

上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金
2015 年年度报告
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 重要提示及目录

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。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	错误!未定义书签。
1.1 重要提示	错误!未定义书签。
§2 基金简介	错误!未定义书签。
2.1 基金基本情况	错误!未定义书签。
2.2 基金产品说明	错误!未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人	错误!未定义书签。
2.4 信息披露方式	错误!未定义书签。
2.5 其他相关资料	错误!未定义书签。
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	错误!未定义书签。
3.1 主要会计数据和财务指标	错误!未定义书签。
3.2 基金净值表现	错误!未定义书签。
3.3 过去三年基金的利润分配情况	错误!未定义书签。
§4 管理人报告	错误!未定义书签。
4.1 基金管理人及基金经理情况	错误!未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	错误!未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	错误!未定义书签。
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	错误!未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	错误!未定义书签。
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	错误!未定义书签。
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	错误!未定义书签。
§5 托管人报告	错误!未定义书签。
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
§6 审计报告	错误!未定义书签。
§7 年度财务报表	错误!未定义书签。
7.1 资产负债表	错误!未定义书签。
7.2 利润表	错误!未定义书签。
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	错误!未定义书签。
7.4 报表附注	错误!未定义书签。
§8 投资组合报告	错误!未定义书签。
8.1 期末基金资产组合情况	错误!未定义书签。
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	错误!未定义书签。
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	错误!未定义书签。
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	错误!未定义书签。
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	错误!未定义书签。
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	错误!未定义书签。
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	错误!未定义书签。
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	错误!未定义书签。
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	错误!未定义书签。

8.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	错误!未定义书签。
8.11	投资组合报告附注	错误!未定义书签。
§9	基金份额持有人信息	错误!未定义书签。
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	错误!未定义书签。
9.2	期末上市基金前十名持有人	错误!未定义书签。
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	错误!未定义书签。
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	错误!未定义书签。
§10	开放式基金份额变动	错误!未定义书签。
§11	重大事件揭示	错误!未定义书签。
11.1	基金份额持有人大会决议	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	错误!未定义书签。
11.4	基金投资策略的改变	错误!未定义书签。
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	错误!未定义书签。
11.8	其他重大事件	错误!未定义书签。
§12	发起式基金发起资金持有份额情况	错误!未定义书签。
§13	影响投资者决策的其他重要信息	错误!未定义书签。
§14	备查文件目录	错误!未定义书签。
14.1	备查文件目录	错误!未定义书签。
14.2	存放地点	错误!未定义书签。
14.3	查阅方式	错误!未定义书签。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金
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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

	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
注册地址		上海市富城路99号20楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市富城路99号20楼	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		穆矢	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》《中国证券报》《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国·上海市

注册登记机构	上投摩根基金管理有限公司	上海市富城路 99 号 20 楼
--------	--------------	------------------

§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
本期加权平均净值利润率	5.19%	10.56%	-0.06%
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
期末可供分配利润	53,858,480.34	4,946,064.89	-807,710.99
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
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	27.71%	18.72%	-0.30%

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	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

