

上投摩根核心优选混合型证券投资基金

2018年度报告摘要

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
报告送出日期：二〇一九年三月二十七日

§ 1.重要提示

1.1 基金管理人的董事会、监事会对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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

2.基金托管人已对本报告所载资料根据本基金合同规定，于2019年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

3.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。

4.基金过往业绩并不代表其未来表现。投资人对基金作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

5.本年度报告摘要摘自年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

6.报告期自2018年1月1日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金简介

基金简称	上投摩根核心优选混合
基金代码	370204
交易代码	370204
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月28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
报告期末基金总资产	679,066,938.67元
基金合同的延续期	不适用

§ 2.1 基金基本情况

基金简称	上投摩根核心优选混合
基金代码	370204
交易代码	370204
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月28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
报告期末基金总资产	679,066,938.67元
基金合同的延续期	不适用

§ 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将充分利用基金管理人的整体实力，以内部研究合作为基础，以核心股票为主，以优质债券为辅进行投资操作。
投资策略	1. 债券配置策略 本基金主要观察宏观经济、采用定性分析和定量分析相结合的手法，结合对宏观经济、国家政策、市场价格走势等影响收益率的主要因素进行综合分析，结合股票类资产的风险收益特征，确定合适的资产配置比例。 2. 股票配置策略 本基金的研究团队采用基本面研究的方法，从宏观和微观两个层面出发，通过深入的行业研究、公司研究、估值研究、行业比较研究、估值研究、风险收益特征研究等方法，选择具有较好投资价值的股票，构建股票投资组合。本基金将根据将不低于80%的基金资产投资于公司的研究团队所跟踪的股票。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×10%+银行定期存款利率(税后)×2%
风险收益特征	本基金是一只双货币的混合型基金，其风险和预期收益水平介于股票型基金、货币市场基金和债券型基金之间，属于中风险收益预期的基金。 本基金风险收益特征定期评估并在公司网站发布，请投资者关注。

§ 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上投摩根基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
法定代表人	胡迪	田卉
联系人	021-37049488	010-67696006
电子邮箱	service@cmfchina.com	tianhu@citicbank.com
客户服务电话	400-889-4998	010-67696006
传真	021-20629400	010-66275983

§ 2.4 信息披露方式

本报告期内，基金托管人未以电子邮件的方式向基金管理人发送基金信息公告。

§ 2.5 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

项目	金额单位：人民币元
1.1 盈利	-
1.2 已实现收益	2018年7月 - 2016年7月
1.3 本期已实现收益	-142,681,643.10 80,247,976.38 -344,480,474.51
1.4 本期利润	-391,597,160.75 275,767,260.66 -629,664,029.01
1.5 加权平均基金份额本期利润	-0.0843 0.0765 -1.3033
1.6 本期末基金资产净值	-32.28% 38.90% -286.67%
1.7 本期末基金份额净值	2018年末 - 2017年末 0.2697 0.7714 0.0538
1.8 期末基金净值 -1.2369,490,493.6 1,106,771,075.34 788,023,346.71	
1.9 期末基金净值 -0.17 2.99% 2.167	

注：1. 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）、赎回费用收入扣除必要的费用后的余额，本期利润为本期已实现的收益加上本期公允价值收益或损失。

2. 期末可供分配利润指截至期末按摊余成本计算的基金可供分配的各项资金，分项列示如下：

3. 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

4.1 基金管理费

本报告期内，基金管理人未向本基金收取基金管理费。

4.2 托管费

本报告期内，基金托管人未向本基金收取托管费。

4.3 销售服务费

本基金是双货币基金，其销售服务费率为0.3%，由基金管理人从基金财产中计提并支付给销售机构。

4.4 其他费用

本报告期内，本基金未发生其他费用。

4.5 托管费费率

本报告期内，本基金未向基金托管人收取托管费。

4.6 基金销售服务费

本报告期内，本基金未向基金销售机构收取基金销售服务费。

4.7 申购费

本报告期内，本基金未向投资者收取申购费。

4.8 赎回费

本报告期内，本基金未向投资者收取赎回费。

4.9 其他费用

本报告期内，本基金未发生其他费用。

5.1 报告期内基金管理人报酬

本报告期内，基金管理人未向本基金收取基金管理费。

5.2 报告期内基金托管人报酬

本报告期内，基金托管人未向本基金收取基金托管费。

5.3 报告期内基金销售服务费

本报告期内，本基金未向基金销售机构收取基金销售服务费。

5.4 报告期内其他费用

本报告期内，本基金未发生其他费用。

5.5 报告期内基金管理人报酬

本报告期内，基金管理人未向本基金收取基金管理费。

5.6 报告期内基金托管人报酬

本报告期内，基金托管人未向本基金收取基金托管费。

5.7 报告期内基金销售服务费

本报告期内，本基金未向基金销售机构收取基金销售服务费。

5.8 报告期内其他费用

本报告期内，本基金未发生其他费用。

5.9 报告期内基金管理人报酬

本报告期内，基金管理人未向本基金收取基金管理费。

5.10 报告期内基金托管人报酬

本报告期内，基金托管人未向本基金收取基金托管费。

5.11 报告期内基金销售服务费

本报告期内，本基金未向基金销售机构收取基金销售服务费。

5.12 报告期内其他费用

本报告期内，本基金未发生其他费用。

5.13 报告期内基金管理人报酬

本报告期内，基金管理人未向本基金收取基金管理费。

5.14 报告期内基金托管人报酬

本报告期内，基金托管人未向本基金收取基金托管费。

5.15 报告期内基金销售服务费

本报告期内，本基金未向基金销售机构收取基金销售服务费。

5.16 报告期内其他费用

本报告期内，本基金未发生其他费用。

5.17 报告期内基金管理人报酬

本报告期内，基金管理人未向本基金收取基金管理费。

5.18 报告期内基金托管人报酬

本报告期内，基金托管人未向本基金收取基金托管费。

5.19 报告期内基金销售服务费

本报告期内，本基金未向基金销售机构收取基金销售服务费。

5.20 报告期内其他费用

本报告期内，本基金未发生其他费用。

5.21 报告期内基金管理人报酬

本报告期内，基金管理人未向本基金收取基金管理费。

5.22 报告期内基金托管人报酬

本报告期内，基金托管人未向本基金收取基金托管费。

5.23 报告期内基金销售服务费

本报告期内，本基金未向基金销售机构收取基金销售服务费。

5.24 报告期内其他费用

本报告期内，本基金未发生其他费用。

5.25 报告期内基金管理人报酬

本报告期内，基金管理人未向本基金收取基金管理费。

5.26 报告期内基金托管人报酬

本报告期内，基金托管人未向本基金收取基金托管费。

5.27 报告期内基金销售服务费

本报告期内，本基金未向基金销售机构收取基金销售服务费。

5.28 报告期内其他费用

本报告期内，本基金未发生其他费用。

5.29 报告期内基金管理人报酬

本报告期内，基金管理人未向本基金收取基金管理费。

5.30 报告期内基金托管人报酬

本报告期内，基金托管人未向本基金收取基金托管费。

5.31 报告期内基金销售服务费

本报告期内，本基金未向基金销售机构收取基金销售服务费。

5.32 报告期内其他费用

本报告期内，本基金未发生其他费用。

5.33 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金单位现金形式发放的总金额	每份基金份额形式	总金额	年度利润分配方案	备注

<tbl_r cells="6" ix="1" maxcspan="1" maxrspan="