

上投摩根成长先锋混合型证券投资基金
2016 年半年度报告摘要
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：二〇一六年八月二十九日

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。本半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 8 月 26 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	上投摩根成长先锋混合
基金主代码	378010
交易代码	378010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 9 月 20 日
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	875,236,004.43 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于国内市场上展现最佳成长特质的股票，积极捕捉高成长性上市公司所带来的投资机会，努力实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	（1）股票投资策略 本基金采取定量分析与定性分析相结合方式，挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司，主动出击、积极管理将是本基金运作的重要特色。 （2）固定收益类投资策略 本基金以股票投资为主，一般市场情况下，基金管理人不会积极追求大类资产配置，但为进一步控制投资风险，优化组合流动性管理，本基金将适度防御性资产配置，进行债券、货币市场工具等品种投资。 在券种选择上，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是主动型混合型基金，属于证券投资基金的较高风险品种，预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券基金和货币市场基金。

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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cifm.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-241,987,661.09
本期利润	-256,688,328.58
加权平均基金份额本期利润	-0.2911
本期基金份额净值增长率	-19.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.1872
期末基金资产净值	1,039,056,441.77
期末基金份额净值	1.1872

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，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
过去一个月	5.74%	1.93%	-0.31%	0.79%	6.05%	1.14%
过去三个月	1.18%	1.75%	-1.74%	0.81%	2.92%	0.94%
过去六个月	-19.68%	2.55%	-12.46%	1.48%	-7.22%	1.07%
过去一年	-32.40%	2.97%	-22.94%	1.84%	-9.46%	1.13%
过去三年	-11.24%	2.19%	35.31%	1.47%	-46.55%	0.72%
自基金合同生效起至今	94.96%	1.79%	93.87%	1.56%	1.09%	0.23%

注：本基金的业绩比较基准于 2013 年 12 月 7 日由原“富时中国 A600 成长指数×80%+同业存款利率×20%”变更为“沪深 300 指数收益率×80%+中债总指数收益率×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

上投摩根成长先锋混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2006 年 9 月 20 日至 2016 年 6 月 30 日）



注：本基金合同生效日为 2006 年 9 月 20 日，图示时间段为 2006 年 9 月 20 日至 2016 年 6 月 30 日。

本基金建仓期自 2006 年 9 月 20 日至 2007 年 3 月 19 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金的业绩比较基准于 2013 年 12 月 7 日由原“富时中国 A600 成长指数×80%+同业存款利率×20%”变更为“沪深 300 指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%”。

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 2016 年 6 月底，

公司管理的基金共有四十九只，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、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金及上投摩根策略精选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		
吴文哲	本基金基金经理	2015-01-09	-	12 年	吴文哲先生，自 2001 年 7 月至 2002 年 7 月在招商银行上海分行担任职员，2004 年 6 月至 2007 年 7 月在华宝兴业基金管理有限公司担任研究员，2007 年 7 月至 2014

					年 1 月在交银施罗德基金管理有限公司担任高级研究员，自 2014 年 1 月起加入上投摩根基金管理有限公司，担任研究部副总监兼高级行业专家一职，自 2015 年 1 月起担任上投摩根成长先锋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卓越制造股票型证券投资基金基金经理。
朱晓龙	本基金基金经理助理	2015-6-29		9 年	清华大学工商管理硕士，2007 年 7 月至 2011 年 8 月在平安资产管理有限责任公司担任研究员，2011 年 8 月起加入上投摩根基金管理有限公司，任行业专家。

注：1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《上投摩根成长先锋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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《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，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、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、交易方向等的抽样分析，未发现存在异常交易行为。

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 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

上半年市场主线主要有三点：景气度高的成长性行业、供给端改革产能收缩带来价格提升的周期性行业、产品价格稳步提升的消费性行业。第一类行业的代表是新能源汽车放量带来的锂电池产业链，以及半导体产业链向国内转移带来的电子上游产业链放量预期。2016 年 1 季度在经济增速企稳预期以及供给端改革共同作用下，黑色金属产业链价格反弹明显。消费品价格稳定反弹上半年则集中体现在复苏的白酒行业上。

