5.10
79	300368	汇金股份	59,939,565.51	5.08
80	601788	光大证券	59,899,510.60	5.07
81	300068	南都电源	59,051,075.64	5.00
82	600804	鹏博士	58,983,003.03	5.00
83	601908	京运通	58,746,458.93	4.98
84	600549	厦门钨业	58,207,936.24	4.93
85	300140	启源装备	57,652,149.18	4.88
86	300027	华谊兄弟	57,541,693.84	4.87
87	300465	高伟达	56,798,368.25	4.81
88	601599	鹿港科技	56,591,202.76	4.79
89	002456	欧菲光	54,633,195.75	4.63
90	000998	隆平高科	54,260,992.54	4.60
91	601888	中国国旅	54,150,710.77	4.59
92	601628	中国人寿	53,391,966.12	4.52
93	600406	国电南瑞	53,209,352.26	4.51
94	300055	万邦达	53,169,317.40	4.50
95	600875	东方电气	53,013,485.45	4.49
96	002271	东方雨虹	53,011,378.91	4.49
97	300226	上海钢联	52,885,368.06	4.48
98	002224	三力士	52,880,214.07	4.48
99	002230	科大讯飞	52,345,830.39	4.43
100	000793	华闻传媒	52,267,078.59	4.43
101	000762	西藏矿业	52,029,908.42	4.41
102	002736	国信证券	49,443,859.57	4.19
103	002002	鸿达兴业	49,316,461.60	4.18
104	002318	久立特材	48,614,184.55	4.12
105	300136	信维通信	48,509,900.44	4.11
106	300336	新文化	48,412,800.22	4.10
107	300115	长盈精密	48,411,244.86	4.10
108	300078	思创医惠	48,020,214.70	4.07
109	300159	新研股份	47,500,473.11	4.02
110	000060	中金岭南	47,304,134.58	4.01
111	300254	仟源医药	46,993,599.90	3.98
112	600566	济川药业	46,933,329.51	3.98
113	600109	国金证券	46,770,636.48	3.96
114	300038	梅泰诺	46,702,273.88	3.96
115	002137	麦达数字	46,561,520.93	3.94
116	300063	天龙集团	46,450,884.71	3.93
117	600808	马钢股份	46,345,776.70	3.93
118	300380	安硕信息	46,127,444.92	3.91
119	002642	荣之联	46,117,265.73	3.91
120	002085	万丰奥威	46,006,760.28	3.90
121	002518	科士达	45,714,764.81	3.87
122	600863	内蒙华电	45,595,594.51	3.86
123	600525	长园集团	45,573,317.28	3.86
124	002009	天奇股份	44,990,051.97	3.81
125	600487	亨通光电	44,879,185.30	3.80
126	300296	利亚德	44,481,208.64	3.77
127	600469	风神股份	44,003,219.11	3.73
128	002593	日上集团	43,918,917.66	3.72
129	002222	福晶科技	43,793,763.88	3.71
130	002370	亚太药业	43,708,526.98	3.70
131	002303	美盈森	43,463,319.36	3.68
132	300210	森远股份	43,087,667.62	3.65
133	600705	中航资本	42,843,276.19	3.63
134	600739	辽宁成大	42,766,424.84	3.62
135	600589	广东榕泰	42,266,732.17	3.58
136	300018	中元华电	42,038,454.69	3.56
137	000920	南方汇通	42,007,645.71	3.56
138	002010	传化股份	41,435,375.84	3.51
139	600495	晋西车轴	41,421,744.50	3.51
140	300246	宝莱特	40,883,584.63	3.46
141	600826	兰生股份	40,631,597.72	3.44
142	002389	南洋科技	40,371,401.52	3.42
143	002477	雏鹰农牧	40,043,964.88	3.39
144	300075	数字政通	39,754,808.45	3.37
145	002151	北斗星通	39,741,564.83	3.37
146	002284	亚太股份	39,740,154.08	3.37
147	300297	蓝盾股份	39,735,067.80	3.37
148	002155	湖南黄金	39,659,512.64	3.36
149	300098	高新兴	39,539,450.34	3.35
150	002034	美欣达	39,427,807.40	3.34
151	300041	回天新材	39,338,629.17	3.33
152	002152	广电运通	38,892,320.46	3.29
153	300279	和晶科技	38,735,247.76	3.28
154	600837	海通证券	38,510,237.71	3.26
155	600651	飞乐音响	38,113,332.93	3.23
156	600340	华夏幸福	37,593,467.26	3.18
157	002402	和而泰	37,327,320.46	3.16
158	002418	康盛股份	37,115,617.18	3.14
159	600366	宁波韵升	36,906,618.13	3.13
160	000049	德赛电池	36,640,341.18	3.10
161	002431	棕榈园林	36,257,478.72	3.07
