上投摩根安丰回报混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人: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

§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。

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。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根安丰回报混合	
基金主代码	004144	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年1月18日	
报告期末基金份额总额	550,233,338.01份	
投资目标	以追求稳健收益作为基金的投资目标,通过严格的风险控制,力争实现基金资产的稳健增值。	
投资策略	1、资产配置策略 本基金将通过对宏观经济、国家政策、资金面、市场估值水平和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行综合分析,评估股票、债券等各类资产风险收益特征,预测不同类别资产表现,确定合适的资产配置比例。同时采用严格的仓位控制策略,根据基金单位净值的变化和对未来市场的判断,灵活控制股票仓位,控制下行风险。 2、债券投资策略 本基金根据对财政政策、货币政策的分析以及对宏观经济的持续跟踪,结合不同债券品种的到期收益率、流动性、市场规模等情况,灵活运用久期策略、期限结构配置策略、信用债策略、可转债策略、中小企业私募债策略、证券公司短期债等多种投资策略,实施积极主动的组合管理,并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测,对债券组合进行动态调整。 3、股票投资策略 本基金将采用自下而上的分析方法,根据上市公司财务分析、盈利预期、治理结构等因素,结合股票的价值评估,以及对公司经营有实质性影响的事件,精选个股,构建投资组合。 4、股指期货投资策略 本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。 5、股票期权投资策略 本基金将基于对证券市场的预判,并结合股票期权定价模型,选择估值合理的期权合约。 6、资产支持证券投资策略 本基金主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估,确定资产合理配置比例。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×20%+中证综合债券指数收益率×80%	
风险收益特征	本基金属于混合型基金产品,预期风险和收益水平高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于中等风险水平的产品。 本基金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。	
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	
下属分级基金的基金简称	安丰回报A	安丰回报C
下属分级基金的交易代码	004144	004145
报告期末下属分级基金的份额总额	550,026,838.72份	206,499.29份

§3 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

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)	
	安丰回报A	安丰回报C
1.本期已实现收益	13,135,776.63	4,698.37
2.本期利润	11,092,053.12	3,955.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0202	0.0192
4.期末基金资产净值	570,857,955.85	213,869.44
5.期末基金份额净值	1.0379	1.0357

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。

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、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

1、安丰回报A:

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	1.98%	0.11%	1.43%	0.12%	0.55%	-0.01%

2、安丰回报C:

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	1.91%	0.11%	1.43%	0.12%	0.48%	-0.01%

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准收益率变动的比较

上投摩根安丰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的历史走势对比图

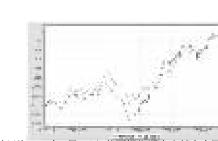
(2017年1月18日至2017年9月30日)

1. 安丰回报A:

注:本基金合同生效日为2017年1月18日,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

本基金建仓期自2017年1月18日至2017年7月17日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

2. 安丰回报C:



注:本基金合同生效日为2017年1月18日,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

本基金建仓期自2017年1月18日至2017年7月17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

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
施斌文	本基金基金经理	2017-01-18	-	5年	基金经理施斌文先生,北京大学经济学硕士,2012年7月起加入上投摩根基金管理有限公司,在研究部任助理研究员、研究员,主要承担量化支持方面的工作。自2017年1月起同时担任上投摩根安丰回报混合型证券投资基金基金经理及上投摩根安泽回报混合型证券投资基金基金经理。
唐瑭	本基金基金经理	2017-01-18	-	9年	英国爱丁堡大学硕士,2008年2月至2010年4月任JPMorgan(EMEA)分析师,2011年3月加入上投摩根基金管理有限公司,先后担任研究员及基金经理助理,自2015年5月起担任上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金基金经理,自2015年12月起同时担任上投摩根强化回报债券型证券投资基金和上投摩根轮动添利债券型证券投资基金基金经理,自2016年5月起同时担任上投摩根双债增利债券型证券投资基金基金经理,自2016年6月起同时担任上投摩根分红添利债券型证券投资基金及上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金基金经理,自2016年8月起同时担任上投摩根岁岁丰定期开放债券型证券投资基金基金经理,自2017年1月起同时担任上投摩根安丰回报混合型证券投资基金基金经理及上投摩根安泽回报混合型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 唐瑭女士、施斌文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日。