本基金 2016 年 1 月份配置和 2015 年年底配置相近，遭遇较大回撤。2016 年 2 月份开始积极配置周期涨价方向。待 2016 年 4 月市场调整，开始着手布局市场反弹后的结构，以计算机为主，期初取得较好超额收益，但 2016 年 6 月后配置锂电池和电子行业不足。

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-19.68%，同期业绩比较基准收益率为-12.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计下半年国内经济、流动性、风险偏好格局难有明显改变，存量博弈市场下，市场难有系统性机会，上述主线预期也会贯穿下半年。成长性行业方面，锂电池、电子行业预计将继续有行情演绎，电力改革、互联网带来的新应用也或将有所表现。由于国内经济难有大幅上行，黑色金属产业链价格弹性降低，预期贵金属受国际金融市场波动将会持续表现、石化产业链受油价中期上行预期价格走强、国际农产品价格走强的预期也十分明显，下半年大宗价格的弹性主要关注这三方面。消费品提价预期可能扩散到医药等行业。上述也是下半年主要看好的行业方向。

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投资基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见,评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员,参加估值委员会会议,参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上投摩根成长先锋混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	97,909,069.45	126,838,041.97
结算备付金		7,318,826.37	16,663,848.91
存出保证金		1,128,865.54	1,648,224.27
交易性金融资产	6.4.7.2	914,889,317.71	1,097,869,901.32
其中：股票投资		914,889,317.71	1,051,229,121.82
基金投资		-	-
债券投资		-	46,640,779.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		25,921,857.27	72,318,572.67
应收利息	6.4.7.5	24,614.16	1,631,379.56
应收股利		-	-
应收申购款		124,230.16	13,171.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,047,316,780.66	1,316,983,140.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		910,186.27	-
应付赎回款		863,797.59	1,562,597.06
应付管理人报酬		1,250,789.72	1,660,245.51
应付托管费		208,464.94	276,707.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,970,568.09	7,819,288.04
应交税费		626,000.00	626,000.00

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	430,532.28	650,744.74
负债合计		8,260,338.89	12,595,582.96
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	875,236,004.43	882,454,104.24
未分配利润	6.4.7.10	163,820,437.34	421,933,453.22
所有者权益合计		1,039,056,441.77	1,304,387,557.46
负债和所有者权益总计		1,047,316,780.66	1,316,983,140.42

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1872 元，基金份额总额 875,236,004.43 份。

6.2 利润表

会计主体：上投摩根成长先锋混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-234,765,819.87	843,275,311.64
1.利息收入		881,325.79	2,093,888.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	612,203.05	781,002.43
债券利息收入		269,122.74	1,134,657.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	178,229.50
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-220,956,837.99	1,122,775,318.75
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-222,664,501.75	1,116,493,190.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-412,515.70	2,780,989.72
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,120,179.46	3,501,138.12
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-14,700,667.49	-281,744,683.93
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	10,359.82	150,787.89
减：二、费用		21,922,508.71	44,488,101.29
1. 管理人报酬		7,355,759.63	16,723,402.34
2. 托管费		1,225,959.95	2,787,233.77

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	13,150,170.11	24,757,703.43
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	190,619.02	219,761.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-256,688,328.58	798,787,210.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-256,688,328.58	798,787,210.35

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根成长先锋混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	882,454,104.24	421,933,453.22	1,304,387,557.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-256,688,328.58	-256,688,328.58
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）	-7,218,099.81	-1,424,687.30	-8,642,787.11
其中：1.基金申购款	22,323,020.78	2,527,212.63	24,850,233.41
2.基金赎回款	-29,541,120.59	-3,951,899.93	-33,493,020.52
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）	875,236,004.43	163,820,437.34	1,039,056,441.77
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	1,605,874,695.59	451,297,585.16	2,057,172,280.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	798,787,210.35	798,787,210.35
三、本期基金份额交易产	-620,420,755.08	-504,758,204.80	-1,125,178,959.88

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	32,679,074.35	27,212,636.56	59,891,710.91
2.基金赎回款	-653,099,829.43	-531,970,841.36	-1,185,070,670.79
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）	985,453,940.51	745,326,590.71	1,730,780,531.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上投摩根成长先锋混合型证券投资基金(原上投摩根成长先锋股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第 182 号《关于同意上投摩根成长先锋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《上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,480,643,191.07 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(2006)第 130 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 9 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,480,692,618.04 份基金份额，其中认购资金利息折合 49,426.97 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 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》，上投摩根成长先锋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成长先锋混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根成长先锋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、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金投资组合

