

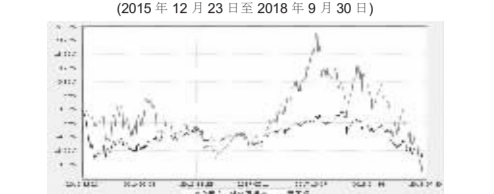
上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

Table with 5 columns: 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. Data for 2018年第三季度.

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

上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2015年12月23日至2018年9月30日)



注:本基金合同生效日为2015年12月23日,图示时间段为2015年12月23日至2018年9月30日。

本基金建仓自2015年12月23日至2016年6月22日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职本基金的基金经理日期, 证券从业年限. Lists fund managers and their backgrounds.

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遵规守信情况的说明

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。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规,《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》的规定,基金投资比例符合基金合同和法律法的要求。

4.3 公平交易专项说明

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制度的各项要求,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

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

对于银行间市场投资活动,本公司通过对对手选择和交易询价价公平分配交易

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、交易方向等的分析,未发现有可

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年第三季度,中美贸易战不断升级,宏观经济持续走弱,上市公司的盈利增

4.4.2 报告期内基金的业绩表现 本报告期末基金份额净值增长率为-14.58%,同期业绩比较基准收益率为-2.06%。

4.5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Lists portfolio holdings as of the end of the reporting period.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 行业名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Lists industry breakdown of stock investments.

5.3 报告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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists top 10 stocks by fair value.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 5.5 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债券投资

6.1 基金资产净值及基金份额净值 6.2 基金份额累计净值

6.3 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

8.1 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

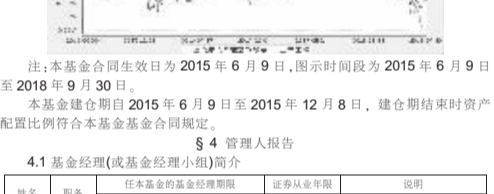
上投摩根智慧互联股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

Table with 5 columns: 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. Data for 2018年第三季度.

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

上投摩根智慧互联股票型证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2015年6月9日至2018年9月30日)



注:本基金合同生效日为2015年6月9日,图示时间段为2015年6月9日至2018年9月30日。

本基金建仓自2015年6月9日至2015年12月8日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职本基金的基金经理日期, 证券从业年限. Lists fund managers and their backgrounds.

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遵规守信情况的说明

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。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规,《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》的规定,基金投资比例符合基金合同和法律法的要求。

4.3 公平交易专项说明

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制度的各项要求,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

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

对于银行间市场投资活动,本公司通过对对手选择和交易询价价公平分配交易

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、交易方向等的分析,未发现有可

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年第三季度,中美贸易战不断升级,宏观经济持续走弱,上市公司的盈利增

4.4.2 报告期内基金的业绩表现 本报告期末基金份额净值增长率为-16.32%,同期业绩比较基准收益率为-2.98%。

4.5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Lists portfolio holdings as of the end of the reporting period.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 行业名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Lists industry breakdown of stock investments.

5.3 报告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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists top 10 stocks by fair value.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 5.5 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债券投资

6.1 基金资产净值及基金份额净值 6.2 基金份额累计净值

6.3 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

8.1 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

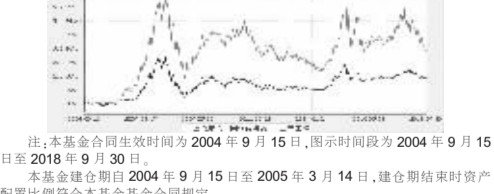
上投摩根中国优势证券投资基金

2018年第三季度报告

Table with 5 columns: 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. Data for 2018年第三季度.

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

上投摩根中国优势证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2004年9月15日至2018年9月30日)



注:本基金合同生效时间为2004年9月15日,图示时间段为2004年9月15日至2018年9月30日。

本基金建仓自2004年9月15日至2005年3月14日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职本基金的基金经理日期, 证券从业年限. Lists fund managers and their backgrounds.

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遵规守信情况的说明

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。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关

法律法规,《上投摩根中国优势证券投资基金基金合同》的规定。基金投资对个股和

4.3 公平交易专项说明 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制度的各项要求,严格规范境内上市股票、

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实

对于银行间市场投资活动,本公司通过对对手选择和交易询价价公平分配交易

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、交易方向等的分析,未发现有可

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年第三季度,A股市场继续保持疲弱态势,一方面中美贸易战出现升级态

4.4.2 报告期内基金的业绩表现 本报告期末基金份额净值增长率为-14.35%,同期业绩比较基准收益率为-1.39%。

4.5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Lists portfolio holdings as of the end of the reporting period.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 行业名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Lists industry breakdown of stock investments.

5.3 报告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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists top 10 stocks by fair value.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 5.5 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债券投资

6.1 基金资产净值及基金份额净值 6.2 基金份额累计净值

6.3 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

8.1 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根中国优势证券投资基金设立的文件;

2. 《上投摩根中国优势证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根中国优势证券投资基金托管协议》;

4. 《上投摩根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

8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。 8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注 5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出

5.11.2 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

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists other assets.

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

6 开放式基金份额变动 单位:份

Table with 2 columns: 序号, 基金份额, 金额(元). Lists open-ended fund share changes.

7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

8.1 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文

2. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》 3. 《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金托管协议》

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、营业执照 8.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。

8.3 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。 上投摩根基金管理有限公司 二〇一八年十月二十四日

8.4 备查文件目录 1. 中国证监会批准上投摩根智慧互联股票型证券投资基金设立的文