

## 上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金

### 2016 第二季度 报告

2016年6月30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：二〇一六年七月十九日**

**81 重要提示**

基金管理人的董事会及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法律责任。

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7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现，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。

本报告中期财务资料未经审计。

本报告期内自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	000328
交易代码	000328
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月25日
报告期末基金份额总额	1,281,690,322.91份
投资目标	通过投资于符合政策扶持和经济发展方向、具有长期成长潜力的上市公司，充分把握国家宏观经济结构调整的投资机会，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将以经济结构作为行业配置和个股选择的主要依据，重点投资于受益于经济结构调整和转型升级的行业，具有良好的基本面和成长能力的上市公司，力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中国总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合基金产品，风险和收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币型基金，属于中等风险和收益水平的基金产品。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现	
3.1 主要财务指标	
单位：人民币元	
主要财务指标	报告期 2016年4月1日-2016年6月30日
1.本期利润总额	57,063,655.19
2.本期净利润	-35,598,781.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0280
4.期末基金净值	1,892,081,270.62
5.期末基金份额净值	1.476

注：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。

上述基金净值指标不包括持有人认购及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 本报告期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	净值增长率①	净值增长率扣除基金费用后的净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率扣除基金费用后的净值增长率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.67%	1.44%	-1.74%	0.81%	0.07%	0.63%

3.2.2 自基金合同生效以来至2013年11月25日、2014年11月25日、2015年11月25日及2016年6月30日，上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

2013年11月25日至2016年6月30日

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**  
本基金本报告期末未持有债券。

**5.5 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债券投资明细**  
本基金本报告期末未持有债券。

**5.6 报告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。

**5.7 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。

**5.8 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权证投资明细**  
本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 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。

**5.10 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。

**5.11 投资组合报告附注**

5.11.1 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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票中不存在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

注：本基金建仓自2013年11月25日至2014年5月24日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。本基金成立以来于2013年11月25日、2014年11月25日、2015年11月25日及2016年6月30日。

§4 管理人报告	
4.1 基金经理小组简介	
姓名	职务
卢杨	本基金基金经理

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，基金管理人不存在违反基金合同约定行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规，《上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金合同》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及法律法规的要求。

**4.3 公平交易专项说明**

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续严格落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范范围内上市股票、债券的一级市场和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式及时执行执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究、投资、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在购买同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、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。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

**4.3.2 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、交易方向等的分析，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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：无。

**4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年2季度以来，在经历了1季度的大幅下挫之后，市场迎来了短暂的休养生息，流动性维持了宽松的格局，实体经济表现依然疲软，使得市场重现“脱实向虚”，主题炒作此起彼伏。从4月1日截止到6月30日，创业板综合指数上涨了6.7%，万得的新股指数涨幅更是达到惊人的19.4%。锂电池、OLED等行业个股涨幅也都超过了30%。

组合中的白酒股持仓较重，对于热门主题参与程度不高，因此组合涨幅较为有限。

展望2016年下半年，市场对于热门主题板块的炒作已经达到了较为疯狂的程度，而对于经济增速下滑、汇率波动的风险反映不够充分，在此背景之下，我们一方面对于热门主题板块参与愈加谨慎，另一方面，秉承

§6 开放式基金份额变动	
本报告期初基金份额总额	1,451,430,002.92
报告期内基金份额净增加额	48,571,028.61
报告期内基金份额减少额	218,310,706.62
报告期末基金份额总额	1,281,690,322.91

§7 基金管理人持有本基金基金份额情况	
基金管理人	持有本基金基金份额情况
基金管理人	持有本基金基金份额情况

§8 备查文件目录	
1. 中国证监会批准上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；	
2. 上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同；	
3. 上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议；	
4. 上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则；	
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；	
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照；	
7. 存放在基金管理人或基金托管人处；	
8. 查阅方式	
投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。	

上投摩根基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金管理人代码	20100000
基金资产净值	1,892,081,270.62
基金份额净值	1.476

东方基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金管理人代码	20100000
基金资产净值	1,892,081,270.62
基金份额净值	1.476

