

上投摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)

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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十四日

1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等，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信原则、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其更新。

本半年度报告摘要请见自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称: 上投摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)
基金简称: 上投摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)
基金代码: 000421
基金运作方式: 契约型开放式
基金合同生效日: 2019年1月11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
基金份额净值公告发布日: 每个交易日
基金资产净值公告发布日: 每个交易日

基金产品说明: 通过投资于精选的基金，实现资产的动态配置，实现基金资产的长期稳健增值。

1. 基金管理人通过精选的基金，选取具有潜力的基金经理和投资团队，从而选择具备长期投资价值的基金产品。

2. 基金管理人通过精选的基金，选取具有潜力的基金经理和投资团队，从而选择具备长期投资价值的基金产品。

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 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

在报告期内，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、《上投摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)基金合同》的规定，除以下情况外，基金经理对个股和股组合的过度遵循了投资决策委员会的授权限制，基金经理投资比例符合基金合同和法律法规的要求：本基金可能出现个别由于市场原因引起的的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形，但已在规定时间内调整完毕。

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，本公司继续贯彻落实《证券投资基金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流程的各项要求，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进行交易行为和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估与投资管理活动的各个环节得到公平对待。

4.3.2 同类交易行为的专项说明

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异常、对向同交易和反向交易的交易时机和交易差价监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的业绩表现

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年，国内市场总体维持震荡格局，一季度在估值修复、流动性、政策利好、外部环境改善等因素的推动下，A股市场经历了上涨超预期的春季行情，在2季度，中美贸易摩擦再次出现反复，银行信用事件爆发，风险偏好下降，国内股市也出现较大回撤，海外市场也在中美贸易反复中震荡下行。在5月市场经历较大回撤后，6月标普500指数在美联储降息预期的不断升温中也恢复上涨并创出了新高；同时全球及亚太地区也企稳反弹。

回顾我们的基金组合操作，总体维持战略配置不变，战术上A股收益组合在1季度开始略谨慎，使得基金净值在5月份A股市场震荡回落中回撤较少；配置的海外资产中，发达市场REITs和黄金资产持续为组合贡献正收益；总体而言，这种较为均衡的配置使我们保持基金组合表现稳健，波动及回撤各项风险指标得到控制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内上投摩根尚睿混合(FOF)份额净值增长率为：9.66%，同期业绩比较基准收益率为：15.83%。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年，国内市场总体维持震荡格局，一季度在估值修复、流动性、政策利好、外部环境改善等因素的推动下，A股市场经历了上涨超预期的春季行情，在2季度，中美贸易摩擦再次出现反复，银行信用事件爆发，风险偏好下降，国内股市也出现较大回撤，海外市场也在中美贸易反复中震荡下行。在5月市场经历较大回撤后，6月标普500指数在美联储降息预期的不断升温中也恢复上涨并创出了新高；同时全球及亚太地区也企稳反弹。

回顾我们的基金组合操作，总体维持战略配置不变，战术上A股收益组合在1季度开始略谨慎，使得基金净值在5月份A股市场震荡回落中回撤较少；配置的海外资产中，发达市场REITs和黄金资产持续为组合贡献正收益；总体而言，这种较为均衡的配置使我们保持基金组合表现稳健，波动及回撤各项风险指标得到控制。

4.5 管理人对报告期内基金的业绩表现

本报告期内上投摩根尚睿混合(FOF)份额净值增长率为：9.66%，同期业绩比较基准收益率为：15.83%。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的责任人以及相关基金经理，所有相关成员均有丰富的证券投资行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的主要成员，参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预估情形的说明

报告报告期内，本基金管理人存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情况，出现该情况的时间范围为2019年02月21日至2019年06月30日。

4.9 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

4.10 管理人对报告期内基金投资运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本托管人在基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人严格按照基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的估值方法、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的估值方法、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

5.4 托管人对本报告期所载信息真实性、准确性和完整性承担法律责任

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.5 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.6 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.7 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.8 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.9 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.10 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.11 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.12 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.13 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.14 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.15 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.16 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.17 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.18 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.19 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.20 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.21 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.22 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.23 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.24 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.25 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.26 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.27 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.28 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.29 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.30 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.31 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.32 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.33 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.34 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.35 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.36 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.37 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确、完整发表意见

本报告期，本托管人对本报告所载信息的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

5.