中股票投资比例为基金总资产的 70%-95%，债券及其它短期金融工具为 0-30%，并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金投资重点是具有高成长潜力的上市公司股票，80%以上的非现金股票基金资产属于上述投资方向。本基金的业绩比较基准于 2013 年 12 月 7 日由原“富时中国 A600 成长指数×80%+同业存款利率×20%”变更为“沪深 300 指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%”。

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 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 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》、《上投摩根成长先锋混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年上半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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，本基金的基金管理人接到股东上海国际信托有限公司（以下简称“上海信托”）通知，2016 年 3 月 15 日上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”）完成了收购上海信托股权的过户手续，工商变更登记手续已办理完毕，浦发银行成为上海信托控股股东，亦成为我公司关联方。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易**

无。

6.4.8.2 关联方报酬**6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,355,759.63	16,723,402.34
其中：支付销售机构的客户维护费	849,144.78	1,958,234.14

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 X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,225,959.95	2,787,233.77

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30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	97,909,069.45	533,406.75	121,031,460.40	664,582.32

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	网下中签	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	网下中签	10.05	10.05	926.00	9,306.30	9,306.30	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	网下中签	12.98	12.98	7,670.00	99,556.60	99,556.60	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	网下中签	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-

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。

6.4.9.2 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
600455	博通股份	2016-05-05	重大事项	49.14	-	-	307,105.00	13,265,171.23	15,091,139.70	-
600556	慧球科技	2016-01-19	重大事项	16.19	2016-07-07	14.22	659,400.00	17,500,327.74	10,675,686.00	-
600576	万家文化	2016-04-11	重大事项	21.78	-	-	294,355.00	6,669,189.47	6,411,051.90	-
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项	20.92	2016-07-01	23.01	24,202.00	83,980.94	506,305.84	-
603918	金桥信息	2016-03-28	重大事项	34.10	2016-08-15	32.50	149,686.00	4,542,379.58	5,104,292.60	-
000002	万科A	2015-12-18	重大事项	18.20	2016-07-04	21.99	567,676.00	9,046,461.30	10,331,703.20	-
000505	*ST珠江	2016-05-03	重大事项	9.84	-	-	99,950.00	1,036,323.50	983,508.00	-
000638	万方发展	2016-01-05	重大事项	23.66	2016-07-25	24.75	222,274.00	6,166,944.47	5,259,002.84	-
000651	格力电器	2016-02-22	重大事项	19.22	-	-	510,728.00	10,724,812.92	9,816,192.16	-
000802	北京文化	2016-06-01	重大事项	23.52	2016-08-22	21.86	177,468.00	4,076,869.79	4,174,047.36	-
002059	云南旅游	2016-06-01	重大事项	8.56	-	-	9,500.00	95,380.00	81,320.00	-
002175	东方网络	2016-05-09	重大事项	46.09	-	-	85,534.00	4,035,563.28	3,942,262.06	-
002355	兴民钢圈	2016-05-12	重大事项	19.35	-	-	238,578.00	4,872,809.96	4,616,484.30	-
002567	唐人神	2016-05-16	重大事项	13.98	2016-07-29	13.23	688,395.00	9,170,882.27	9,623,762.10	-
002766	索菱股份	2016-03-21	重大事项	31.74	2016-07-05	34.91	406,513.00	12,092,420.66	12,902,722.62	-
300351	永贵电器	2016-06-29	重大事项	33.93	2016-07-04	33.30	146,619.00	4,262,927.86	4,974,782.67	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告**7.1 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	914,889,317.71	87.36
	其中：股票	914,889,317.71	87.36
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	105,227,895.82	10.05
7	其他各项资产	27,199,567.13	2.60
8	合计	1,047,316,780.66	100.00

7.2 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、渔业	22,050,523.35	2.12
B	采矿业	-	-
C	制造业	450,781,030.53	43.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	506,305.84	0.05
F	批发和零售业	11,670,054.74	1.12
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	368,727,798.31	35.49
J	金融业	9,262,174.05	0.89
K	房地产业	11,315,211.20	1.09
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	81,320.00	0.01