东方赢家保本混合型证券投资基金	
基金名称	东方赢家保本混合型证券投资基金
基金简称	东方赢家保本混合
基金代码	001317
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金管理人代码	20100000
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金托管人代码	20100000
基金资产净值	585,831,421.03
基金份额净值	1.029

东方赢家保本混合型证券投资基金	
基金名称	东方赢家保本混合型证券投资基金
基金简称	东方赢家保本混合
基金代码	001380
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金管理人代码	20100000

东方金钰股份	
基金名称	东方金钰股份
基金简称	东方金钰股份
基金代码	002480
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金管理人代码	20100000

东方金钰股份	
基金名称	东方金钰股份
基金简称	东方金钰股份
基金代码	002480
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金管理人代码	20100000

证券代码:600086 证券简称:东方金钰 公告编号:临2016-53

### 东方金钰股份有限公司关于延期回复上海证券交易所问询函暨继续停牌的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

东方金钰股份有限公司（以下简称“公司”）于2016年7月18日因有媒体爆料关于江苏东方金钰智能机器人项目建设情况，紧急停牌一天，后于同日收到上海证券交易所上证公函【2016】J856号《关于对东方金钰股份有限公司媒体爆料事项的问询函》（以下简称“问询函”），根据相关要求，现将《问询函》全文公告如下：“2016年7月17日，有媒体爆料称，你公司董事长于2016年7月15日考察了江苏东方金钰智能机器人项目建设情况，该项目达产后可产移动式智能服务机器人3000台套。对此，你公司核实并披露以下事项。

一、请你公司是否及时履行了信息披露义务。

二、你公司目前主营业务为翡翠珠宝及黄金饰品批发零售业务，上述项目与公司主营业务差异较大，请你公司说明是否具备相关资质和人才储备，是否进行可行性论证，并充分揭示相关不确定性风险。

三、请你公司具体说明：a)该项目的经营模式、盈利模式和分成安排；b)相关技术支持和来源，如涉及专利技术等，请进一步说明权属情况。

特此公告。

东方金钰股份有限公司董事会  
2016年7月19日

价值投资的理念，从小市值的成长股中精选行业趋势向好、基本面扎实的个股坚定持有，力争为投资者带来更好的回报。

**4.2 报告期内基金的业绩表现**

本报告期末本基金份额净值增长率为-1.67%，同期业绩比较基准收益率为-1.74%。

**4.3 报告期末基金持有人数或基金资产净值预警说明**

无。

§5 投资组合报告			
5.1 报告期末基金资产组合情况			
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,666,552,044.87	84.21
2	其中:股票	1,666,552,044.87	84.21
3	其中:沪股通	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	6 银行存款和结算备付金合计	204,342,151.96	10.33
11	7 其他各项资产	108,083,520.81	5.46
12	8 合计	1,978,977,717.64	100.00

§2 报告期末按行业分类的股票投资组合			
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,296,416,679.51	68.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	信息技术业	-	-
G	房地产业	-	-
H	交通运输、仓储和邮政业	36,994,409.06	1.96
I	批发和零售业	-	-
J	信息传输、软件和信息技术服务业	87,989,483.79	4.45
K	金融业	-	-
L	房地产业	36,132,305.95	1.91
M	租赁和商务服务业	209,019,206.56	11.05
N	科学研究和技术服务业	-	-
O	水利、环境和公共设施管理业	-	-
P	国防军工、医药和医疗器械	-	-
Q	教育	-	-
R	卫生和社会工作	-	-
S	文化、体育和娱乐业	-	-
T	综合	-	-
合计		1,666,552,044.87	88.08

§3 报告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					
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002236	大洋股份	11,502,071	150,677,130.10	7.96
2	300115	长药股份	7,011,055	144,427,733.00	7.63
3	002400	许继电气	8,428,640	119,096,683.20	6.20
4	002450	康强股份	6,563,708	108,819,406.80	5.75
5	300058	蓝色光标	9,286,816	89,621,523.36	4.75
6	002344	朗科信息	2,486,768	81,091,186.08	4.32
7	300203	聚信股份	2,623,576	69,262,406.40	3.66
8	300077	银信股份	2,473,443	63,301,590.81	3.36
9	001223	荣信股份	3,001,320	62,274,482.80	3.30
10	300136	信邦股份	2,861,642	59,980,016.32	3.17

