基金托管人:中国银行股份有限公司

不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

湖末基金

Q 密销略

U险收益特征

3.1 主要财务指标

1.本期已实现收益

期末基金资产净值

3.2 基金净值表现

准收益率变动的比较

正基金一定盈利。

基金运作方

投资策略

业绩比较基准

(1)险收益特征

3.1 主要财务指标

3.2 基金净值表现

阶段

と 易代码

2资目标

投资策略

(绩比较基准

**双脸收益特征** 

基金合同生效F

报告期末基金份额总额

设告期末基金(

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司 报告送出日期:二〇一七年十月二十六日

虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏

立仔细阅读本基金的招募说明书。 本报告中财务资料未经审计。 本报告期自2017年7月1日起至9月30日止

5.期末基金份额為#

本期利润

值变动收益。

低于所列数字。

主要财务指标

甚么管理

报告送出日期:二〇一七年十月二十六日

《1 重要提示 基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25

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

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

《2 基金产品概况

公司,通过严格的风险控制,万争实现基金资产的长期增值。 基础金将通过系统和深入的基本调研究、需以工注处于特别 前,通过高频大学技术为经济发展带装调等长点的相对 市设度。 市场,通过高频大学技术为经济发展带装调等长点的相对 市场及分别。 在行政管理层调。本基金等从方型生物问题, 并发现。 有关键、资格等的概念。 有关键、资格等的形态。 分析上市公司的业绩则值,或性性和信息大平等,精选具有目 和发生,在发生,但是可能分别。

基金属于混合型基金产品,预期风险和收益水平高于债 基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于较高风险收 平的基金产品。基金风险收益特征会定期评估并在公司 发布,请收容者关注。

注: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

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

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基

"旅店送田口房!"——一一年十月一十八日 第1 重要提示 基金管理人的董事会及董事保证本报告所裁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。 基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25

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

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

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

基金产品概况

投摩根基金管理有問

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公分

基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要

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

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

2-4

| 浄値増长 | 浄値増长 | 歩値比較基 | 北郷比較基 | 北東京本 | (① - 3) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2) | (2)

上投摩根稳进回报混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2015年1月27日至2017年9月30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送出日期:二〇一七年十月二十六日报告送出日期:二〇一七年十月二十六日报告送路月不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性,能哪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10月25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,误导性除述或者重大遗漏。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金管理人派培以戰头信用、劉勉公內印所與自建的場合。 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 应行细阅读本基金的招募说明书。 本报告明自2017年7月1日起至9月30日止。 《2.基金产品概况

:投摩根现金管理货币

.965.955.993.5

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与 准收益率变动的比较

主要财务指标和基金净值表现

格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定回扣

1)-(3)

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

基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要

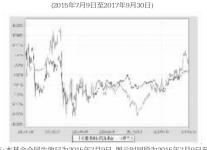
日复核了本根告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容

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。



### 上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金

上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金 要计净值增长率与业绩比较其准收益率历史未垫对比图



注:本基金合同生效日为2015年7月9日,图示时间段为2015年7月9日至2017

本基金建仓期自2015年7月9日至2016年1月8日,建仓期结束时资产配置比

《4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基	任本基金的基金经理期限		说明
X±-451	101.93	任职日期	离任日期	限	10091
李德辉	本基金基基金经理	2016-11-18	-	5年	李德辉先生,上海交通大学生物医学工精神上自201 生物医学工精神上自201 生尔月至2014年7月,在7 银江里基金管目2014年7月 起压研究人上投除根据生任约 月根公司人上投除根据生任约 月根公司人上投除根据生任约 里相自2016年11月起阻 里自2016年11月起日 上投降根料技的资基金是 金经理。

2.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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信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、《上投歷根 科技前沿灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投 资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基金合同和 法律法规的要求。

43 公亚芬县专项说明

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《证券投资基金管理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 式进行交易执行和监控分析,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、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动,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,比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易 量;对于银行间市场投资活动,本公司通过对手库控制和交易室询价机制,严格防

2017年第三季度报告 范对手风险并检查价格公允性;对于申购投资行为,本公司遵循价格优先、比例分

配的原则,根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。 报告期内,通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向 交易的交易时机和交易价差监控分析,未发现整体公平交易执行出现异常的情