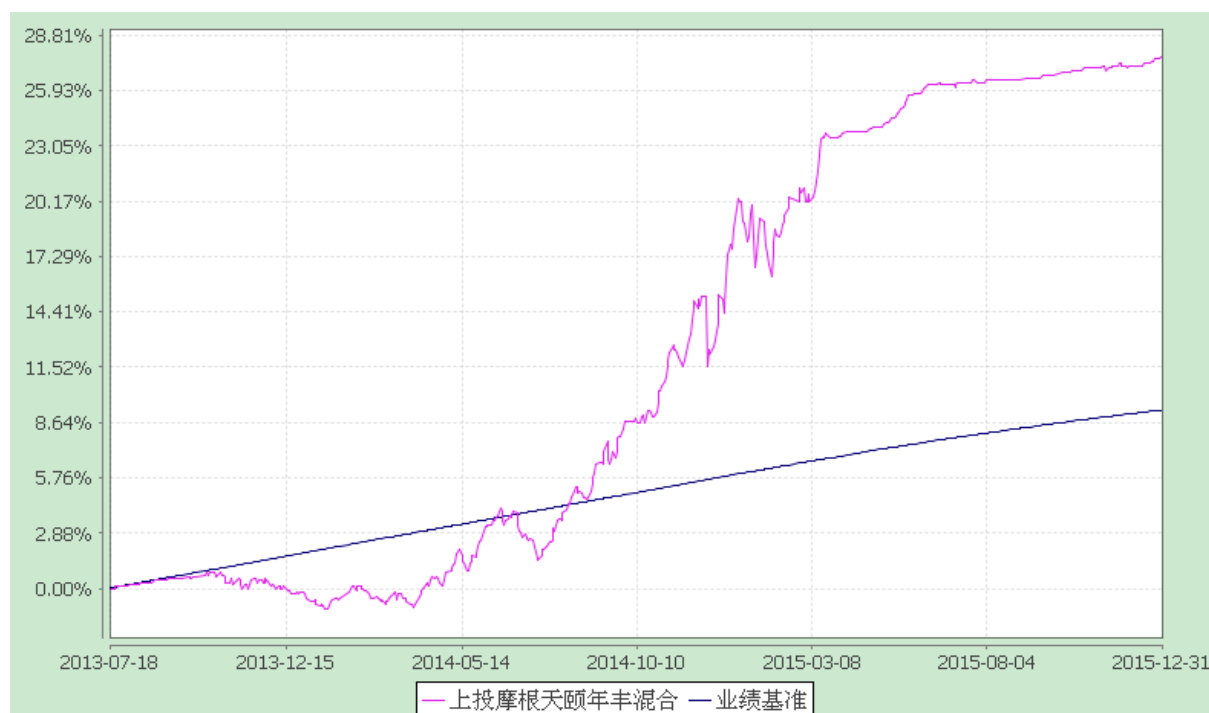
	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	0.78%	0.05%	0.65%	0.01%	0.13%	0.04%
过去六个月	1.17%	0.04%	1.40%	0.01%	-0.23%	0.03%
过去一年	7.58%	0.29%	3.16%	0.01%	4.42%	0.28%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生 效起至今	27.71%	0.29%	9.04%	0.01%	18.67%	0.28%

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)



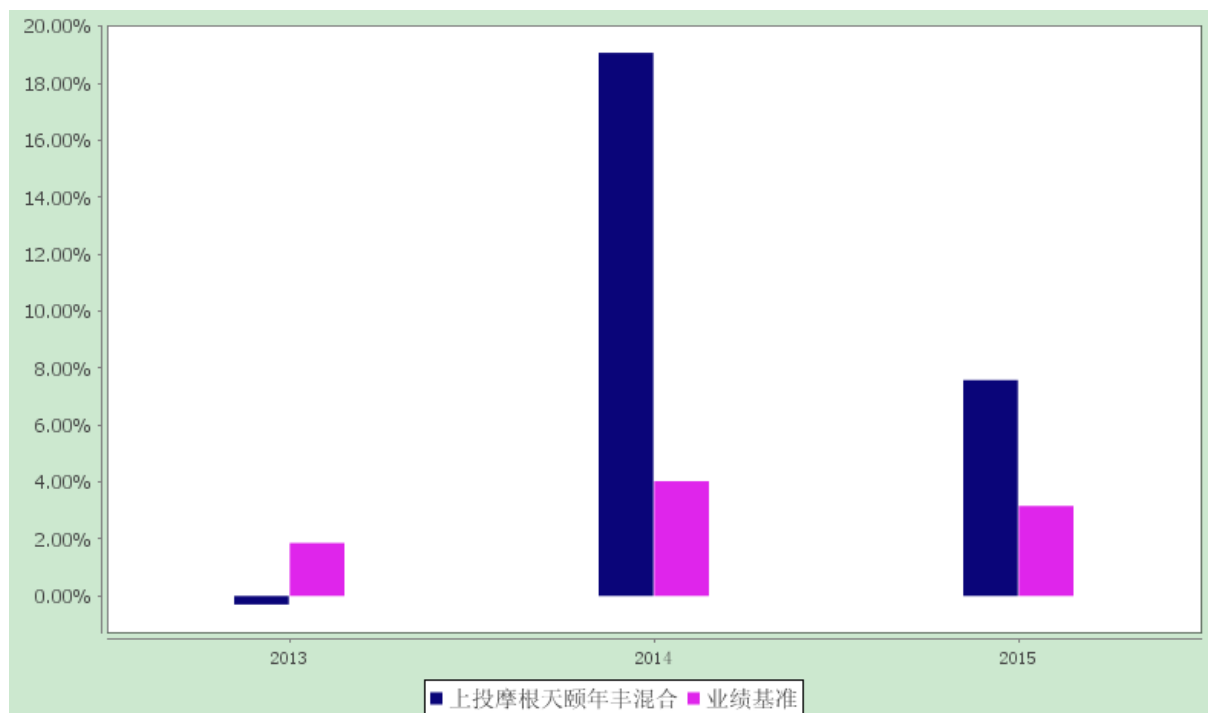
注：本基金建仓期自 2013 年 7 月 18 日至 2014 年 1 月 17 日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