162	300230	永利股份	36,056,831.16	3.05
163	600270	外运发展	36,051,824.01	3.05
164	300427	红相电力	35,952,876.00	3.05
165	002027	七喜控股	34,980,707.56	2.96
166	002217	合力泰	34,944,925.78	2.96
167	603001	奥康国际	34,804,224.13	2.95
168	000971	高升控股	34,689,899.35	2.94
169	601002	晋亿实业	34,682,304.38	2.94
170	300383	光环新网	34,147,191.28	2.89
171	000938	紫光股份	34,065,114.33	2.89
172	000669	金鸿能源	33,687,059.25	2.85
173	002458	益生股份	33,187,930.57	2.81
174	603636	南威软件	33,073,332.00	2.80
175	601918	国投新集	32,316,339.97	2.74
176	002353	杰瑞股份	32,306,679.67	2.74
177	600986	科达股份	32,156,764.15	2.72
178	300377	赢时胜	31,703,289.30	2.69
179	000628	高新发展	31,550,895.22	2.67
180	002339	积成电子	31,294,940.47	2.65
181	600582	天地科技	30,991,751.06	2.63
182	601233	桐昆股份	30,754,116.32	2.61
183	002455	百川股份	30,638,271.25	2.60
184	300160	秀强股份	30,570,965.53	2.59
185	601166	兴业银行	30,509,490.00	2.58
186	000776	广发证券	30,202,414.90	2.56
187	300345	红宇新材	30,172,110.87	2.56
188	300205	天喻信息	30,130,024.94	2.55
189	600010	包钢股份	30,077,003.00	2.55
190	600958	东方证券	30,032,827.50	2.54
191	001696	宗申动力	29,746,909.94	2.52
192	300009	安科生物	29,598,112.15	2.51
193	300310	宜通世纪	29,584,750.16	2.51
194	002529	海源机械	29,520,463.40	2.50
195	300284	苏交科	29,475,890.96	2.50
196	300312	邦讯技术	29,451,460.94	2.49
197	300290	荣科科技	29,381,199.30	2.49
198	600562	国睿科技	29,370,559.98	2.49
199	300227	光韵达	29,072,888.76	2.46
200	002055	得润电子	28,958,876.47	2.45
201	002354	天神娱乐	28,881,926.38	2.45
202	300182	捷成股份	28,430,452.25	2.41
203	002488	金固股份	28,209,922.24	2.39
204	300033	同花顺	28,018,218.62	2.37
205	002047	宝鹰股份	27,898,343.91	2.36
206	300091	金通灵	27,727,015.93	2.35
207	300028	金亚科技	27,343,276.52	2.32
208	300005	探路者	27,323,104.30	2.31
209	002074	国轩高科	27,297,021.48	2.31
210	002019	亿帆鑫富	27,229,550.34	2.31
211	600598	北大荒	27,188,280.85	2.30
212	300171	东富龙	27,086,633.15	2.29
213	000858	五粮液	27,063,004.64	2.29
214	002094	青岛金王	27,013,973.50	2.29
215	600491	龙元建设	26,842,635.28	2.27
216	002741	光华科技	26,835,547.69	2.27
217	601877	正泰电器	26,775,231.66	2.27
218	002655	共达电声	26,705,530.50	2.26
219	300274	阳光电源	26,586,598.20	2.25
220	000606	青海明胶	26,510,684.97	2.25
221	601727	上海电气	26,333,040.11	2.23
222	002153	石基信息	26,308,521.87	2.23
223	600388	龙净环保	26,275,852.51	2.23
224	600838	上海九百	26,238,389.27	2.22
225	600570	恒生电子	26,198,305.85	2.22
226	600780	通宝能源	26,142,570.21	2.21
227	300356	光一科技	26,082,966.15	2.21
228	603885	吉祥航空	26,006,928.16	2.20
229	600171	上海贝岭	25,676,251.08	2.17
230	002024	苏宁云商	25,617,446.00	2.17
231	600030	中信证券	25,474,268.16	2.16
232	002146	荣盛发展	25,294,663.79	2.14
233	300209	天泽信息	25,247,509.09	2.14
234	002510	天汽模	25,170,928.95	2.13
235	002090	金智科技	24,931,134.15	2.11
236	600168	武汉控股	24,905,639.55	2.11
237	002658	雪迪龙	24,862,921.33	2.11
238	002712	思美传媒	24,480,694.31	2.07
239	600643	爱建集团	24,373,817.00	2.06
240	000783	长江证券	24,041,808.25	2.04
241	600129	太极集团	23,826,717.00	2.02
242	300187	永清环保	23,753,532.66	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。