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、《上投摩根安丰回报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。

4.3 公平交易专项说明

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况。

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

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

3季度债券市场震荡行情为主。经济基本面上,中上游企业在供给侧改革的推动下盈利水平有明显改善,GDP表现出较强的韧性,但增速较二季度略有放缓。通胀水平整体保持平稳。货币政策保持中性,银行间资金水平中性偏高,整体收益率曲线较为平坦。权益方面,3季度A股市场持续上扬,市场呈现普涨的行情,周期产品价格显著回升,有色、钢铁、煤炭等行业涨幅居前;而业绩稳定的消费类行业,如电子、白酒、新能源汽车等也有不俗表现。个股层面,股价表现仍有一定的分化,白马龙头依旧占优。

报告期内,本基金保持中性久期,适度增加了债券组合的仓位,为组合提供平稳的持有收益;股票组合的风格特征较为均衡,重点配置业绩稳定增长的行业龙头公司,并积极参与新股申购。

上半年我国经济复苏势头较好,GDP数据高于此前预期。但进入3季度后,我们看到工业增加值、出口、房地产投资数据均有下滑的迹象,加上近期各地的地产调控政策仍在不断加码,我们预计四季度及明年一季度经济增长势头可能有所降温。国庆节前央行宣布将定向降准,虽然此举仅为货币政策的微调,4季度货币环境大概率将维持当前水平。另外,美欧经济数据良好,市场对美国年内再加息的预期进一步升温。

综合各种因素,我们认为4季度债市收益率有回落的空间,本基金将适度提高债券组合仓位,精选个券,在保持组合流动性的前提下,力争实现组合稳健增值。而A股市场可能宽幅震荡,整体的估值提升空间有限,我们将在控制基金整体风险的前提下,继续按照既定的资产配置策略进行股票投资,重点关注3季报及年报预增行情,加大配置业绩持续增长、估值安全边际较高的个股。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A类份额净值增长率为1.98%,本基金C类基金份额净值增长率为1.91%,同期业绩比较基准收益率为1.43%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	103,780,840.98	15.93
	其中:股票	103,780,840.98	15.93
2	固定收益投资	434,105,122.70	66.64
	其中:债券	432,139,122.70	66.33
	资产支持证券	1,966,000.00	0.30
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	43,000,000.00	6.60
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	63,609,842.61	9.76
7	其他各项资产	6,969,545.66	1.07
8	合计	651,465,351.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	39,793.60	0.01
C	制造业	50,916,553.71	8.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	12,640,782.00	2.21
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,196,321.91	0.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	38,365,859.04	6.72
K	房地产业	431,152.80	0.08
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.02
R	文化、体育和娱乐业	31,224.45	0.01
S	综合	-	-
	合计	103,780,840.98	18.17

5.3 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股票投资明细

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	600519	贵州茅台	17,000.00	8,799,880.00	1.54
2	600036	招商银行	276,100.00	7,054,355.00	1.24
3	002460	赣锋锂业	75,700.00	6,608,610.00	1.16
4	601318	中国平安	119,900.00	6,493,784.00	1.14
5	601688	华泰证券	286,892.00	6,489,497.04	1.14
6	000333	美的集团	110,000.00	4,860,900.00	0.85
7	000651	格力电器	126,200.00	4,782,980.00	0.84
8	601668	中国建筑	439,400.00	4,077,632.00	0.71
9	300115	长盈精密	116,401.00	4,023,982.57	0.70
10	002035	华帝股份	143,900.00	3,878,105.00	0.68

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	30,317,372.70	5.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	142,416,750.00	24.94
5	企业短期融资券	100,106,000.00	17.53
6	中期票据	159,298,000.00	27.89
7	可转债(可交换债)	1,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	432,139,122.70	75.67

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细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019552	16国债24	303,690	30,317,372.70	5.31
2	011790002	17皖山鹰SCP006	200,000	20,032,000.00	3.51
3	011758065	17泸州窖SCP001BC	200,000	20,026,000.00	3.51
4	122181	12山鹰债	100,000	10,373,000.00	1.82
5	101474003	14泸州窖MTN001	100,000	10,251,000.00	1.80

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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比(%)
1	1789055	17兴银1A3	200,000.00	1,966,000.00	0.34