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	22,748,938.36	2.19
S	综合	17,725,835.23	1.71
	合计	914,889,317.71	88.05

7.3 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	300365	恒华科技	1,267,180	57,973,485.00	5.58
2	300113	顺网科技	1,103,446	41,886,810.16	4.03
3	300302	同有科技	1,181,507	38,363,532.29	3.69
4	300368	汇金股份	1,120,164	33,000,031.44	3.18
5	300222	科大智能	990,870	27,139,929.30	2.61
6	601689	拓普集团	798,001	26,294,132.95	2.53
7	300469	信息发展	203,552	25,794,109.44	2.48
8	002405	四维图新	1,000,293	24,607,207.80	2.37
9	600570	恒生电子	359,073	23,975,304.21	2.31
10	002425	凯撒股份	1,027,130	22,596,860.00	2.17

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）的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600446	金证股份	134,521,882.33	10.31
2	600570	恒生电子	105,818,206.94	8.11
3	600104	上汽集团	94,811,718.46	7.27
4	002001	新和成	65,145,838.18	4.99
5	002590	万安科技	59,835,491.51	4.59
6	300365	恒华科技	58,406,494.22	4.48
7	600115	东方航空	56,775,307.35	4.35

8	300469	信息发展	55,573,555.20	4.26
9	300479	神思电子	55,150,099.61	4.23
10	002477	雏鹰农牧	52,584,714.29	4.03
11	002425	凯撒股份	52,485,858.13	4.02
12	300113	顺网科技	51,991,415.33	3.99
13	002777	久远银海	51,590,816.90	3.96
14	300368	汇金股份	47,683,591.87	3.66
15	002284	亚太股份	44,139,039.71	3.38
16	600893	中航动力	44,089,026.27	3.38
17	300100	双林股份	42,019,233.19	3.22
18	300327	中颖电子	41,863,942.41	3.21
19	002488	金固股份	41,577,175.87	3.19
20	000651	格力电器	40,152,321.37	3.08
21	300222	科大智能	39,077,896.90	3.00
22	600518	康美药业	38,810,226.48	2.98
23	300448	浩云科技	38,614,885.28	2.96
24	002502	骅威文化	37,438,360.87	2.87
25	002714	牧原股份	36,083,571.95	2.77
26	002709	天赐材料	34,551,917.69	2.65
27	300377	赢时胜	34,306,361.07	2.63
28	002355	兴民钢圈	33,059,062.42	2.53
29	603799	华友钴业	32,713,117.82	2.51
30	600029	南方航空	32,618,993.79	2.50
31	300302	同有科技	31,897,072.44	2.45
32	600085	同仁堂	29,351,898.44	2.25
33	300340	科恒股份	29,015,808.50	2.22
34	300401	花园生物	28,541,310.26	2.19
35	002626	金达威	27,553,098.50	2.11
36	300096	易联众	27,375,819.11	2.10
37	000738	中航动控	27,019,497.86	2.07
38	300364	中文在线	26,634,963.99	2.04
39	600677	航天通信	26,334,479.46	2.02
40	600519	贵州茅台	26,236,131.63	2.01
41	002655	共达电声	26,197,919.10	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。

