

上投摩根智慧互联股票型证券投资基金

2017第一季度报告

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
报告送出日期：二〇一七年四月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员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2017年4月20日复核了本报告中的财务指标、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好运用基金资产，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。

本报告书对基金财产净值未进行说明。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	上投摩根智慧互联股票
基金代码	001313
交易代码	001313
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月1日
报告期末基金份额总额	2,697,168,622.93份
投资目标	采用定性和定量研究方法，自下而上优选互联网主题上市公司，通过严格的风格控制，力求实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将专注于互联网行业投资，对相关行业的发展进行密切跟踪，充分把握互联网概念企业的投资机会。 在资产配置层面，本基金将根据各证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整本基金资产在股票、债券及现金类资产之间的分配比例，动态优化投资组合。
业绩比较基准	中证800指数收益率×8%+中证总债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险收益水平的基金品种。
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	(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-74,596,906.91	
2.本期利润	62,899,216.79	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0231	
4.期末基金份额净值	1,801,062,544.79	
5.期末可供分配基金份额净值	0.078	

注：本期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将低于所列数字。

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①	业绩比较基准收益率②	收益率差③=①-②	④
过去三个月	3.61%	0.94%	2.97%	0.64%

3.2.2 本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金合同生效日为2015年6月9日，图示时间区间为2015年6月9日至2017年3月31日。

本基金建仓期自2015年6月9日至2015年12月8日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期间		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郭鹏	本基金基金经理	2015-06-09	-	10年	郭鹏先生，自2007年5月至2008年4月在平安资产管理有限公司担任研究员； 2008年4月至2011年11月在东吴基金管理有限公司担任研究员； 2011年11月至2014年10月在富国基金管理有限公司担任研究员； 2014年10月起加入上投摩根基金管理有限公司担任研究员； 2015年6月起担任基金经理； 2016年6月起担任上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金经理； 2016年12月起担任上投摩根量化股票型证券投资基金基金经理； 2017年4月起担任上投摩根新兴驱动股票型证券投资基金基金经理。
王昊	本基金基金经理	-	-	-	王昊先生，本报告期初至报告期末未担任本基金基金经理。

注：1.任职日期和离任日期均指根据公司决定的聘任(解聘)和辞职日期。

2.郭鹏先生为本基金基金经理，其任职日期即为报告期末基金合同生效之日。

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券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情况的说明

在本报告期内，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，《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》的规定，基金净值对个股和投资组合的定期报告均体现了投资决策委员会的授权限制，基金投资策略符合法律法规的要求。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度执行情况

报告期内，本公司严格执行《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》，等相关法律法規和公司内部公平交易制度的各项要求，严格执行场内、场外股票、债券的一级市场申购和二级市场证券交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易行为和监控分析，以确保投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、价格优先的原则，严格地防范不公平交易行为。

所有投资组合参与的交易所公开日同日反向交易成交较少的单边交易量超该证券当日成交量的5%的情形，报告期内，所有投资组合参与的交易所公开日同日反向交易成交较少的单边交易量超该证券当日成交量的5%的次数为两次，均发生在纯量化投资组合与主动管理投资组合之间。

4.4 报告期内基金的估值政策和程序说明

4.4.1 估值政策和程序

本基金的估值政策和估值程序遵循《证券投资基金会计核算办法》及其他有关规定。

4.4.2 估值差额的确定依据

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.3 估值差额的计算方法

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.4 估值差额的日常处理

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.5 估值差额的特殊情况说明

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.6 估值差额的披露

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.7 估值差额的备查文件

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.8 估值差额的年度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.9 估值差额的半年度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.10 估值差额的季度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.11 估值差额的临时公告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.12 估值差额的年度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.13 估值差额的半年度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.14 估值差额的季度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.15 估值差额的临时公告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.16 估值差额的年度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.17 估值差额的半年度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.18 估值差额的季度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.19 估值差额的临时公告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.20 估值差额的年度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.21 估值差额的半年度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.22 估值差额的季度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.23 估值差额的临时公告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.24 估值差额的年度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.25 估值差额的半年度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.26 估值差额的季度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.27 估值差额的临时公告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.28 估值差额的年度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.29 估值差额的半年度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.30 估值差额的季度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.31 估值差额的临时公告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.32 估值差额的年度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.33 估值差额的半年度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。

4.4.34 估值差额的季度报告

本基金的估值差额是基金管理人持有的证券在评估日的公允价值减去评估日的账面价值。