报告期内,通过对交易价格、交易时间、交易方向等的分析,未发现有可能导

致不公平交易和利益输送的异常交易行为。 所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量 超过该证券当日成交量的5%的情形:无。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内甚全投资策略和运作分析 2017年三季度,市场稳步上行,结构性分化明显,上证指数上涨4.9%,创业板 指上涨2.69%,本基金涨幅6.57%。从结构性看:有色金属、钢铁、食品饮料、电子、 通信等涨幅靠前,公用事业、纺织服装、传媒、建筑装饰等跌幅靠前。

我们认为全年大盘还是稳步上行,因为经济企稳、多数行业的企业盈利改善 明显,资金面适度宽松,股市流动性较好。

本基金结构上重点关注的方向:1)消费电子&LED&安防:苹果引领的技术 创新有望带动手机行业单机价格和销量稳步增长,国内电子龙头公司不断扩充产品和提升份额,有望持续较快增长。LED和安防行业增速稳定,龙头公司竞争优势 明显。2)新能源汽车:看3-5年维度,新能源汽车行业空间较大,渗透率非常低,行 业产值较大,未来上游资源厂商,中下游有核心制造能力的企业有望做大。3)新 能源:由于整个产业链成本下降较快,政府对分布式光伏的补贴力度较大,共同刺 激行业需求超预期,我们认为2-3年之内产业链成本可以较大压缩,初步实现平价 上网,进一步刺激需求。4)低估值的地产、家电及部分周期股等,地产行业优秀公 司集中度在提升:家电和部分周期股公司估值并不高。

我们希望通过积极操作,挑选长期有竞争力、盈利较好的公司,力争创造超额 收益,给持有人较好回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现 本报告期本基金份额净值增长率为6.57%,同期业绩比较基准收益率为

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

《5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的 比例(%)
1	权益投资	74,347,703.65	86.75
	其中:股票	74,347,703.65	86.75
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	_
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融 资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,271,656.25	13.15
7	其他各项资产	81,815.84	0.10
8	合计	85,701,175.74	100.00

公允价值(元 5基金资产净值 比例(%) 、林、牧、渔业 信息传输、软件和 足服务、修理和其他服务 化、体育和娱乐 5.3 报告期末按公允价值占其全资产净值比例大小排序的前十夕股票投资明

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
1	600703	三安光电	267,947.00	6,200,293.58	7.28
2	002456	欧菲光	280,456.00	5,942,862.64	6.98
3	300136	信维通信	140,598.00	5,905,116.00	6.93
4	002236	大华股份	224,500.00	5,403,715.00	6.34
5	002475	立讯精密	249,672.00	5,158,223.52	6.06
6	300450	先导智能	52,084.00	3,885,466.40	4.5€
7	300115	长盈精密	103,367.00	3,573,397.19	4.20
8	002460	赣锋锂业	34,034.00	2,971,168.20	3.49
9	002127	南极电商	178,288.00	2,800,904.48	3.29
10	002466	天齐锂业	38,500.00	2,706,165.00	3.18

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明

本基金本报告期末未持有债券。 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证

券投资明细 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属。 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.1报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部 门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。 5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库

之外的股票。

0.11.0 5	KIEDO) 19AX	
序号	名称	金額(元)
1	存出保证金	40,662.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	=
4	应收利息	2,476.17
5	应收申购款	38,676.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	81,815.84

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。 5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五人原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

《6 开放式基金份额变动

单位:份

《7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 无。 《8 备查文件目录

8.1 备查文件日录

1. 中国证监会批准上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金设立的

2. 《上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.《上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金托管协议》; 4. 《上投摩根开放式基金业务规则》;

5. 基金管理人业务资格批件,营业执昭:

6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。 8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件,

二〇一七年十月二十六日

上投摩根基金管理有限公司

## 上投摩根稳进回报混合型证券投资基金

### 2017年第三季度报告

# 本基金合同生效日为2015年1月27日,图示时间段为2015年1月27日至

本基金建仓期自2015年1月27日至2015年7月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 7.50 基金经理助 2.50 基金经理助 2.50 国定收益部 2.50 数事业部临时 务,自2014年E 投摩根基金管 投摩根纯债债 资基金基金经 英曙光 本基金 基金经 2.聂曙光先生为本基金首任基金经理,其任职日期指本基金基金合同生效之

Η. 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 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2 管理人对报告期/)本基金应作课现守管局心的规则 在本根告期内,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 有关法律法职《上投摩根稳进回根混合型证券投资基金基金合同》的规定。基金 经理对个股租投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例 符合基金合同和法律法规的要求。 4.3 公平交易专项说明

