

# 上投摩根安通回报混合型证券投资基金

## 2018年第二季度报告

|  |  |
|--|--|
| 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:交通银行股份有限公司   |  |
| 报告送出日期:二〇一八年七月十九日  |  |
| <b>§ 1 重要提示</b>  |  |
| 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。                         |  |
| 基金托管人交通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和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,其过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前仔细阅读本基金的相关说明。     |  |
| 本报告财务数据未经审计。   |  |
| 本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。  |  |

|  |  |
|--|--|
| <b>§ 2 基金产品概况</b>  |  |
| 基金名称   | 上投摩根安通回报混合   |
| 基金代码   | 004081   |
| 基金运作方式   | 契约式开放式   |
| 基金合同生效日  | 2017年4月26日   |
| 报告期末基金份额总额   | 47,462,283.32份   |
| 投资目标   | 本基金通过投资于国内股票、债券、货币工具等资产,追求基金资产的长期增值,并力争实现基金资产的稳健增值。  |
| 投资策略   | 1.资产配置策略<br>本基金将通过对宏观经济、政策取向、市场估值水平等因素的综合分析,动态调整股票、债券、货币工具等资产的投资比例,并适时调整投资组合,以追求基金资产的长期增值。<br>2.股票投资策略<br>本基金将采取自上而下和自下而上的投资策略,在充分研究宏观经济、政策取向、市场估值水平等因素的基础上,精选具有良好成长性的个股,并适时调整投资组合,以追求基金资产的长期增值。<br>3.债券投资策略<br>本基金将采取自上而下和自下而上的投资策略,在充分研究宏观经济、政策取向、市场估值水平等因素的基础上,精选具有良好成长性的债券,并适时调整投资组合,以追求基金资产的长期增值。<br>4.货币工具投资策略<br>本基金将采取自上而下和自下而上的投资策略,在充分研究宏观经济、政策取向、市场估值水平等因素的基础上,精选具有良好成长性的货币工具,并适时调整投资组合,以追求基金资产的长期增值。 |
| 风险收益特征   | 本基金属于证券投资基金,预期风险和收益水平高于债券型基金和货币型基金,属于证券投资基金中风险收益特征的产品。本基金的风险收益特征与本基金合同约定的投资范围、投资策略、资产配置比例等因素密切相关。  |
| 基金管理人  | 上投摩根基金管理有限公司   |
| 基金托管人  | 交通银行股份有限公司   |
| 基金销售机构   | 基金管理人、基金托管人、基金销售机构   |
| 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,其过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前仔细阅读本基金的相关说明。 |  |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>   |  |
| 主要财务指标   | 报告期<br>2018年4月1日至2018年6月30日  |
| 1.本期已实现收益  | -10,363.68   |
| 2.本期利润   | -243,807.10  |
| 3.加权平均基金份额本期利润   | -0.0045  |
| 4.期末基金份额净值   | 48.125,552.03  |
| 5.期末基金份额净值   | 1.030  |

|  |   |
|--|---|
| 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:交通银行股份有限公司   |   |
| 报告送出日期:二〇一八年七月十九日  |   |
| <b>§ 1 重要提示</b>  |   |
| 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。                         |   |
| 基金托管人交通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和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,其过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前仔细阅读本基金的相关说明。     |   |
| 本报告财务数据未经审计。   |   |
| 本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。  |   |
| <b>§ 2 基金产品概况</b>  |   |
| 基金名称   | 上投摩根纯债债券  |
| 基金代码   | 371002  |
| 基金运作方式   | 契约式开放式  |
| 基金合同生效日  | 2009年6月24日  |
| 报告期末基金份额总额   | 289,123,975.48份   |
| 投资目标   | 本基金通过投资于国内债券、货币工具等资产,追求基金资产的长期增值,并力争实现基金资产的稳健增值。  |
| 投资策略   | 本基金将采取自上而下和自下而上的投资策略,在充分研究宏观经济、政策取向、市场估值水平等因素的基础上,精选具有良好成长性的债券,并适时调整投资组合,以追求基金资产的长期增值。            |
| 风险收益特征   | 本基金属于证券投资基金,预期风险和收益水平高于债券型基金和货币型基金,属于证券投资基金中风险收益特征的产品。本基金的风险收益特征与本基金合同约定的投资范围、投资策略、资产配置比例等因素密切相关。 |
| 基金管理人  | 上投摩根基金管理有限公司  |
| 基金托管人  | 交通银行股份有限公司  |
| 基金销售机构   | 基金管理人、基金托管人、基金销售机构  |
| 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,其过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前仔细阅读本基金的相关说明。     |   |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>   |   |
| 主要财务指标   | 报告期<br>2018年4月1日至2018年6月30日   |
| 1.本期已实现收益  | 2,132,370.08  |
| 2.本期利润   | 2,982,930.11  |
| 3.加权平均基金份额本期利润   | 0.0019  |
| 4.期末基金份额净值   | 38.355,882.02   |
| 5.期末基金份额净值   | 1.046   |