8.4.2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	601021	春秋航空	342,723,162.89	29.03
2	002236	大华股份	337,529,163.84	28.59
3	002241	歌尔声学	255,727,259.71	21.66
4	300168	万达信息	233,935,863.01	19.82
5	002450	康得新	228,120,721.51	19.32
6	300359	全通教育	215,943,360.97	18.29
7	002030	达安基因	212,758,820.50	18.02
8	300032	金龙机电	203,112,388.11	17.20
9	002657	中科金财	198,195,372.74	16.79
10	300017	网宿科技	197,688,373.60	16.75
11	002081	金螳螂	196,809,649.82	16.67
12	300104	乐视网	179,652,209.81	15.22
13	000559	万向钱潮	178,996,560.40	15.16
14	601633	长城汽车	175,431,792.01	14.86
15	600048	保利地产	171,213,976.58	14.50
16	300244	迪安诊断	167,935,235.22	14.23
17	000958	东方能源	162,900,377.68	13.80
18	600446	金证股份	150,011,673.02	12.71
19	300085	银之杰	144,772,287.51	12.26
20	300115	长盈精密	136,877,268.71	11.59
21	002175	东方网络	130,250,439.45	11.03
22	300113	顺网科技	124,639,623.96	10.56
23	002280	联络互动	120,526,495.25	10.21
24	000831	五矿稀土	120,188,912.62	10.18
25	300006	莱美药业	119,908,193.03	10.16
26	600198	大唐电信	119,641,608.01	10.13
27	603766	隆鑫通用	118,674,121.62	10.05
28	300016	北陆药业	116,437,421.86	9.86
29	002276	万马股份	109,353,299.71	9.26
30	000733	振华科技	108,612,385.78	9.20
31	002640	跨境通	105,038,712.73	8.90
32	300399	京天利	104,135,974.14	8.82
33	300004	南风股份	103,522,708.27	8.77
34	300063	天龙集团	103,354,298.13	8.75
35	601886	江河创建	102,217,142.55	8.66
36	600850	华东电脑	102,156,048.13	8.65
37	002538	司尔特	101,280,548.54	8.58
38	000829	天音控股	96,762,284.82	8.20
39	600518	康美药业	96,065,362.57	8.14
40	601599	鹿港科技	95,073,066.97	8.05
41	300226	上海钢联	92,891,894.00	7.87
42	002467	二六三	92,189,518.29	7.81
43	300144	宋城演艺	91,032,914.72	7.71
44	300075	数字政通	85,825,736.38	7.27
45	002635	安洁科技	85,023,593.67	7.20
46	600536	中国软件	84,135,203.74	7.13
47	000925	众合科技	79,033,124.60	6.69
48	300231	银信科技	79,010,994.31	6.69
49	002273	水晶光电	78,668,287.35	6.66
50	002189	利达光电	77,834,948.27	6.59
51	000977	浪潮信息	77,825,582.29	6.59
52	600398	海澜之家	77,516,640.72	6.57
53	300011	鼎汉技术	75,527,570.38	6.40
54	300101	振芯科技	74,909,039.83	6.35
55	002049	同方国芯	74,397,209.53	6.30
56	600804	鹏博士	72,917,968.58	6.18
57	002400	省广股份	71,453,801.63	6.05
58	600750	江中药业	71,407,083.02	6.05
59	300140	启源装备	71,044,291.08	6.02
60	300055	万邦达	70,784,261.21	6.00
61	601688	华泰证券	70,030,954.23	5.93
62	600122	宏图高科	68,484,748.28	5.80
63	002183	怡亚通	67,341,624.57	5.70
64	002751	易尚展示	65,690,323.75	5.56
65	300392	腾信股份	65,021,752.11	5.51
66	300109	新开源	63,994,408.21	5.42
67	002230	科大讯飞	63,538,888.17	5.38
68	601166	兴业银行	63,524,335.27	5.38
69	000902	新洋丰	63,456,895.92	5.38
70	600831	广电网络	63,049,476.85	5.34
71	000738	中航动控	62,501,632.89	5.29
72	300136	信维通信	62,350,707.78	5.28
73	300038	梅泰诺	62,335,035.19	5.28
74	002353	杰瑞股份	62,058,644.98	5.26
75	300465	高伟达	60,471,579.55	5.12
76	600391	成发科技	59,624,057.93	5.05