报告期内,本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理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 股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等占动,通过系统和人工相给合的方式进行交易执行和监控分析、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、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。 对于交易所市场投资活动,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、比例分配的原则库各投资组合间次平分配交易 量;对于银行间市场投资活动,本公司通过对手库控制和交易室询价机制,严格防

范对手风险并检查价格公允性;对于申购投资行为,本公司遵循价格优先、比例分 配的原则,根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。 报告期内,通过对不同投资组合之间的收益率差异比较,对同向交易和反向 交易的交易时机和交易价差监控分析,未发现整体公平交易执行出现异常的情

4.3.2 异常交易行为的专项说明 报告期内,通过对交易价格、交易时间、交易方向等的分析,未发现有可能导 致不公平交易和利益输送的异常交易行为。 所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量 超过该证券当日成交量的5%的情形:无

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4 报台房內確並印放支权經常經常經過經過 4.4.1报告期內基金投資策略和這件分析 季度经济增长数据有所被动,但并无明显趋势变化且存在环保限产等因素 的执动,市场未移其理解为经济周期下行;以黑色系为代表的大宗商品价格上涨, 对通胀预期有小幅影响;社会融资总额和信贷等数据显示金融对实体经济支持力 度保持稳定。三季度银行间市场资金面保持紧平衡,货币政策中性立场未变。三季度债券市场呈现小幅震荡上行格局,以十年期国债为代表的利率债收益率接近前 度饭券币场点规小佩震荡上午格局,以十年期围俄为代表的利率值收伍率举放山附高点,二等度A股市场餐体表现较好,消费和周期表,二等是A股市场保养表现较好,消费和周期类行业均有不错行情,白酒、钢铁,电子和新能源汽车板块涨幅较大,白马股风格占优。三季度较价延续此前跟路,精选业绩稳定,估值合理的个股。本基金三季度对债券投资的并靠镇公场,以20人明晶中为主,精选个参信用资质。是型四季度,是央行节前预告远期降准,但在经济保持稳健的情况下,并非如保护机器。

传统殷释放整体宽松信号,而是为了缓解在当前基础货币投放机制下中小银行难 以从央行获取资金的结构性问题,未来货币政策走势仍需视经济周期走势而定。 12从外代13年取實金的目標中計劃總。未來度由政東定等的清明定於前別東定對問題。 当前部分品排收益率已经有一定吸引力,可在深入研究信用基本面的基础上逐步 买入,若债券收益率整体继续向上,则考虑逐步加长久期。四季度在股票投资上本 基金将凈机关注估值合理。具备较好投资价值的大消费等板块。 4-2 报告期内基金份额净值增长率为1.00%,同期业绩比较基准收益率为

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

《5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

丹号	坝目	並領(元)	比例(%)
1	权益投资	11,703,433.50	12.53
	其中:股票	11,703,433.50	12.53
2	固定收益投资	57,276,532.73	61.31
	其中:债券	57,276,532.73	61.31
	资产支持证券	-	_
3	贵金属投资	-	_
4	金融衍生品投资	-	_
5	买入返售金融资产	11,000,000.00	11.77
	其中: 买断式回购的买人返售金融 资产	-	_
6	银行存款和结算备付金合计	12,236,672.02	13.10
7	其他各项资产	1,206,035.12	1.29
8	合计	93,422,673.37	100.00

行业类别 信息传输、软件和信息技术服务业 民服务、修理和其他服 文化、体育和娱乐)

基金资产净值 比例(%) 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 4 300115 长級精密 5.4 报告期末按债券品种分类 金融债券

其中:政策性金融 È业债券

已业短期融资券

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元 170,000 16,811,300.0

16,811,300.0

超过120天情况说明 组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的 券投资明细 509400 本基金本报告期末未持有资产支持证券。 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资 明细 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比

与期内投资组合平均剩余期限

平均剩余期限

其中:剩余存续期超 197天的浮动利率债

细 本基金本报告期末未持有权证。 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 本基金本报告期末未持有股指期货。 5.10报台期本本基金投资的国债期货交易情况说明 本基金本报告期末未持有国债期货。 5.11 祝客组令报告附近。 5.11 投资组合报告附注 5.11.1报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部 门立案颁查。或在报告编制日前一年内受到公开谴责,处罚的情形。 5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库 之外的股票。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明

