

2018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：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年七月九日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及监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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018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。投资人投资于风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 上投摩根安全战略股票型证券投资基金

基金代码 001009

交易方式 灵活开放式

基金合同生效日 2015/2/26

报告期末基金份额总额 806,099,404.69

投资目标 通过深入研究及深度挖掘，重点关注与安全战略相关行业的上市公司，充分挖掘经济增长模式变化带来的投资机会，控制风险的前提下实现基金资产的稳定增值。

投资策略 本基金将通过系统和深入的基本面研究，重点关注与国家安全战略相关的上市公司的分行业增长模式变化带来的投资机会，本基金将通过深入研究及深度挖掘，重点关注与安全战略相关行业的上市公司，充分挖掘经济增长模式变化带来的投资机会，控制风险的前提下实现基金资产的稳定增值。

风险收益特征 本基金为股票型基金，风险收益特征较高。本基金在进行资产配置时，本基金将从行业分析、风格分析等方面出发，精选具有良好成长性的个股。

业绩比较基准 中证300指数收益率×85%+恒生指数收益率×15%

风险收益特征 本基金是股票型基金，风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较风险较高的收益水平的基金品种。本基金风险收益特征会定期评估并在公司网站发布，供投资者关注。

基金管理人 上投摩根基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 2018年4月1日至2018年6月30日

1.本期已实现收益 -36,809,498.23

2.本期利润 -56,458,660.83

3.期初至报告期期末基金累计净值 -0.0964

4.期末基金资产净值 729,725,488.47

5.期末基金份额净值 0.905

注：本期已实现收益指本基金利息收入、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。

本基金业绩指标不代表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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注：本期已实现收益指本基金利息收入、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。

本基金业绩指标不代表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将低于所列数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.3.1 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.3.2 自基金合同生效以来基金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

注：本期已实现收益指本基金利息收入、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。

本基金业绩指标不代表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将低于所列数字。

3.2.4 基金净值表现

3.2.4.1 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.2 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.3 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.4 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.5 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.6 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.7 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.8 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.9 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.10 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.11 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.12 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.13 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.14 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.15 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.16 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.17 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.18 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.19 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.20 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.21 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.22 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.23 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.24 报告期内本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.18% 1.46% -9.29% 0.98% 207% 0.48%

3.2.4.25 报告期内本基金份额净值增长率及其与