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对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 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劲上涨势头，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在加大，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

信用利差水平推至历史低位水平。三季度本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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中以“坚守三条底线、保障合规诚信、支持业务发展、提高工作水平”为总体目标，一切从合规运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部门按照工作计划结合实际情况对公司各项业务进行全面的监察稽核工作，保障和促进公司各项业务合法合规运作，推动内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议并督促有关部门改进。

在本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作贯穿三条主线：

1. 注意密切追踪监管法规政策变化和监管新要求，组织员工学习理解监管精神，推动公司各部门完善制度建设和业务流程，防范日常运作中的违规行为发生。

2. 继续紧抓员工行为、公平交易、利益冲突等方面的日常监控，坚守“三条底线”不动摇；进一步加强内部合规培训和合规宣传，强化合规意识，规范员工行为操守，严格防范利益冲突。

3. 针对风险控制的需求和重点，强化内部审计，提高内部审计工作的水平和效果；按照监管部门的要求，严格推行风险控制自我评估制度，对控制不足的风险点，制订了进一步的控制措施。

在本报告期内的监察稽核工作中，未发现基金投资运作存在违法违规或未履行基金合同承诺从而影响基金份额持有人利益的情形。

公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。本基金运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。我们将继续以合规运作和风险管理为核心，提

高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金份额持有人的利益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

普华永道中天审字(2016)第 21346 号上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金全体基金份额持有人：：我们审计了后附的上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金(以下简称“上投摩根天颐年丰混合型基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是上投摩根天颐年丰混合型基金的基金管理人上投摩根基金管理有限责任公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述上投摩根天颐年丰混合型基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了上投摩根天颐年丰混合型基金 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。

普华永道中天

注册会计师

会计师事务所(特殊普通合伙)

陈 玲

中国·上海市

注册会计师

2016 年 3 月 29 日

曹 阳

§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 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	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 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		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	上年度可比期间
		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	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		
	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		
	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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票

估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 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)，按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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，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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
活期存款	152,765,812.83	5,942,847.59
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	152,765,812.83	5,942,847.59

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2015 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	30,653,156.37	36,337,958.07	5,684,801.70	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	64,249,849.14	64,437,966.90	188,117.76
	银行间市场	170,988,001.09	170,935,000.00	-53,001.09
	合计	235,237,850.23	235,372,966.90	135,116.67
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计		265,891,006.60	271,710,924.97	5,819,918.37
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		5,771,602.53	6,440,527.00	668,924.47
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	50,628,105.12	51,536,193.10	908,087.98
	银行间市场	-	-	-
	合计	50,628,105.12	51,536,193.10	908,087.98
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		56,399,707.65	57,976,720.10	1,577,012.45