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。

5.8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国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的华泰证券股份有限公司(以下称"华泰证券",股票代码601688)于2016年11月29日公告称,华泰证券收到中国证监会《行政处罚决定书》([2016]126号),主要内容如下:

华泰证券未按照《证券登记结算管理办法》第24条、《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第6条、第8条、第13条,《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第3条第(4)项、《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第50条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第28条第1款规定。

依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定,中国证监会决定:

对华泰证券责令改正,给予警告,没收违法所得18,235,275.00元,并处以54,705,825.00元罚款。

对上述股票投资决策程序的说明:本基金管理人在投资华泰证券前严格执行了内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库,由研究员跟踪并分析。上述事件发生后,本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

除上述股票外,本基金投资的其余前九名证券的发行主体本期未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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	68,587.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,900,958.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,969,545.66

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无流通受限情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入的原因,投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	安丰回报A	安丰回报C
本报告期期初基金份额总额	550,030,217.25	227,572.26
报告期基金总申购份额	1,546.83	9,677.73
减:报告期基金总赎回份额	4,925.36	30,750.70
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	550,026,838.72	206,499.29

§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 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20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	550,012,000.04	0.00	0.00	550,012,000.04	99.96%
产品特有风险							
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%,如果投资者发生大额赎回,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本过高导致投资者的利益受到损害的风险。							

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

无

§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安丰回报混合型证券投资基金设立的文件;
2.《上投摩根安丰回报混合型证券投资基金基金合同》;
3.《上投摩根安丰回报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、营业执照;
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

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。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一七年十月二十六日

上投摩根天添盈货币市场基金

2017年第三季度报告

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年十月二十六日

§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。

基金托管人中信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。

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。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根天添盈货币		
基金主代码	000855		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年11月25日		
报告期末基金份额总额	342,686,770.09份		
投资目标	在有效控制投资风险和保持较高流动性的前提下,为投资者提供资金的流动性储备,进一步优化现金管理,并力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。		
投资策略	本基金将综合考虑各类可投资品种的收益性、流动性及风险性特征,对各类资产进行合理的配置和选择。在保证基金资产的安全性和流动性基础上,力争为投资者创造稳定的投资收益。本基金以短期金融工具作为投资对象,基于对各细分市场的市场规模、交易情况、各交易品种的流动性、相对收益、信用风险以及投资组合平均剩余期限要求等重要指标的分析,确定(调整)投资组合的类别资产配置比例。利率变化是影响债券价格的最重要因素,本基金将通过对国内外宏观经济走势、货币政策和财政政策、市场结构变化和短期资金供给等因素的分析,形成对未来货币市场利率变动的预期,并依此确定和调整组合的平均剩余期限。在个券选择层面,本基金将综合考虑安全性、流动性和收益性等因素,通过分析各个金融产品的剩余期限与收益率的配比状况、信用等级、流动性指标等因素进行证券选择,选择风险收益配比最合理的证券作为投资对象。		
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。 本基金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。		
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	天添盈A类	天添盈B类	天添盈E类
下属分级基金的交易代码	000855	000856	000857
报告期末下属分级基金的份额总额	4,093,343.73份	205,609,825.20份	132,983,601.16份

§3 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

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)		
	天添盈A类	天添盈B类	天添盈E类
1.本期已实现收益	27,970.44	1,965,900.56	1,264,312.47
2.本期利润	27,970.44	1,965,900.56	1,264,312.47
3.期末基金资产净值	4,093,343.73	205,609,825.20	132,983,601.16

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摊余成本法核算,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),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、天添盈A类:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9044%	0.0005%	0.3403%	0.0000%	0.5641%	0.0005%

2、天添盈B类:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9652%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	0.6249%	0.0004%

3、天添盈E类:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9423%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	0.6020%	0.0004%

注:本基金收益分配按日结转份额。

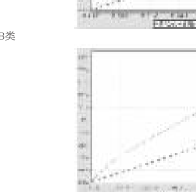
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根天添盈货币市场基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

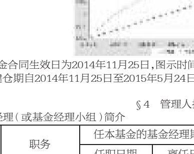
(2014年11月25日至2017年9月30日)

