

上投摩根内需动力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

重要提示
基金管理人及基金托管人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责任。

基金管理人上投摩根基金管理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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。

本报告期内2016年6月1日起至6月30日止
2.2 基金产品概况
上投摩根内需动力
基金代码 377020
基金运作方式 契约型开放式

投资目标
本基金重点投资于国内具有竞争优势的上市公司,把握中国经济和行业快速增长带来的投资机会,追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略
在投资组合构建和管理的过程中,本基金将采取“自上而下”与“自下而上”相结合的方法,基金管理人在宏观分析的基础上,选择具有可持续增长前景的优势上市公司股票进行配置。

业绩比较基准
沪深300指数收益率*40%+上证国债指数收益率*20%
本基金是一只混合型基金,其预期风险和预期收益高于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于较高风险、较高预期收益的基金产品。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期
2016年4月1日至2016年6月30日

1.本期已实现收益 56,537,762.85
2.本期利润 257,284,800.47
3.加权平均基金份额本期利润 0.0946
4.期末基金资产净值 2,901,972,656.39

3.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
上投摩根内需动力混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率对比图
(2007年4月13日至2016年6月30日)



4.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

Table listing fund managers and their details. Includes names like 杜佳, 刘辉, and their respective roles and tenures.

4.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.3 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.4 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.5 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.10 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.11 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.13 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.14 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.15 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.16 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

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 报告期内基金投资策略和运作分析
2016年二季度, A股市场无论是主板还是创业板走势都比较平稳,主要原因在于美国加息预期放缓,通胀水平稳定以及经济数据保持平稳。二季度,本基金仍然保持持有优质的新兴产业上市公司,同时对于市场的结构性机会也进行了一定的配置,并取得了一定的投资收益。

展望三季度,从宏观的角度来看,预期经济增速仍会趋于平稳,通胀水平稳定,汇率走势平稳,因此我们判断 A股整体有可能保持平稳。二季度中,市场可能的投资机会集中在少数几个细分的行业板块。具体来看,本基金仍保持持有优质的新兴产业上市公司,并继续加大对其中优质的公司进行重点配置。同时我们看好 A股新兴产业的投资机会,以及三季度新兴产业投资带来的投资机会。最后,我们一直看好有良好成长空间背景下相关优质公司的投资机会。三季度,本基金仍将保持持有优质企业,努力为投资者创造较好的投资回报。

本报告期末基金份额净值为9.67%,同期业绩比较基准收益率为-1.46%。
4.5 报告期内基金持有人人数或基金资产净值变动说明
无。

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 2,539,279,566.35 86.57

5.2 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 0.00 0.00

5.3 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 300073 当升科技 3,896,758 260,848,982.52 8.99

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十名债券投资明细
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投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.11 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权。

5.12 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.13 报告期末本基金投资的衍生品投资情况说明
本基金本报告期末未持有衍生品。

5.14 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。

5.15 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.16 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权。

5.17 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.18 报告期末本基金投资的衍生品投资情况说明
本基金本报告期末未持有衍生品。

5.19 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。

5.20 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.21 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权。

5.22 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.23 报告期末本基金投资的衍生品投资情况说明
本基金本报告期末未持有衍生品。

5.24 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。

5.25 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.26 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权。

5.27 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.28 报告期末本基金投资的衍生品投资情况说明
本基金本报告期末未持有衍生品。

5.29 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。

5.30 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.31 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权。

5.32 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.33 报告期末本基金投资的衍生品投资情况说明
本基金本报告期末未持有衍生品。

5.34 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。

上投摩根卓越制造股票型证券投资基金

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

重要提示
基金管理人及基金托管人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责任。

基金管理人上投摩根基金管理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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。

本报告期内2016年4月1日起至6月30日止
2.2 基金产品概况
上投摩根卓越制造
基金代码 001126
基金运作方式 契约型开放式

投资目标
本基金通过投资于国内具有竞争优势的上市公司,把握中国经济和行业快速增长带来的投资机会,追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略
在投资组合构建和管理的过程中,本基金将采取“自上而下”与“自下而上”相结合的方法,基金管理人在宏观分析的基础上,选择具有可持续增长前景的优势上市公司股票进行配置。

业绩比较基准
沪深300指数收益率*40%+上证国债指数收益率*20%
本基金是一只混合型基金,其预期风险和预期收益高于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于较高风险、较高预期收益的基金产品。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期
2016年4月1日至2016年6月30日

1.本期已实现收益 11,862,434.14
2.本期利润 39,945,006.36
3.加权平均基金份额本期利润 0.0218
4.期末基金资产净值 1,879,617,120.28

3.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
上投摩根卓越制造股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率对比图
(2015年4月14日至2016年6月30日)



4.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

Table listing fund managers and their details. Includes names like 吴文君, 许悦, and their respective roles and tenures.

4.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.3 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.4 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.5 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.10 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.11 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.13 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.14 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.15 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

4.16 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期末持有基金份额总额 2,785,899,658.56
本报告期末持有基金份额总额占基金份额总额比例 14.811324%

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 1,673,526,877.52 88.36

5.2 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 0.00 0.00

5.3 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 300145 华信新材 5,338,930 116,815,788.40 6.21

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十名债券投资明细
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投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.11 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权。

5.12 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.13 报告期末本基金投资的衍生品投资情况说明
本基金本报告期末未持有衍生品。

5.14 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。

5.15 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.16 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权。

5.17 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.18 报告期末本基金投资的衍生品投资情况说明
本基金本报告期末未持有衍生品。

5.19 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。

5.20 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.21 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权。

5.22 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.23 报告期末本基金投资的衍生品投资情况说明
本基金本报告期末未持有衍生品。

5.24 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。

5.25 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.26 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权。

5.27 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.28 报告期末本基金投资的衍生品投资情况说明
本基金本报告期末未持有衍生品。

5.29 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。

5.30 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.31 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权。

5.32 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.33 报告期末本基金投资的衍生品投资情况说明
本基金本报告期末未持有衍生品。

5.34 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。

5.35 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.36 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权。

5.37 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
本基金本报告期末未持有资产支持证券。