5.11.3 其他资产构成 序号 名和

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 15天集EE

格力转债

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 《8 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1. 中国证监全批准上投摩根验进回报混合型证券投资基金设立的文件;
2. 《上投摩根稳进回报混合型证券投资基金基金合同》;
3. 《上投摩根稳进回报混合型证券投资基金基金合同》;
4. 《上投摩根稳进回报混合型证券投资基金基金代管协议》;
4. 《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照;
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照;
9.2 符放地点
基金管理人或基金托管人处。
9.3 查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

## 上投摩根现金管理货币市场基金

### 2017年第三季度报告

## 注: 本基金建仓期自2014年8月19日至2015年2月18日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。 本基金合同生效日为2014年8月19日,图示时间段为2014年8月19日至2017年9月30日。 《4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

.1 垣	金红理(	以基玉红理	小组刀间汀			
姓名	职务	任本基金的基	基金经理期限	证券从业年	1位8月	
AE-ES	10/07	任职日期	离任日期	限	10°09'3	
5晨波	本基金基货 经金币场货 经租赁 电极电极 电极电极 电极电极 电极电极 电极电极 电极电极 电极电极 电极	2014-08-19	-	8年(金融领域从业经验 22年)	無關政女士, 经济学学士, 仍任何企业, 经济学学士, 仍任荷兰级人员, 加州 国际的人员, 加州 国际的人员,和州 国际的人员, 加州 国际的人员, 加州 国际的人员, 加州 国际的人员, 加州 国际的人员, 加州 国际的人员,	
鞠嬣	本基金基金经理	2015-07-09	-	3年(金融領域从业经验 12年)	關聯女士、1997年7月至 2001年5月在中国建设经济 行第一2006年3月在任业2014年6日 2006年3月20日4年10 月在瑞疆银行总行租任2014年10 月月在瑞疆银行总行租6日 1月在10日1日 月在10日1日 1月日 1日日 1日日 1日日 1日日 1日日 1日日 1日日 1日日	
E:1.(	E:1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。					
.孟晨	孟晨波女士为本基金首任基金经理,其任职日期指本基金基金合同生效					
.证券	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					

定。
 4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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减求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他 有关法律法规、《土投降规划金管理货币市场基金基合合同》的规定。基金经理分 伦斯和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基 金合同和法律法规的要求。
 4.3 公平交易专项说明
 4.3 公平交易专项说明

4.3 公平交易专项设计 4.3 公平交易专项设计 报告期内,本公司嫁线贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导 报告期内,本公司嫁线贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导 股票,债券的一级市场中购和工级市场交易等估动,或近去统和人工相结合的方 式进行交易执行和监控分析,以确保本公司管理的不同投资组合在提权,研究分 析,投资决策、交易执行。如课年后等投资管理运动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动,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、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易 量;对于银行间市场投资活动,本公司通过对手库控制和交易室询价机制,严格的 范对手以险并检查价格公允性;对于申购投资行为,本公司遵循价格优先、比例分 能对原则,根据事前独立中报的价格和数是对交易结果进行公平为位。 报告期内,通过对不同投资组合之间的收益率差异比较,对同向交易和反向 交易的交易时机和交易价差监控分析,未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

现不如前期,但9月份有明显改善,预计三季度GDP增速会至6.8%左右,基本符合目标。 回顾三季度、7月中下旬受到季节缴税,地方债发行等因素影响,添动性有所收紧,资金和率相比月初大城上行。央行不7月末加大港动地投放力度。尽量减缓 燃烧对流动地短期中击。8月中下旬受创帅期公开市场创期资金规模偏大。季节缴 税。超储率连续下降,存款准备金上缴等叠加因素,流动性超预期收紧,央行通过 税。超储率连续下降,存款准备金上缴等叠加因素,流动性超预期收紧,央行通过 税。超储率连续下降,存款准备金上缴等叠加因素,流动性超预期收紧,央行通过 税上,国库现金定存加大税放力度,资金面紧张情势边际级解。进入9月,为了继 争度市场开始进入自主动支机杆的股、资金面的经保持案平衡状态。受此影响,债 券收战率一直维持高位震荡。资金价格一直处于相对高位。 本基金在一季度继续经行审值。稳定的结构化投资重略。以流动性、安全性为 首要目标。以短久期强略为主,控制债券的持仓仓位。同时,择机增能迎回膨和协 过存款,提高基金收益水平、主动了解各户率未现金流动向,做好流功性的能性的 理、实现平稳跨季。 展程四单度,政策意图上稳增长和防风险将并行推进。面对美联储进入缩表 周期,在"去杠杆"初步取得成效(任务尚未完成之际、货币政策大概率不宽处。但 资金价格预计也难以大概