1、天添盈A类



2、天添盈B类

3、天添盈E类



注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间段为2014年11月25日至2017年9月30日。

2.本基金建仓期自2014年11月25日至2015年5月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同的规定。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孟晨波	本基金基金经理、货币市场投资部总监、总经理助理	2014-11-25	2017-08-18	8年(金融领域从业经验22年)	经济学学士,历任荷兰银行上海分行资金部高级交易员,星展银行上海分行资金部经理,比利时富通银行上海分行资金部联席董事,花旗银行(中国)有限公司金融市场部副总监。2009年5月加入上投摩根基金管理有限公司,先后担任固定收益部总监、货币市场投资部总监,2009年9月起任上投摩根货币市场基金基金经理,自2014年8月起同时担任上投摩根现金管理货币市场基金基金经理,自2014年11月起担任上投摩根天添宝货币市场基金基金经理,2014年11月至2017年8月担任上投摩根天添盈货币市场基金基金经理。
鞠婷	本基金基金经理	2016-05-27	-	3年(金融领域从业经验12年)	1997年7月至2001年5月在中国建设银行第一支行担任助理经济师,2006年3月至2014年10月在瑞穗银行总行担任总经理助理,自2014年10月起加入上投摩根基金管理有限公司,担任我公司货币市场投资部基金经理助理一职,自2015年7月起担任上投摩根现金管理货币市场基金基金经理,自2016年5月起同时担任上投摩根天添盈货币市场基金和上投摩根天添宝货币市场基金基金经理。
王之远	本基金基金经理	2017-08-18	-	1年	王之远先生,同济大学产业经济学硕士,2007年4月至2016年6月在交通银行上海分行历任营业网点营销支持、高级资金管理岗,2016年7月起加入上投摩根基金管理有限公司,任基金经理助理。自2017年8月起担任上投摩根天添盈货币市场基金基金经理。

注:1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.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之日。

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、《上投摩根天添盈货币市场基金基金合同》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。

4.3 公平交易专项说明

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况。

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

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,宏观经济展现出了较强的韧性,继续保持平稳运行的态势。从已公布的数据看,工业生产、投资、消费、进出口虽略弱于二季度,但依然较为稳健;得益于供给侧改革,工业企业利润持续改善,继续保持两位数的同比增长;8月CPI、PPI同比分别为1.4%和6.3%,均出现明显上升;官方制造业PMI继续站在荣枯线上方,9月为52.4%,为年初以来最高;外汇储备继续小幅增加,9月超过3.1万亿美元;7月起至9月上旬,人民币兑美元出现一波明显的升值,中间价一度突破6.5。

货币政策方面,央行继续执行稳健中性的货币政策,货币投放上通过"削峰填谷"的操作,平抑资金面的过度波动,维持资金面整体平稳。7、8、9三月到期的中期借贷便利(MLF)都得以及时、足量续作,期限都是1年期。此外,9月30日央行公告将定向降准政策考核范围由现行的小微企业贷款和涉农贷款调整为普惠金融领域贷款,考核标准也有所调整,于2018年首次考核,预计届时可以享受到这一政策红利的银行数量会进一步扩大。监管方面,为进一步规范同业存单业务发展,央行将于2018年1季度将同业存单纳入宏观审慎评估体系(MPA)考核,并取消了1年期以上同业存单发行;为进一步增强公募基金行业的流动性风险管控能力,证监会出台了专项管理规定。

回顾市场,资金面受参与者结构(银行和非银)、税期、跨季等因素影响,仍会出现阶段性紧张,银行间7日回购均价在2.8%-4.2%区间内波动;同业存单发行需求依然旺盛,7、8、9三月分别发行1.5、1.6和2.2万亿,发行价格也逐步上行;季末国债收益率曲线较季初小幅抬升,10年期国债收益率在3.56%-3.66%区间波动。

运作中,本基金结合自身基金持有人结构特点,继续高配短期限的协议存款和逆回购,适度配置利率债和同业存单,并根据本季度1个月和3个月存款和存单期限利差扩大的特点,在保证流动性安全的前提下,适度提高了稍长期限存款和存单的配置。

