

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金

[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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事局及董事会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。
基金托管人中国建设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。

基金的过往业绩并不代表未来表现。投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本公司对中期报告财务数据进行了审计。

本报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根中证消费服务指数
基金代码	570023
交易代码	570023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月26日
报告期末基金份额总额	14,678,906,656份

本基金通过被动化指数化投资，通过严格地按照标的指数的构成和权重配置资产，以期实现对中证消费服务领先指数的有效跟踪。

本基金采用完全复制法，按照行业分类指数的构成比例及其权重配置股票资产，并结合定期调整和不定期调整两种方法进行投资操作。本基金将通过其他方法调整资产组合，力求实现对标的指数的跟踪误差最小化。

业绩比较基准 95%×中证消费服务领先指数+5%×银行活期存款利率

风险收益特征 本基金为指数型基金，长期平均风险和预期收益率高于货币型基金，低于股票基金，货币市场基金等，为中风险收益产品。

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

§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	-86,147.08
2.本期利润	659,290.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.0430
4.期末基金资产净值	19,318,906.76
5.期末基金份额净值	1.316

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利润。

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期内基金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 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.30% 0.50% 3.87% 0.51% -0.57% -0.01%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年9月26日至2017年3月31日)

注:本基金合同生效日为2012年9月25日,图示期间为2012年9月25日至2017年3月31日。本基金建仓期自2012年9月25日至2013年3月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	离任日期	证券从业年限	说明
黄桥	本基金基金经理兼理财总监	2012-09-26	-	12年	

注:1.任本基金基金经理的日期即为本基金首次开放日;2.任职期间,本基金管理人未变更过基金名称;3.证券业协会对基金管理人从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作的说明

报告期内,基金管理人不存在对基金持有人利益造成损害的情况。

在本基金期内,基金管理人不存在对基金持有人的利益造成损害的情况,基金管理人承诺在基金合同约定的范围内公平对待所有客户。

基金管理人对报告期内基金的投资策略、运作特点和投资风格等情况的说明

本基金报告期内,基金管理人对报告期内基金的投资策略、运作特点和投资风格等情况的说明。

4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司严格执行公平交易制度,确保不同投资组合在买卖股票时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。

对于交易所大宗交易,本公司执行大宗交易制度,确保不同投资组合在大宗交易时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。

对于银行间同业拆借,本公司执行银行间同业拆借制度,确保不同投资组合在银行间同业拆借时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。

对于交易所债券回购,本公司执行交易所债券回购制度,确保不同投资组合在交易所债券回购时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。

对于银行间债券回购,本公司执行银行间债券回购制度,确保不同投资组合在银行间债券回购时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。

对于交易所股票期权,本公司执行交易所股票期权制度,确保不同投资组合在交易所股票期权时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。

对于银行间股票期权,本公司执行银行间股票期权制度,确保不同投资组合在银行间股票期权时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。

对于商品期货,本公司执行商品期货制度,确保不同投资组合在商品期货时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。

对于商品期权,本公司执行商品期权制度,确保不同投资组合在商品期权时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。

对于商品远期,本公司执行商品远期制度,确保不同投资组合在商品远期时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。

对于商品掉期,本公司执行商品掉期制度,确保不同投资组合在商品掉期时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。

对于商品互换,本公司执行商品互换制度,确保不同投资组合在商品互换时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。

对于商品期权,本公司执行商品期权制度,确保不同投资组合在商品期权时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。

对于商品远期,本公司执行商品远期制度,确保不同投资组合在商品远期时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。

对于商品掉期,本公司执行商品掉期制度,确保不同投资组合在商品掉期时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。

对于商品互换,本公司执行商品互换制度,确保不同投资组合在商品互换时,按照相同时间、比例分配,防范各投资组合之间不公平交易行为。