7.4.2 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	600446	金证股份	118,878,646.19	9.11
2	600104	上汽集团	92,677,641.36	7.11
3	600570	恒生电子	85,272,748.39	6.54
4	002001	新和成	63,562,214.38	4.87
5	600115	东方航空	52,367,421.75	4.01
6	002292	奥飞娱乐	49,891,441.81	3.82
7	002709	天赐材料	49,241,144.05	3.78
8	002329	皇氏集团	48,874,429.28	3.75
9	002777	久远银海	48,567,741.86	3.72
10	300479	神思电子	44,761,064.53	3.43
11	600893	中航动力	42,617,775.02	3.27
12	002466	天齐锂业	40,125,504.70	3.08
13	600701	*ST 工新	38,861,624.26	2.98
14	002590	万安科技	38,348,482.73	2.94
15	300368	汇金股份	38,288,955.41	2.94
16	002502	骅威文化	38,126,293.52	2.92
17	300104	乐视网	37,632,592.43	2.89
18	600518	康美药业	37,325,651.40	2.86
19	002284	亚太股份	36,909,442.08	2.83
20	002714	牧原股份	36,908,531.14	2.83
21	300100	双林股份	36,201,220.99	2.78
22	300339	润和软件	35,638,331.57	2.73
23	300469	信息发展	35,037,183.34	2.69
24	002668	奥马电器	32,683,711.90	2.51
25	300078	思创医惠	32,461,028.31	2.49
26	300113	顺网科技	32,438,615.90	2.49
27	002655	共达电声	32,400,329.57	2.48
28	002477	雏鹰农牧	31,652,124.65	2.43
29	600029	南方航空	31,154,645.14	2.39
30	600136	当代明诚	29,308,605.82	2.25
31	002425	凯撒股份	29,190,590.76	2.24
32	600085	同仁堂	28,752,088.42	2.20
33	600391	成发科技	28,734,828.87	2.20
34	002626	金达威	28,332,577.56	2.17
35	600677	航天通信	27,793,495.32	2.13
36	300327	中颖电子	27,680,222.09	2.12
37	603799	华友钴业	27,332,210.55	2.10
38	300401	花园生物	27,107,016.57	2.08
39	000651	格力电器	26,845,529.02	2.06
40	000738	中航动控	26,755,736.93	2.05
41	300096	易联众	26,610,454.52	2.04
42	300465	高伟达	26,273,141.38	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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,393,622,894.53
卖出股票的收入（成交）总额	4,292,234,793.20

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。

7.5 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。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的恒生电子股份有限公司（以下称“恒生电子”）于2015年9月7日收到恒生电子控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公司（以下简称“恒生网络”）的通知，恒生网络与相关人员

于2015年9月7日收到中国证券监督管理委员会(以下简称“证监会”)行政处罚事先告知书(处罚字[2015]68号),主要内容如下:

恒生网络开发运营的HOMS 系统,包含子账户开立、提供委托交易、存储、查询、清算等多种证券业务属性的功能。恒生网络明知客户经营方式,仍向不具有经营证券资质的客户销售该系统、提供相关服务,并获取收益的行为违反了《证券法》第一百二十二条的规定,构成《证券法》第一百九十七条所述非法经营证券业务的行为。

中国证券监督管理委员会拟决定:

一、没收恒生网络违法所得132,852,384.06元,并处以398,557,152.18元罚款;

二、对相关人员给予警告,并处以罚款。

对上述股票投资决策程序的说明:本基金管理人在投资恒生电子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他分析,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。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	1,128,865.54
2	应收证券清算款	25,921,857.27
3	应收股利	-
4	应收利息	24,614.16
5	应收申购款	124,230.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,199,567.13

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

8 基金份额持有人信息**8.1 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
39,075	22,398.87	17,156,876.44	1.96%	858,079,127.99	98.04%

8.2 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	964.75	0.0001%

8.3 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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006 年 9 月 20 日）基金份额总额	5,480,692,618.04
本报告期期初基金份额总额	882,454,104.24
本报告期基金总申购份额	22,323,020.78
减：本报告期基金总赎回份额	29,541,120.59
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	875,236,004.43
-------------	----------------

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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 2016 年 2 月 3 日发布公告：因届龄退休，陈开元先生自 2016 年 2 月 2 日起不再担任本公司董事长，由穆矢先生继任该职务。

基金托管人：

无。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
国泰君安	2	1,716,113,210.63	19.76%	1,598,218.78	19.76%	-
中信证券	1	1,654,794,688.75	19.06%	1,541,094.97	19.06%	-
国金证券	1	1,448,137,507.00	16.68%	1,348,651.00	16.68%	-
兴业证券	1	1,212,207,224.56	13.96%	1,128,928.09	13.96%	-
高华证券	1	1,099,277,277.52	12.66%	1,023,757.88	12.66%	-

中泰证券	1	523,318,912.29	6.03%	487,366.49	6.03%	-
安信证券	1	509,366,261.74	5.87%	474,370.00	5.87%	-
平安证券	1	257,258,492.35	2.96%	239,584.28	2.96%	-
民生证券	1	158,373,759.45	1.82%	147,490.24	1.82%	-
中金公司	1	105,262,554.59	1.21%	98,032.50	1.21%	-
国开证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-

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. 2016 年上半年度基金新增中泰证券 1 个席位，无注销席位。

10.7.2 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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-

11 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

二〇一六年八月二十九日