展望后市,经济大幅滑坡的概率较小,美联储虽然从10月起启动"缩表",但由于这是个渐进过程,预计对人民币汇率的影响有限,因此在内外部环境不出现重大变化的情况下,货币政策将大概率维持稳健中性。本基金将继续把握资产配置节奏、合理配置仓位和久期、严格把控流动性风险、信用风险和久期风险,确保基金平稳运作。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A类、B类和E类的净值增长率分别为0.9044%,0.9652%和0.9423%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	固定收益投资	49,919,091.45	14.27
	其中:债券	49,919,091.45	14.27
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	68,500,000.00	19.59
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	228,277,271.45	65.27
4	其他资产	3,044,542.49	0.87
5	合计	349,740,905.39	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		-
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

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20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	41
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	57
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

根据基金合同约定,本基金投资组合的平均剩余期限不超过120天。在本报告期内本基金未出现投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	51.59	0.12
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	29.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	11.67	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	2.91	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	5.84	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	101.17	0.12

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

在本报告期内本基金未出现投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,018,033.92	8.76
	其中:政策性金融债	30,018,033.92	8.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	19,901,057.53	5.81
8	其他	-	-
9	合计	49,919,091.45	14.57
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150207	15国开07	100,000.00	10,023,536.35	2.92
2	150406	15农发06	100,000.00	10,005,280.21	2.92
3	170203	17国开03	100,000.00	9,989,217.36	2.91
4	111707204	17招商银行CD204	100,000.00	9,953,668.92	2.90
5	111707208	17招商银行CD208	100,000.00	9,947,388.61	2.90

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0046%
报告期内偏离度的最低值	-0.0125%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0029%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期末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0.5%情况说明

本报告期末发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8报告期末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券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法摊销,每日计提收益。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。

5.9.2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。

5.9.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,906,011.60
4	应收申购款	1,138,530.89
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,044,542.49

5.9.4投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,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在尾差。

基金份额持有人如欲了解本基金投资组合的其他相关信息,可致电本基金管理人获取。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	天添盈A类	天添盈B类	天添盈E类
本报告期期初基金份额总额	1,807,211.43	203,669,014.61	122,493,157.70
报告期基金总申购份额	6,371,504.05	1,955,697.30	239,592,692.31
报告期基金总赎回份额	4,085,371.75	14,886.71	229,102,248.85
报告期基金拆分变动份额	-	-	-
报告期期末基金份额总额	4,093,343.73	205,609,825.20	132,983,601.16

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	203,669,014.61	1,940,810.59	0.00	205,609,825.20	60.00%
产品特有风险							
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%,如果投资者发生大额赎回,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本过高导致投资者的利益受到损害的风险。							

注:红利再投资计入申购份额。

7.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1. 中国证监会批准上投摩根天添盈货币市场基金设立的文件;
2.《上投摩根天添盈货币市场基金基金合同》;
3.《上投摩根天添盈货币市场基金基金托管协议》;
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. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2存放地点

基金管理人或基金托管人处。

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。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一七年十月二十六日

上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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。

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。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根天颐年丰混合	
基金主代码	000125	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年7月18日	
报告期末基金份额总额	489,153,225.47份	
投资目标	在有效控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值,力争为投资者提供稳定的现金分红。	
投资策略	1、资产配置策略:本基金管理人将采用严格的仓位控制策略,根据基金单位净值的变化和对未来市场的判断,灵活控制股票仓位,控制下行风险。具体而言,本基金将以每一个会计年度作为仓位控制策略执行的周期,即:以上一年度年末的基金单位净值作为基准,根据基金当前净值与本年度单位累计分红金额之和确定股票仓位上限。 2、债券投资策略:本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下,根据对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪,结合不同债券品种的到期收益率、流动性、市场规模等情况,灵活运用久期策略、期限结构配置策略、信用债策略、可转债策略等多种投资策略,实施积极主动的组合管理,并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测,对债券组合进行动态调整。 3、股票投资策略:本基金将采用自下而上的分析方法,以企业基本面研究为核心,并结合股票价值评估,精选具有较强竞争优势且估值合理的股票构建投资组合。	
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)+1%	
风险收益特征	本基金属于混合型基金产品,预期风险和收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于中等风险收益水平的基金产品。 本基金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。	
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	
下属分级基金的基金简称	上投摩根天颐年丰混合A	上投摩根天颐年丰混合C
下属分级基金的交易代码	000125	002437
报告期末下属分级基金的份额总额	489,153,225.47份	-份