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**  
本基金本报告期末未持有债券。

**5.5 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债券投资明细**  
本基金本报告期末未持有债券。

**5.6 报告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。

**5.7 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。

**5.8 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权证投资明细**  
本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 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。

**5.10 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。

**5.11 投资组合报告附注**

5.11.1 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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票中不存在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

§6 开放式基金份额变动	
本报告期初基金份额总额	1,451,430,002.92
报告期内基金份额净增加额	48,571,028.61
报告期内基金份额减少额	218,310,706.62
报告期末基金份额总额	1,281,690,322.91

§7 基金管理人持有本基金基金份额情况	
基金管理人	持有本基金基金份额情况
基金管理人	持有本基金基金份额情况

§8 备查文件目录	
1. 中国证监会批准上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；	
2. 上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同；	
3. 上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议；	
4. 上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则；	
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；	
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照；	
7. 存放在基金管理人或基金托管人处；	
8. 查阅方式	
投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。	

上投摩根基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金管理人代码	20100000
基金资产净值	1,892,081,270.62
基金份额净值	1.476

东方基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金管理人代码	20100000
基金资产净值	1,892,081,270.62
基金份额净值	1.476

东方赢家保本混合型证券投资基金	
基金名称	东方赢家保本混合型证券投资基金
基金简称	东方赢家保本混合
基金代码	001317
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金管理人代码	20100000
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金托管人代码	20100000
基金资产净值	585,831,421.03
基金份额净值	1.029

东方赢家保本混合型证券投资基金	
基金名称	东方赢家保本混合型证券投资基金
基金简称	东方赢家保本混合
基金代码	001380
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金管理人代码	20100000

东方金钰股份	
基金名称	东方金钰股份
基金简称	东方金钰股份
基金代码	002480
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金管理人代码	20100000

东方金钰股份	
基金名称	东方金钰股份
基金简称	东方金钰股份
基金代码	002480
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金管理人代码	20100000

证券代码:600086 证券简称:东方金钰 公告编号:临2016-53

### 东方金钰股份有限公司关于延期回复上海证券交易所问询函暨继续停牌的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

东方金钰股份有限公司（以下简称“公司”）于2016年7月18日因有媒体爆料关于江苏东方金钰智能机器人项目建设情况，紧急停牌一天，后于同日收到上海证券交易所上证公函【2016】J856号《关于对东方金钰股份有限公司媒体爆料事项的问询函》（以下简称“问询函”），根据相关要求，现将《问询函》全文公告如下：“2016年7月17日，有媒体爆料称，你公司董事长于2016年7月15日考察了江苏东方金钰智能机器人项目建设情况，该项目达产后可产移动式智能服务机器人3000台套。对此，你公司核实并披露以下事项。

一、请你公司是否及时履行了信息披露义务。

二、你公司目前主营业务为翡翠珠宝及黄金饰品批发零售业务，上述项目与公司主营业务差异较大，请你公司说明是否具备相关资质和人才储备，是否进行可行性论证，并充分揭示相关不确定性风险。

三、请你公司具体说明：a)该项目的经营模式、盈利模式和分成安排；b)相关技术支持和来源，如涉及专利技术等，请进一步说明权属情况。

特此公告。

东方金钰股份有限公司董事会  
2016年7月19日

上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金	
基金名称	上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	上投摩根转型动力灵活配置混合
基金代码	000328
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金管理人代码	20100000
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金托管人代码	3100000001
基金资产净值	1,892,081,270.62
基金份额净值	1.476

上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金	
基金名称	上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	上投摩根转型动力灵活配置混合
基金代码	000328
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金管理人代码	20100000
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金托管人代码	3100000001
基金资产净值	1,892,081,270.62
基金份额净值	1.476

上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金	
基金名称	上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	上投摩根转型动力灵活配置混合
基金代码	000328
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金管理人代码	20100000
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金托管人代码	3100000001
基金资产净值	1,892,081,270.62
基金份额净值	