

上投摩根红利回报混合型证券投资基金

2019年半年度报告摘要

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十四日

1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员、基金经理、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别法律责任。本半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。

基金管理人和中国人银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年6月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配政策、财务会计报告、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及定期报告。

本年度报告摘要能反映自上年度报告正文、投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2019年1月1日至2019年6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本概况

基金简称	上投摩根红利回报混合		
基金代码	000266		
交易代码	000266		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年9月19日		
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期基金份额总额	63,360,598.56份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	上投摩根红利回报混合	上投摩根红利回报混合	A
下属分级基金的交易代码	000266	002436	C
报告期末下属分级基金的份额总额	32,022,026.70份	31,388,562.86份	

2.2 基金产品说明

投资目标 以追求稳健收益为目标,严格控制下行风险,力争为投资者创造长期稳定的回报。

投资策略 本基金将主要投资于具有良好盈利能力且成长能力的红利股,红利股的资产比不低于股票资产的0%,本基金将通过分析行业基本面、公司质地和估值水平,精选个股,构建股票组合。

业绩比较基准 中证红利指数*60%+沪深300指数收益*40%

本基金属于中低风险品种,则风险与预期收益水平一般股票基金,高风险股票基金相比风险略高,属于中高风险水平的基金品种。本基金的风险收益特征会定期评估并在公司网站发布,请投资者关注。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司继续遵循证监会《证券投资基金行业公平交易制度指导意见》等相关的法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求,严格规范地内上股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活,通过系统化和流程化的方式进行交易执行和监控,以确保本公司管理的不同组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理各个环节得到公平对待。

对于日常交易活动,本公司执行集中交易制度,确保不同投资组合在买卖同一证券时,按照时间优先、比例分配的原则在投资组合间公平分配交易量;对于银行间市场投资活动,本公司遵循价格优先、比例分配的原则,根据事前单独申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司未发现有明显异常交易行为。所投资组合参加的交易所公开竞价原则,即所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易或成交较少的单边交易量超过该组合当日前收盘价涨跌幅的绝对值的2%,发生一次,视为交易日组合间公平交易行为。

4.4.1 报告期内本基金的投资策略和运作分析

4.4.2 报告期内本基金的业绩表现

4.4.3 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.4 报告期内本基金的业绩表现

4.4.5 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.6 报告期内本基金的业绩表现

4.4.7 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.8 报告期内本基金的业绩表现

4.4.9 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.10 报告期内本基金的业绩表现

4.4.11 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.12 报告期内本基金的业绩表现

4.4.13 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.14 报告期内本基金的业绩表现

4.4.15 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.16 报告期内本基金的业绩表现

4.4.17 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.18 报告期内本基金的业绩表现

4.4.19 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.20 报告期内本基金的业绩表现

4.4.21 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.22 报告期内本基金的业绩表现

4.4.23 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.24 报告期内本基金的业绩表现

4.4.25 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.26 报告期内本基金的业绩表现

4.4.27 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.28 报告期内本基金的业绩表现

4.4.29 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.30 报告期内本基金的业绩表现

4.4.31 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.32 报告期内本基金的业绩表现

4.4.33 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.34 报告期内本基金的业绩表现

4.4.35 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.36 报告期内本基金的业绩表现

4.4.37 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.38 报告期内本基金的业绩表现

4.4.39 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.40 报告期内本基金的业绩表现

4.4.41 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.42 报告期内本基金的业绩表现

4.4.43 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.44 报告期内本基金的业绩表现

4.4.45 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.46 报告期内本基金的业绩表现

4.4.47 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.48 报告期内本基金的业绩表现

4.4.49 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.50 报告期内本基金的业绩表现

4.4.51 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.52 报告期内本基金的业绩表现

4.4.53 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.54 报告期内本基金的业绩表现

4.4.55 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.56 报告期内本基金的业绩表现

4.4.57 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.58 报告期内本基金的业绩表现

4.4.59 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.60 报告期内本基金的业绩表现

4.4.61 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.62 报告期内本基金的业绩表现

4.4.63 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.64 报告期内本基金的业绩表现

4.4.65 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.66 报告期内本基金的业绩表现

4.4.67 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.68 报告期内本基金的业绩表现

4.4.69 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.70 报告期内本基金的业绩表现

4.4.71 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.72 报告期内本基金的业绩表现

4.4.73 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.74 报告期内本基金的业绩表现

4.4.75 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.76 报告期内本基金的业绩表现

4.4.77 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.78 报告期内本基金的业绩表现

4.4.79 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.80 报告期内本基金的业绩表现

4.4.81 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.82 报告期内本基金的业绩表现

4.4.83 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.84 报告期内本基金的业绩表现

4.4.85 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.86 报告期内本基金的业绩表现

4.4.87 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.88 报告期内本基金的业绩表现

4.4.89 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.90 报告期内本基金的业绩表现

4.4.91 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.92 报告期内本基金的业绩表现

4.4.93 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.94 报告期内本基金的业绩表现

4.4.95 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.96 报告期内本基金的业绩表现

4.4.97 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.98 报告期内本基金的业绩表现

4.4.99 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.100 报告期内本基金的业绩表现

4.4.101 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.102 报告期内本基金的业绩表现

4.4.103 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.104 报告期内本基金的业绩表现

4.4.105 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.106 报告期内本基金的业绩表现

4.4.107 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.108 报告期内本基金的业绩表现

4.4.