

上投摩根安泽回报混合型证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司

1.1 重要提示 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... 基金的投资业绩并不代表其未来表现...

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金类型, 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构, 基金募集日期, 基金合同生效日期, 基金运作方式, 基金存续期限, 基金风险等级, 基金费率, 基金管理人网址, 基金托管人网址, 基金销售机构网址

2.2 基金产品说明

基金的投资目标: 本基金投资于具有良好流动性的资产, 通过积极主动的投资管理, 力争实现超越业绩比较基准的投资回报... 基金的投资范围: 本基金投资于股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、期权、融资融券交易、转融通等金融工具...

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. 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.

2.4 信息披露方式

基金管理人网站: http://www.ftf.com.cn 基金托管人网站: http://www.ccb.com.cn

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

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码. 基金名称: 上投摩根安泽回报混合型证券投资基金. 基金代码: 004942. 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. 基金合同生效日期: 2017年1月18日. 基金运作方式: 契约型开放式. 基金存续期限: 不定期. 基金风险等级: 中风险. 基金费率: 管理费: 0.80%/年, 托管费: 0.20%/年, 销售服务费: 0.40%/年. 基金管理人网址: www.ftf.com.cn. 基金托管人网址: www.ccb.com.cn. 基金销售机构网址: www.ccb.com.cn.

3.2 基金净值表现

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码. 基金名称: 上投摩根安泽回报混合型证券投资基金. 基金代码: 004942. 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. 基金合同生效日期: 2017年1月18日. 基金运作方式: 契约型开放式. 基金存续期限: 不定期. 基金风险等级: 中风险. 基金费率: 管理费: 0.80%/年, 托管费: 0.20%/年, 销售服务费: 0.40%/年. 基金管理人网址: www.ftf.com.cn. 基金托管人网址: www.ccb.com.cn. 基金销售机构网址: www.ccb.com.cn.

3.3 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

3.4 基金管理人及基金托管人

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.

3.5 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

3.6 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

3.7 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

3.8 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

3.9 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

3.10 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

3.11 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

3.12 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

3.13 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

3.14 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

3.15 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

3.16 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

3.17 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

3.18 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

3.19 基金业绩比较基准

注: 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率 x 20% + 中证综合债指数收益率 x 80%.

上投摩根安泽回报混合型证券投资基金

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: 中国建设银行股份有限公司

4.1.2 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.2 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.3 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.4 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.5 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.6 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.7 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.8 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.9 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.10 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.11 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.12 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.13 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.14 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.15 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.16 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.17 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.18 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.19 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.20 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.21 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.22 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.23 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.24 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.25 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.26 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.27 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.28 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.29 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.30 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.31 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.32 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.33 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.34 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

4.35 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

上投摩根安泽回报混合型证券投资基金

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: 中国建设银行股份有限公司

5.1 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.2 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.3 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.4 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.5 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.6 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.7 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.8 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.9 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.10 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.11 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.12 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.13 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.14 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.15 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.16 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.17 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.18 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.19 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.20 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.21 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.22 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.23 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.24 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.25 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.26 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.27 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.28 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.29 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.30 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.31 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.32 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.33 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.34 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

5.35 基金业绩比较基准

注: 1. 任职日期和离任日期均指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期...

2018年半年度报告摘要

其计算公式为: 日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.7% / 当年天数.

6.4.8.2.2 基金托管费

其计算公式为: 日托管费=前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数.

6.4.8.3 销售服务费

其计算公式为: 日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数.

6.4.8.4 与关联方进行银行间同业拆借市场、债券回购等交易

其计算公式为: 日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数.

6.4.8.4.1 关联方投资本基金的情况

其计算公式为: 日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数.

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况

其计算公式为: 日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数.

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

其计算公式为: 日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数.

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

其计算公式为: 日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数.

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

其计算公式为: 日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数.

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

其计算公式为: 日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数.

6.4.8.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

其计算公式为: 日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数.

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

其计算公式为: 日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数.

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

其计算公式为: 日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数.

6.4.9.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

其计算公式为: 日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数.

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

其计算公式为: 日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数.

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

其计算公式为: 日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数.

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

其计算公式为: 日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数.

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项