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	1,092,000,000.00	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	1,092,000,000.00	-
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	-	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	128,768.94	440.93
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	26,628.03	657.27
应收债券利息	6,509,113.38	1,357,379.68
应收买入返售证券利息	205,031.62	-
应收申购款利息	-	102.44
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	52.80	20.79
合计	6,869,594.77	1,358,601.11

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	274,058.02	110,314.84
银行间市场应付交易费用	14,866.38	960.00
合计	288,924.40	111,274.84

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日

应付赎回费	36,986.51	1,588.36
预提费用	175,000.00	300,000.00
合计	211,986.51	301,588.36

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,555,460.69	42,555,460.69
本期申购	6,327,042,692.70	6,327,042,692.70
本期赎回（以“-”号填列）	-4,557,606,013.18	-4,557,606,013.18
本期末	1,811,992,140.21	1,811,992,140.21

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,946,064.89	992,301.51	5,938,366.40
本期利润	132,580,470.91	4,242,905.92	136,823,376.83
本期基金份额交易产生的变动数	349,959,308.89	-31,900,270.02	318,059,038.87
其中：基金申购款	708,187,950.38	-112,731,943.76	595,456,006.62
基金赎回款	-358,228,641.49	80,831,673.74	-277,396,967.75
本期已分配利润	-406,962,301.76	-	-406,962,301.76
本期末	80,523,542.93	-26,665,062.59	53,858,480.34

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	6,480,224.21	62,383.90
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	1,490,027.79	819,722.20
结算备付金利息收入	504,612.68	31,641.20
其他	112,595.59	743.03
合计	8,587,460.27	914,490.33

注：其他存款利息收入均为有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款产生的利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	732,586,515.98	82,661,379.55
减：卖出股票成本总额	617,821,990.96	84,366,853.07
买卖股票差价收入	114,764,525.02	-1,705,473.52

7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,636,989,224.25	836,597,400.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,623,582,353.43	813,304,422.07
减：应收利息总额	11,967,687.67	15,175,216.47
买卖债券差价收入	1,439,183.15	8,117,761.84

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	95,439.53	44,381.47
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	95,439.53	44,381.47

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
1.交易性金融资产	4,242,905.92	3,764,050.43
——股票投资	5,015,877.23	1,159,885.55
——债券投资	-772,971.31	2,604,164.88
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	4,242,905.92	3,764,050.43

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
基金赎回费收入	5,152,002.10	252,776.77
转换费收入	863,556.50	41,956.03
其他	140,517.50	-
基金转换费收入	-	-

合计	6,156,076.10	294,732.80
----	--------------	------------

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	2,195,886.70	461,571.01
银行间市场交易费用	16,312.50	2,725.00
合计	2,212,199.20	464,296.01

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
审计费用	85,000.00	60,000.00
信息披露费	90,000.00	240,000.00
银行费用	29,367.20	8,701.85
债券帐户维护费	21,200.00	12,000.00
其他	-	400.00
合计	225,567.20	321,101.85

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

无。

7.4.8.2资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2016 年 1 月 12 日宣告 2015 年度第 4 次分红，向截至 2016 年 1 月 14 日

止在本基金注册登记人上投摩根基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.24 元。

本基金的基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》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，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定自 2016 年 2 月 15 日起对本基金增加收取销售服务费的 C 类份额，并对本基金的基金合同作相应修改于 2016 年 2 月 15 日宣告本基金增加 C 类份额并修改基金合同。

7.4.9 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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12

	月31日	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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.9\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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
	2015年1月1日至2015年12月31日	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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	利润分配合计	备注
1	2015-01-15	2015-01-15	0.600	2,073,353.78	388,226.42	2,461,580.20	-
2	2015-04-13	2015-04-13	0.620	98,806,212.45	106,269,807.91	205,076,020.36	-
3	2015-07-10	2015-07-10	0.430	87,001,309.48	75,025,227.22	162,026,536.70	-
4	2015-10-20	2015-10-20	0.240	36,812,686.87	585,477.63	37,398,164.50	-
合计			1.890	224,693,562.58	182,268,739.18	406,962,301.76	-

