

上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金托管人:上投摩根基金管理有限公司

报告送出日期:二〇一九年一月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人:中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月21日核对了本报告期内的财务指标、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:上投摩根量化多因子混合

基金代码:000620

交易代码:000620

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2018年1月19日

报告期末基金份额总额:266,743,221.77份

投资目标:采用量化投资方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等进行综合分析,在控制风险的前提下,力争超越业绩基准。

投资策略:本基金采用“量化因子模型”进行选股选择,并结合适当的资产配置策略构建基金投资组合。

在投资操作中,本基金将利用“量化因子模型”选择具有较好投资价值的证券,对基金资产进行有效管理,力争超越业绩基准的业绩表现。

业绩比较基准:中证300指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%

风险收益特征:本基金通过对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等进行综合分析,在控制风险的前提下,力争超越业绩基准。

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

§ 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

报告期(2018年10月1日-2018年12月31日)

1.本期已实现收益 -25,794,531.51

2.本期利润 -42,836,890.01

3.加权平均基金份额本期利润 -0.116%

4.期末基金份额净值 266,000.96234

5.期末基金份额总额 0.7439

注:本基金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 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

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的比较

注:本基金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。

3.2.3 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -10.41% 1.89% -10.15% 1.39% -0.26% 0.50%

注:本基金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。

3.2.4 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

注:本基金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。

3.2.5 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

注:本基金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。

3.2.6 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

注:本基金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。

3.2.7 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

注:本基金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。

3.2.8 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

注:本基金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。

3.2.9 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

注:本基金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。

3.2.10 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

注:本基金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。

3.2.11 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

注:本基金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。

3.2.12 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

注:本基金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。

3.2.13 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

注:本基金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。

3.2.14 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

注:本基金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。

3.2.15 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

注:本基金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。

3.2.16 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

注:本基金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。

3.2.17 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

注:本基金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。

3.2.18 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(%) 净值增 长率准 差 业绩比较基 准净值增 长率准 差 准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.69% 1.66% -6.41% 0.93% -7.28% 0.67%

注:本基金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