77	002318	久立特材	59,502,527.33	5.04
78	600050	中国联通	58,924,465.52	4.99
79	601908	京运通	58,836,952.79	4.98
80	600376	首开股份	58,748,123.78	4.98
81	002642	荣之联	58,636,355.95	4.97
82	600369	西南证券	58,593,478.44	4.96
83	002009	天奇股份	58,395,026.98	4.95
84	600645	中源协和	58,364,053.70	4.94
85	002402	和而泰	58,199,345.91	4.93
86	600837	海通证券	58,124,577.52	4.92
87	601788	光大证券	58,085,584.70	4.92
88	002303	美盈森	57,703,801.23	4.89
89	002271	东方雨虹	57,267,428.88	4.85
90	300027	华谊兄弟	56,140,395.86	4.76
91	600340	华夏幸福	55,879,224.13	4.73
92	000998	隆平高科	55,776,623.70	4.72
93	300235	方直科技	55,310,255.41	4.69
94	002736	国信证券	54,951,958.78	4.65
95	601628	中国人寿	54,831,081.62	4.64
96	600549	厦门钨业	54,591,801.80	4.62
97	002593	日上集团	54,275,791.09	4.60
98	300098	高新兴	53,335,770.60	4.52
99	600875	东方电气	53,277,667.85	4.51
100	300351	永贵电器	53,097,045.57	4.50
101	601888	中国国旅	52,874,793.82	4.48
102	300203	聚光科技	52,345,636.63	4.43
103	002224	三力士	52,281,618.73	4.43
104	300078	思创医惠	51,891,817.64	4.40
105	000793	华闻传媒	51,559,519.42	4.37
106	600566	济川药业	51,461,711.44	4.36
107	300041	回天新材	51,261,081.75	4.34
108	300068	南都电源	51,197,912.26	4.34
109	000555	神州信息	51,042,002.28	4.32
110	600487	亨通光电	50,749,252.60	4.30
111	300336	新文化	50,488,973.85	4.28
112	002389	南洋科技	49,803,646.03	4.22
113	300297	蓝盾股份	49,617,261.69	4.20
114	000060	中金岭南	49,421,515.19	4.19
115	002222	福晶科技	48,909,824.31	4.14
116	600739	辽宁成大	48,037,142.26	4.07
117	600589	广东榕泰	47,485,764.96	4.02
118	000762	西藏矿业	47,479,109.48	4.02
119	002477	雏鹰农牧	47,404,110.33	4.02
120	002010	传化股份	47,321,237.55	4.01
121	300296	利亚德	46,864,027.80	3.97
122	002518	科士达	46,661,549.50	3.95
123	300230	永利股份	46,469,413.59	3.94
124	600388	龙净环保	46,369,179.61	3.93
125	600525	长园集团	46,326,842.29	3.92
126	002027	七喜控股	46,187,098.67	3.91
127	002002	鸿达兴业	46,114,356.34	3.91
128	600109	国金证券	46,017,783.72	3.90
129	002456	欧菲光	45,881,485.45	3.89
130	002741	光华科技	45,829,985.25	3.88
131	300380	安硕信息	45,766,061.40	3.88
132	002370	亚太药业	45,541,479.07	3.86
133	000687	华讯方舟	45,323,253.08	3.84
134	600808	马钢股份	45,064,479.91	3.82
135	300254	仟源医药	43,588,908.56	3.69
136	000971	高升控股	43,486,488.72	3.68
137	300210	森远股份	43,383,098.26	3.67
138	000938	紫光股份	43,170,937.85	3.66
139	603636	南威软件	43,162,095.00	3.66
140	000920	南方汇通	42,724,442.58	3.62
141	300049	福瑞股份	42,603,203.09	3.61
142	600495	晋西车轴	42,441,602.49	3.60
143	002085	万丰奥威	41,862,531.10	3.55
144	600705	中航资本	41,216,720.38	3.49
145	300246	宝莱特	40,876,224.13	3.46
146	603001	奥康国际	40,572,462.73	3.44
147	600863	内蒙华电	40,060,783.94	3.39
148	002488	金固股份	39,534,350.70	3.35
149	300159	新研股份	39,061,676.66	3.31
150	600030	中信证券	38,732,317.81	3.28
151	300458	全志科技	38,659,655.95	3.27
152	002155	湖南黄金	38,282,535.89	3.24
153	002458	益生股份	38,048,684.52	3.22
154	600366	宁波韵升	37,779,504.26	3.20
155	300279	和晶科技	37,557,761.25	3.18
