

# 上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金( QDII )

## 2018年第四季度报告

元、英镑和少量人民币(用于应付赎回)。

展望后市,进入2019年除了有关英国退欧进程对市场的影响,以及其他宏观经济因素外,作为各自下而上选股策略基金,本基金将从动能、质量和价值等维度寻找优质标的,重点关注长期趋势投资。

4.5 风险收益特征

本基金报告期内基金持有他人基金份额或基金资产净值预增率为-0.63%,同期业绩比较基准收益率为-4.29%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 权益类投资 18,306,634.01 2.01

其中:普通股 10,690,474.03 2.02

优先股 - -

港股通股票 140,269.00 0.19

2 债券 - -

其中:国债 - -

地方政府债 - -

企业债 - -

公司债 - -

可转债 - -

短期融资券 - -

超短期融资券 - -

资产支持证券 - -

贵金属 - -

4 债券型基金 6,940.15 0.01

5 货币市场基金 6,940.15 0.01

6 其他 - -

7 衍生工具 40,740,966.02 57.78

8 其他资产 209,305.00 0.26

9 合计 79,176,338.04 100.00

### 5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

姓名 国家(地区) 公允价值人民币(元) 占基金资产净值比例(%)

美国 4,257,900.00 5.48

法国 3,217,549.00 4.14

瑞士 3,032,200.00 3.80

德国 2,086,128.00 2.66

荷兰 1,794,762.74 2.21

意大利 889,181.04 1.09

瑞典 900,114.94 1.02

丹麦 608,725.00 0.75

西班牙 6,071,017.03 0.72

芬兰 512,243.41 0.66

比利时 219,389.42 0.28

挪威 217,490.26 0.28

西班牙 96,204.51 0.13

合计 3,108,034.31 23.46

### 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别 公允价值人民币(元) 占基金资产净值比例(%)

制药 2,602,644.07 3.47

石油、天然气与消费燃料 1,691,891.00 2.18

商业银行 1,519,400.00 1.98

保险 1,303,010.00 1.79

信息技术服务 184,810.00 0.24

食品 822,313.00 1.06

耐用消费品及零部件 789,061.00 1.02

建筑与工程 722,560.01 0.94

金融和保险 209,569.00 0.01

零售业 581,000.00 0.76

合计 3,003,830.00 4.00

### 5.4 管理人报告

#### 4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 任期日期 说明

张军 本基金基金经理 2016-10-31 -

注: 1. 本基金合同生效日为2018年10月31日,图示时间段为2018年10月31日至2018年12月31日。

2. 张军先生为本公司基金经理,主要从事基金的投资管理工作。

3. 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要人员简介

姓名 职务 任期日期 说明

Levon Gholian(高良) 多伦多时间美元账户的基金经理兼基金经理 2016-12-19 -

注: 1. 本基金合同生效日为2018年10月31日,图示时间段为2018年10月31日至2018年12月31日。张军先生为本公司基金经理,主要从事基金的投资管理工作。

2. 高良先生为本公司基金经理,主要从事基金的投资管理工作。

3. 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。

4.3 主要财务指标

单位:人民币元

报告期 2018年10月31日-2018年12月31日

主要财务指标 1,047,700.43 -6,947.76

1.本期已实现收益 -40,776.00 -36,396.70

2.本期利润 -19,080.01 -20,038.36

3.加权平均基金份额本期利润 -0,0064 -0,0066

4.期末基金资产净值 4,797,748.43 4,790,773.79

5.期末可供分配基金份额利润 -0.0001 -0.0001

注: 1. 本期利润为收入减去所有费用后的余额,本期利润的计算公式为:本期利润=本期已实现收益+本期已分配利润。

2. 本期已实现收益不包含持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

3. 本期利润的计算公式为:本期利润=本期已实现收益+本期已分配利润-本期各项交易费用。

4. 期末可供分配基金份额利润不等于期末基金资产净值,因为各项交易费用会导致可供分配利润的减少。

5. 期末可供分配利润的计算公式为:可供分配利润=期末可供分配基金份额总额-基金资产净值。

6. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

7. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

8. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

9. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

10. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

11. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

12. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

13. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

14. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

15. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

16. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

17. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

18. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

19. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

20. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

21. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

22. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

23. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

24. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

25. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

26. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

27. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

28. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

29. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

30. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

31. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

32. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

33. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

34. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

35. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

36. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

37. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

38. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

39. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

40. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

41. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

42. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

43. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

44. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

45. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

46. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

47. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

48. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

49. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费、赎回款手续费。

50. 上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或赎回交易而产生的申购款利息、赎回款利息、申购款手续费