0.0894%。 4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 5.1 报告期末基金资产组合情况。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的 比例(%)
1	固定收益投资	219,540,251.0	00 11.16
	其中:债券	219,540,251.0	00 11.16
	资产支持证券		
2	买人返售金融资产	760,000,000.0	00 38.62
	其中:买断式回购的买人返 售金融资产		
3	银行存款和结算备付金合 计	916,886,669.1	2 46.60
4	其他各项资产	71,253,6992	3.62
5	合计	1,967,680,619.4	100.00
5.2 扌	设告期债券回购融资情	況	
序号	项目	占基金资产净值的比	例(%)
-1	报告期内债券回购融资余	颇	_
1	其中:买断式回购融资		_
序号	项目	金額	占基金资产净值的 比例(%)
2	报告期末债券回购融资余	Ø -	_
2	甘由, 亚斯才同胞脑炎	_	

20%。 5.3 基金投资组合平均剩余期限

30天(含)—60天 其中:剩余存续期走 397天的浮动利率债 60天(含)—90天 其中:剩余存续期 397天的浮动利率债 90天(含)—120天 其中:剩余存续期 397天的浮动利率债 120天 (含)—397 5.4报告期内投资组合平均 在本报告期内本基金未出 5.5 报告期末按债券品种 [240大情况说明 剩余存续期超过240天的情况。 的债券投资组合 基金资产净值比 例(%) 债券品种 2 央行票据 6 中期票据 7 同业存单 10 剩余存续期超过3 浮动利塞债券 5.6 报告期末按摊余成本占基金资 -名债券投资 债券数量 (张) 序号 债券代码 债券名称 摊余成本(元 11170603 400,000 39,785,768 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明 在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的

报告期方负偏源度的绝对值达到0.25%情况说明 本报告期未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。 报告期内正偏离度的绝对值达到0.55%情况说明 本报告期未发生近偏离度的绝对值达到0.5%情况说明 本报告期未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。 5.8报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证 5.8报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证 资明细 本基金本报告期末未持有资产支持证券。 本基金本位置與不來行有效产叉行业券。 5.9 投资组合报告附注 5.9.1基金计价方法说明 本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买人成本列示,按票面利率或商 定利率并考虑其买人时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法摊销,每日 计据收益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产 净值。 3 应收利息
4 应收申购款
5 其他应收款 6 待摊费用 8 合计 71,253,699.28 5.94投资组合报告附注的其他文字描述部分 因四舍五人原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存 报告期期末基金份 《7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 § 8 影响投资者决策的其他重要信息 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 投资者类 別 申购 份額 赎回 份额 持有份额 20170701-201 0930 本基金的集中度风险主要体现在有单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%,如果批资者发生大额赎回,可能出现基金可变现资产无法满足投资者赎回需要以及因为资产变现成未访高等现场逐渐的超级强制率的风险。 注:红利再投资计入申购份额 8.2 影响投资者决策的其他重要信息 § 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录 1.中国证监会批准上投摩根现金管理货币市场基金设立的文件 2.(上投摩根现金管理货币市场基金基金合同》 3.(上投摩根现金管理货币市场基金并管协议》 4.(上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》 5.基金管理人业务资格比个司共成图 6.基金社管人业务资格比件、营业执照 9.2 左校地点

9.2 存放地点 基金管理人或基金托管人处。 9.4 计加速。 报金管理人或基金托管人处。 9.3 查阅方式 投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。 上投歷根基金管理有限公司 二〇一七年十月二十六日

2-4

基金管理人 -投壓根基金管理有 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:人民币元 2.5.77.450.00 3周末基金资产单值 1.5665.696512 注: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)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)由于货币市场基金采用继索成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。上读其全心处的参用(例加集全结场费等)计。从表 本期已实现收益和本期利润的金额相等。 上述基金业绩指标不包括交易基金的各项费用(例如基金转换费等),计人费用后实际收益水平要低于所列数字。

以来基金累计净值收益率变成 3.2.2目基金合 收益率变动的比较 刊比较 上投摩根现金管理货币市场基金 累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2014年8月19日至2017年9月30日)

3.2 基金净值表现 3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较