156	002152	广电运通	36,894,183.96	3.13
157	600406	国电南瑞	36,506,752.68	3.09
158	600826	兰生股份	36,370,662.43	3.08
159	600270	外运发展	35,909,123.02	3.04
160	600958	东方证券	35,866,280.00	3.04
161	000669	金鸿能源	35,430,723.81	3.00
162	002019	亿帆鑫富	35,379,328.19	3.00
163	600469	风神股份	35,157,280.76	2.98
164	000049	德赛电池	35,099,612.84	2.97
165	601318	中国平安	34,993,810.35	2.96
166	002217	合力泰	34,618,418.62	2.93
167	600562	国睿科技	34,379,451.19	2.91
168	600582	天地科技	34,360,540.64	2.91
169	002047	宝鹰股份	33,942,632.91	2.88
170	300018	中元华电	33,881,116.28	2.87
171	300166	东方国信	33,771,162.47	2.86
172	300160	秀强股份	33,511,667.22	2.84
173	002024	苏宁云商	33,487,024.32	2.84
174	300033	同花顺	33,225,030.92	2.81
175	001696	宗申动力	33,205,137.26	2.81
176	600571	信雅达	33,094,851.75	2.80
177	600651	飞乐音响	32,873,261.52	2.78
178	300284	苏交科	32,748,932.23	2.77
179	002510	天汽模	32,711,861.08	2.77
180	600570	恒生电子	32,570,557.39	2.76
181	600986	科达股份	32,109,965.66	2.72
182	300182	捷成股份	32,023,085.48	2.71
183	002339	积成电子	31,413,248.31	2.66
184	000628	高新发展	31,344,737.68	2.66
185	603885	吉祥航空	31,143,113.08	2.64
186	601002	晋亿实业	31,064,446.82	2.63
187	300091	金通灵	30,397,359.38	2.57
188	002340	格林美	30,246,658.83	2.56
189	002292	奥飞动漫	30,168,392.68	2.56
190	002354	天神娱乐	30,133,109.87	2.55
191	300028	金亚科技	29,940,563.80	2.54
192	000776	广发证券	29,928,268.07	2.54
193	300345	红宇新材	29,626,253.42	2.51
194	600661	新南洋	29,448,299.55	2.49
195	300005	探路者	29,397,757.36	2.49
196	600780	通宝能源	29,322,876.35	2.48
197	002658	雪迪龙	28,878,328.52	2.45
198	300171	东富龙	28,733,544.11	2.43
199	601233	桐昆股份	28,678,849.68	2.43
200	002425	凯撒股份	28,294,618.20	2.40
201	600491	龙元建设	28,293,479.91	2.40
202	600643	爱建集团	28,243,528.89	2.39
203	300205	天喻信息	28,188,965.08	2.39
204	600650	锦江投资	28,007,177.27	2.37
205	002055	得润电子	27,957,455.90	2.37
206	600010	包钢股份	27,626,932.11	2.34
207	000858	五粮液	27,247,691.36	2.31
208	601877	正泰电器	27,230,774.97	2.31
209	300290	荣科科技	27,123,730.87	2.30
210	601727	上海电气	27,028,894.72	2.29
211	300312	邦讯技术	26,821,883.86	2.27
212	600838	上海九百	26,707,980.24	2.26
213	300274	阳光电源	26,633,886.88	2.26
214	600171	上海贝岭	26,618,818.07	2.25
215	002348	高乐股份	26,580,050.98	2.25
216	000988	华工科技	26,440,777.65	2.24
217	300187	永清环保	26,420,482.79	2.24
218	002074	国轩高科	26,369,696.77	2.23
219	000783	长江证券	26,165,960.92	2.22
220	002712	思美传媒	26,161,311.76	2.22
221	601918	国投新集	26,122,167.13	2.21
222	300227	光韵达	26,056,726.18	2.21
223	600129	太极集团	26,050,020.60	2.21
224	300067	安诺其	25,909,436.77	2.19
225	002529	海源机械	25,818,179.29	2.19
226	002090	金智科技	25,673,328.62	2.17
227	002044	美年健康	25,490,492.80	2.16
228	002034	美欣达	24,972,930.43	2.12
229	002455	百川股份	24,794,936.47	2.10
230	002146	荣盛发展	24,316,695.13	2.06
231	600757	长江传媒	23,950,226.37	2.03
232	600168	武汉控股	23,945,308.31	2.03