7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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	-
7.4.12.1.2 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“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”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监查和风险评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管，并提出内控建议。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年12月31日	上年末 2014年12月31日
A-1	70,505,000.00	-

A-1 以下	-	-
未评级	100,430,000.00	2,442,500.00
合计	170,935,000.00	2,442,500.00

注：未评级的债券为国债和政策性金融债。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015年12月31日	上年末 2014年12月31日
AAA	5,943,738.20	6,753,738.30
AAA 以下	22,840,267.40	36,780,850.20
未评级	35,653,961.30	5,559,104.60
合计	64,437,966.90	49,093,693.10

注：未评级的债券为国债和政策性金融债。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方

式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于 2015 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 157,499,535.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	3 个月以内	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	152,765,812.83	-	-	-	-	152,765,812.83
结算备付金	53,793,976.88	-	-	-	-	53,793,976.88
存出保证金	106,823.70	-	-	-	-	106,823.70
交易性金融资产	37,741,961.30	174,021,961.90	18,134,056.70	5,474,987.00	36,337,958.07	271,710,924.97
买入返售金融资产	1,092,000,000.00	-	-	-	-	1,092,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	477,675,888.34	477,675,888.34
应收利息	-	-	-	-	6,869,594.77	6,869,594.77
资产总计	1,336,408,574.71	174,021,961.90	18,134,056.70	5,474,987.00	520,883,441.18	2,054,923,021.49
负债						

卖出回购金融资产款	157,499,535.00	-	-	-	-	157,499,535.00
应付赎回款	-	-	-	-	29,089,258.52	29,089,258.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,542,832.60	1,542,832.60
应付托管费	-	-	-	-	428,564.61	428,564.61
应付交易费用	-	-	-	-	288,924.40	288,924.40
应付利息	-	-	-	-	11,299.30	11,299.30
其他负债	-	-	-	-	211,986.51	211,986.51
负债总计	157,499,535.00	-	-	-	31,572,865.94	189,072,400.94
利率敏感度缺口	1,178,909,039.71	174,021,961.90	18,134,056.70	5,474,987.00	489,310,575.24	1,865,850,620.55
上年度末						
2014 年 12 月 31 日	3 个月以内	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	5,942,847.59	-	-	-	-	5,942,847.59
结算备付金	1,327,705.55	-	-	-	-	1,327,705.55
存出保证金	41,890.27	-	-	-	-	41,890.27
交易性金融资产	12,288,438.30	3,116,568.60	28,989,231.00	7,141,955.20	6,440,527.00	57,976,720.10
应收利息	-	-	-	-	1,358,601.11	1,358,601.11
应收申购款	-	-	-	-	47,370.63	47,370.63
资产总计	19,600,881.71	3,116,568.60	28,989,231.00	7,141,955.20	7,846,498.74	66,695,135.25
负债						
卖出回购金融资产款	12,400,000.00	-	-	-	-	12,400,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	4,707,793.33	4,707,793.33
应付赎回款	-	-	-	-	626,264.15	626,264.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	39,064.08	39,064.08
应付托管费	-	-	-	-	10,851.15	10,851.15
应付交易费用	-	-	-	-	111,274.84	111,274.84
应付利息	-	-	-	-	4,472.25	4,472.25
其他负债	-	-	-	-	301,588.36	301,588.36
负债总计	12,400,000.00	-	-	-	5,801,308.16	18,201,308.16
利率敏感度缺口	7,200,881.71	3,116,568.60	28,989,231.00	7,141,955.20	2,045,190.58	48,493,827.09

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日

1.市场利率下降 25 个基点	-	增加约 39
2.市场利率上升 25 个基点	-	减少约 38

注:于 2015 年 12 月 31 日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 12.61%,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,采用“自上而下”的策略,通过对宏观经济情况及政策的分析,结合证券市场运行情况,做出资产配置及组合构建的决定;通过对单个证券的定性分析及定量分析,选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化,对投资策略、资产配置、投资组合进行修正,来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中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%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2015 年 12 月 31 日		2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	36,337,958.07	1.95	6,440,527.00	13.28
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	36,337,958.07	1.95	6,440,527.00	13.28