|  |   |
|--|---|
| 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:交通银行股份有限公司   |   |
| 报告送出日期:二〇一八年七月十九日  |   |
| <b>§ 1 重要提示</b>  |   |
| 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。                         |   |
| 基金托管人交通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和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,其过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前仔细阅读本基金的相关说明。     |   |
| 本报告财务数据未经审计。   |   |
| 本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。  |   |
| <b>§ 2 基金产品概况</b>  |   |
| 基金名称   | 上投摩根大盘蓝筹股票  |
| 基金代码   | 370101  |
| 基金运作方式   | 契约式开放式  |
| 基金合同生效日  | 2010年12月20日   |
| 报告期末基金份额总额   | 191,318,047.55份   |
| 投资目标   | 本基金通过投资于国内股票、债券、货币工具等资产,追求基金资产的长期增值,并力争实现基金资产的稳健增值。   |
| 投资策略   | 本基金将采取自上而下和自下而上的投资策略,在充分研究宏观经济、政策取向、市场估值水平等因素的基础上,精选具有良好成长性的股票,并适时调整投资组合,以追求基金资产的长期增值。            |
| 风险收益特征   | 本基金属于证券投资基金,预期风险和收益水平高于债券型基金和货币型基金,属于证券投资基金中风险收益特征的产品。本基金的风险收益特征与本基金合同约定的投资范围、投资策略、资产配置比例等因素密切相关。 |
| 基金管理人  | 上投摩根基金管理有限公司  |
| 基金托管人  | 交通银行股份有限公司  |
| 基金销售机构   | 基金管理人、基金托管人、基金销售机构  |
| 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,其过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前仔细阅读本基金的相关说明。     |   |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>   |   |
| 主要财务指标   | 报告期<br>2018年4月1日至2018年6月30日   |
| 1.本期已实现收益  | -11,352,384.0   |
| 2.本期利润   | -19,251,173.59  |
| 3.加权平均基金份额本期利润   | -0.0074   |
| 4.期末基金份额净值   | 39.8,482,804.1  |
| 5.期末基金份额净值   | 1.018   |

## 上投摩根安通回报混合型证券投资基金

### 2018年第二季度报告

|  |  |
|--|--|
| 基金名称   | 上投摩根安通回报混合   |
| 基金代码   | 004081   |
| 基金运作方式   | 契约式开放式   |
| 基金合同生效日  | 2017年4月26日   |
| 报告期末基金份额总额   | 47,462,283.32份   |
| 投资目标   | 本基金通过投资于国内股票、债券、货币工具等资产,追求基金资产的长期增值,并力争实现基金资产的稳健增值。  |
| 投资策略   | 1.资产配置策略<br>本基金将通过对宏观经济、政策取向、市场估值水平等因素的综合分析,动态调整股票、债券、货币工具等资产的投资比例,并适时调整投资组合,以追求基金资产的长期增值。<br>2.股票投资策略<br>本基金将采取自上而下和自下而上的投资策略,在充分研究宏观经济、政策取向、市场估值水平等因素的基础上,精选具有良好成长性的个股,并适时调整投资组合,以追求基金资产的长期增值。<br>3.债券投资策略<br>本基金将采取自上而下和自下而上的投资策略,在充分研究宏观经济、政策取向、市场估值水平等因素的基础上,精选具有良好成长性的债券,并适时调整投资组合,以追求基金资产的长期增值。<br>4.货币工具投资策略<br>本基金将采取自上而下和自下而上的投资策略,在充分研究宏观经济、政策取向、市场估值水平等因素的基础上,精选具有良好成长性的货币工具,并适时调整投资组合,以追求基金资产的长期增值。 |
| 风险收益特征   | 本基金属于证券投资基金,预期风险和收益水平高于债券型基金和货币型基金,属于证券投资基金中风险收益特征的产品。本基金的风险收益特征与本基金合同约定的投资范围、投资策略、资产配置比例等因素密切相关。  |
| 基金管理人  | 上投摩根基金管理有限公司   |
| 基金托管人  | 交通银行股份有限公司   |
| 基金销售机构   | 基金管理人、基金托管人、基金销售机构   |
| 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,其过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前仔细阅读本基金的相关说明。 |  |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>   |  |
| 主要财务指标   | 报告期<br>2018年4月1日至2018年6月30日  |
| 1.本期已实现收益  | -10,363.68   |
| 2.本期利润   | -243,807.10  |
| 3.加权平均基金份额本期利润   | -0.0045  |
| 4.期末基金份额净值   | 48.125,552.03  |
| 5.期末基金份额净值   | 1.030  |

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金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率水平要低于所列数字。

3.21 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

|            |        |           |            |               |        |        |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 1. 安通回报 A: |        |           |            |               |        |        |
| 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      | -0.41% | 0.15%     | 0.18%      | 0.18%         | -0.59% | -0.03% |

3.22 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:本基金合同生效日为2017年4月26日,图示时间段为2017年4月26日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2017年4月26日至2017年10月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

2. 安通回报 C:



注:本基金合同生效日为2017年4月26日,图示时间段为2017年4月26日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2017年4月26日至2017年10月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

3. 安通回报 A:



注:本基金合同生效日为2017年4月26日,图示时间段为2017年4月26日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2017年4月26日至2017年10月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

4. 安通回报 C:



注:本基金合同生效日为2017年4月26日,图示时间段为2017年4月26日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2017年4月26日至2017年10月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

5. 安通回报 A:



注:本基金合同生效日为2017年4月26日,图示时间段为2017年4月26日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2017年4月26日至2017年10月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

6. 安通回报 C:



注:本基金合同生效日为2017年4月26日,图示时间段为2017年4月26日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2017年4月26日至2017年10月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

7. 安通回报 A:



注:本基金合同生效日为2017年4月26日,图示时间段为2017年4月26日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2017年4月26日至2017年10月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

8. 安通回报 C:



注:本基金合同生效日为2017年4月26日,图示时间段为2017年4月26日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2017年4月26日至2017年10月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

9. 安通回报 A:



注:本基金合同生效日为2017年4月26日,图示时间段为2017年4月26日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2017年4月26日至2017年10月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

10. 安通回报 C:



注:本基金合同生效日为2017年4月26日,图示时间段为2017年4月26日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2017年4月26日至2017年10月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

11. 安通回报 A:



注:本基金合同生效日为2017年4月26日,图示时间段为2017年4月26日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2017年4月26日至2017年10月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

12. 安通回报 C:



注:本基金合同生效日为2017年4月26日,图示时间段为2017年4月26日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2017年4月26日至2017年10月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

13. 安通回报 A:



注:本基金合同生效日为2017年4月26日,图示时间段为2017年4月26日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2017年4月26日至2017年10月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

## 上投摩根纯债债券型证券投资基金

### 2018年第二季度报告

|  |   |
|--|---|
| 基金名称   | 上投摩根纯债债券  |
| 基金代码   | 371002  |
| 基金运作方式   | 契约式开放式  |
| 基金合同生效日  | 2009年6月24日  |
| 报告期末基金份额总额   | 289,123,975.48份   |
| 投资目标   | 本基金通过投资于国内债券、货币工具等资产,追求基金资产的长期增值,并力争实现基金资产的稳健增值。  |
| 投资策略   | 本基金将采取自上而下和自下而上的投资策略,在充分研究宏观经济、政策取向、市场估值水平等因素的基础上,精选具有良好成长性的债券,并适时调整投资组合,以追求基金资产的长期增值。            |
| 风险收益特征   | 本基金属于证券投资基金,预期风险和收益水平高于债券型基金和货币型基金,属于证券投资基金中风险收益特征的产品。本基金的风险收益特征与本基金合同约定的投资范围、投资策略、资产配置比例等因素密切相关。 |
| 基金管理人  | 上投摩根基金管理有限公司  |
| 基金托管人  | 交通银行股份有限公司  |
| 基金销售机构   | 基金管理人、基金托管人、基金销售机构  |
| 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,其过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前仔细阅读本基金的相关说明。 |   |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>   |   |
| 主要财务指标   | 报告期<br>2018年4月1日至2018年6月30日   |
| 1.本期已实现收益  | 2,132,370.08  |
| 2.本期利润   | 2,982,930.11  |
| 3.加权平均基金份额本期利润   | 0.0019  |
| 4.期末基金份额净值   | 38.355,882.02   |
| 5.期末基金份额净值   | 1.046   |

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

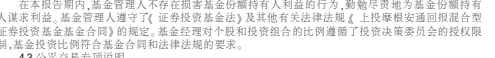
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益率水平要低于所列数字。

3.21 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

|       |        |           |            |               |        |        |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差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 | 0.77%  | 0.04%     | 1.76%      | 0.15%         | -0.99% | -0.11% |

|            |        |           |            |               |        |        |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2. 纯债债券 C: |        |           |            |               |        |        |
| 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      | 0.65%  | 0.04%     | 1.76%      | 0.15%         | -1.11% | -0.11% |

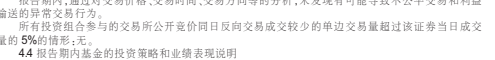
3.22 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金合同生效日为2009年6月24日,图示时间段为2009年6月24日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2009年6月24日至2009年12月23日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

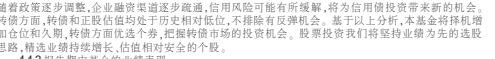
2. 纯债债券 B:



注:本基金合同生效日为2009年6月24日,图示时间段为2009年6月24日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2009年6月24日至2009年12月23日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

3. 纯债债券 A:



注:本基金合同生效日为2009年6月24日,图示时间段为2009年6月24日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2009年6月24日至2009年12月23日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

4. 纯债债券 C:



注:本基金合同生效日为2009年6月24日,图示时间段为2009年6月24日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2009年6月24日至2009年12月23日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

5. 纯债债券 A:



注:本基金合同生效日为2009年6月24日,图示时间段为20