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	16,613,107,580.80
卖出股票的收入（成交）总额	16,688,678,153.71

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	104,347,433.70	4.02
	其中：政策性金融债	104,347,433.70	4.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	746,878.99	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	105,094,312.69	4.05

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	1,043,370	104,347,433.70	4.02
2	128009	歌尔转债	5,317	746,878.99	0.03

8.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12投资组合报告附注

8.12.1报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,268,162.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,088,352.20
5	应收申购款	786,684.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,143,199.34

8.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128009	歌尔转债	746,878.99	0.03

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
33,294	30,121.98	733,638,517.17	73.15%	269,242,519.28	26.85%

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	2,343,128.56	0.2336%

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	>100
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（2011年7月13日）基金份额总额	459,174,298.92
本报告期期初基金份额总额	755,408,273.09
本报告期基金总申购份额	1,537,671,971.34
减：本报告期基金总赎回份额	1,290,199,207.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,002,881,036.45

§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：

无。

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100,000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	
国金证券	1	10,995,461,395.27	33.02%	10,101,941.25	32.99%	-
兴业证券	1	9,916,674,238.03	29.78%	9,104,972.33	29.73%	-
瑞银证券	1	4,729,536,213.60	14.20%	4,342,548.04	14.18%	-
华创证券	1	4,699,911,452.19	14.11%	4,335,803.07	14.16%	-
海通证券	1	2,960,202,435.42	8.89%	2,739,888.53	8.95%	-

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	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	18,991,672.70	17.70%	573,300,000.00	81.72%	-	-
华创证券	88,308,228.10	82.30%	128,200,000.00	18.28%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

§12影响投资者决策的其他重要信息

无。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一六年三月三十日