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.95%(2014 年 12 月 31 日：13.28%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14 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所有股票投资明细

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
11	603800	道森股份	19,344	1,043,221.92	0.06
12	002292	奥飞动漫	20,000	1,034,200.00	0.06
13	002077	大港股份	50,000	997,500.00	0.05
14	603999	读者传媒	16,713	982,724.40	0.05
15	002546	新联电子	30,000	980,100.00	0.05
16	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.05
17	002373	千方科技	20,000	915,000.00	0.05
18	000888	峨眉山 A	61,254	907,171.74	0.05
19	002280	联络互动	14,000	859,600.00	0.05

20	002063	远光软件	40,000	845,600.00	0.05
21	600325	华发股份	50,000	815,000.00	0.04
22	002345	潮宏基	48,110	812,096.80	0.04
23	002273	水晶光电	20,000	812,000.00	0.04
24	002781	奇信股份	21,600	807,192.00	0.04
25	300369	绿盟科技	16,000	778,240.00	0.04
26	600061	国投安信	30,000	777,900.00	0.04
27	300366	创意信息	10,000	777,000.00	0.04
28	002133	广宇集团	80,000	772,000.00	0.04
29	300147	香雪制药	30,000	750,300.00	0.04
30	002655	共达电声	30,000	739,800.00	0.04
31	600643	爱建集团	49,660	727,519.00	0.04
32	000802	北京文化	20,000	677,600.00	0.04
33	603936	博敏电子	12,448	638,333.44	0.03
34	300493	润欣科技	7,248	299,632.32	0.02
35	002782	可立克	13,312	283,146.24	0.02
36	002786	银宝山新	9,630	263,476.80	0.01
37	002780	三夫户外	3,566	222,304.44	0.01
38	603778	乾景园林	7,140	195,136.20	0.01
39	002787	华源包装	10,011	163,880.07	0.01
40	300494	盛天网络	6,251	162,901.06	0.01
41	603299	井神股份	23,499	124,779.69	0.01
42	300492	山鼎设计	6,219	109,392.21	0.01
43	300490	华自科技	7,127	93,292.43	0.00
44	300491	通合科技	6,015	90,766.35	0.00
45	002777	久远银海	4,264	70,356.00	0.00
46	002785	万里石	12,000	70,080.00	0.00
47	002778	高科石化	5,600	47,600.00	0.00

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	4,439,920.56	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	2,647,868.00	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所有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。

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%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1.	上投摩根基金管理有限公司关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金2015年分红规则设定的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券时报》和《中国证券报》	2015年1月9日
2.	上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金分红公告	同上	2015年1月13日
3.	上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2015年1月17日
4.	上投摩根基金管理有限公司关于调整旗下基金所持交易所固定收益品种估值方法的公告	同上	2015年3月24日
5.	上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	同上	2015年4月8日
6.	上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金分红公告	同上	2015年4月9日
7.	上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	同上	2015年4月21日
8.	上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金经理变更公告	同上	2015年4月23日
9.	上投摩根基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	同上	2015年4月24日
10.	上投摩根基金管理有限公司关于设立子公司的公告	同上	2015年4月24日
11.	上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金恢复申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	同上	2015年6月6日
12.	关于公司、高管及基金经理投资旗下基金相	同上	2015年7月8日

	关事宜的公告		
13.	上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金分红公告	同上	2015年7月8日
14.	上投摩根基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	同上	2015年7月10日
15.	上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	同上	2015年7月14日
16.	上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金分红公告	同上	2015年10月16日
17.	上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金恢复申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	同上	2015年11月13日
18.	上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	同上	2015年11月20日
19.	上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2015年12月2日
20.	上投摩根基金管理有限公司关于因指数熔断旗下基金开放时间调整的公告	同上	2015年12月31日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金托管协议》；
- 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。

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

13.3 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。

网址：www.cifm.com

上投摩根基金管理有限公司

二〇一六年三月三十日