§3 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

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)	
	上投摩根天颐年丰混合A	上投摩根天颐年丰混合C
1.本期已实现收益	5,589,004.99	-
2.本期利润	9,524,302.60	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0192	-
4.期末基金资产净值	502,289,158.27	-
5.期末基金份额净值	1.027	-

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。

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、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

1、上投摩根天颐年丰混合A:

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	1.88%	0.12%	0.64%	0.01%	1.24%	0.11%

2、上投摩根天颐年丰混合C:

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	-	-	-	-	-	-

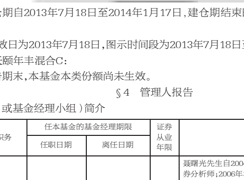
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根天颐年丰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的历史走势对比图

(2013年7月18日至2017年9月30日)

1. 上投摩根天颐年丰混合A:



注:本基金建仓期自2013年7月18日至2014年1月17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2013年7月18日,图示时间段为2013年7月18日至2017年9月30日。

2. 上投摩根天颐年丰混合C:

注:截止本报告期末,本基金本类份额尚未生效。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
聂曙光	本基金基金经理	2015-04-22	-	8年	聂曙光先生自2004年8月至2006年3月在南京银行任债券分析师;2006年3月至2009年9月在兴业银行任债券投资经理;2009年9月至2014年5月在中欧基金管理有限公司先后担任研究员、基金经理助理、基金经理、固定收益部总监、固定收益事业部临时负责人等职务,自2014年5月起加入上投摩根基金管理有限公司,自2014年8月起担任上投摩根纯债债券型证券投资基金基金经理,自2014年10月起担任上投摩根红利回报混合型证券投资基金基金经理,自2014年11月起担任上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金基金经理,自2015年1月起同时担任上投摩根稳进回报混合型证券投资基金基金经理,自2015年4月起同时担任上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金经理,自2016年6月起同时担任上投摩根优信增利债券型证券投资基金基金经理,自2016年8月起同时担任上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金和上投摩根岁岁丰定期开放债券型证券投资基金基金经理,自2017年1月起同时担任上投摩根安瑞回报混合型证券投资基金基金经理,自2017年4月起同时担任上投摩根安通回报混合型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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、《上投摩根天颐年丰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。

4.3 公平交易专项说明

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况。

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

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

三季度经济增长数据有所波动,但无明显趋势变化且存在环保限产等因素的扰动,市场未将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期高点,而信用债收益率仍明显低于前期高点。三季度A股市场整体表现较好,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。三季度我们延续此前思路,精选业绩稳定、估值合理的个股并积极参与新股申购。本基金三季度对债券投资仍持谨慎立场,以短久期品种为主,精选个券信用资质。

展望四季度,虽央行节前预告远期降准,但在经济保持稳健的情况下,并非如传统般释放整体宽松信号,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。当前部分品种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择机关注估值合理、具备较好投资价值的大消费等板块。

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1.88%,同期业绩比较基准收益率为0.64%。

截止本报告期末,本基金C类份额尚未生效

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	70,820,410.04	14.06
	其中:股票	70,820,410.04	14.06
2	固定收益投资	362,831,954.00	72.01
	其中:债券	362,831,954.00	72.01
	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	51,000,000.00	10.12
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	15,142,359.26	3.01
7	其他各项资产	4,049,860.94	0.80
8	合计	503,844,584.24	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,630,113.74	0.52
C	制造业	12,636,558.55	2.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	538,612.00	0.11
E	建筑业	4,355,697.00	0.87
F	批发和零售业	26,385.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,279,680.91	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,220,308.03	0.24
J	金融业	46,071,913.20	9.17
K	房地产业	1,835,292.00	0.37
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.02
R	文化、体育和娱乐业	31,224.45	0.01
S	综合	-	-
	合计	70,820,410.04	14.10

5.3 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股票投资明细

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	601318	中国平安	167,200	9,055,552.00	1.80
2	601166	兴业银行	249,600	4,315,584.00	0.86
3	600036	招商银行	159,300	4,070,115.00	0.81
4	600519	贵州茅台	7,790	4,032,415.60	0.80
5	600016	民生银行	443,800	3,559,276.00	0.71
6	601328	交通银行	546,400	3,453,248.00	0.69
7	600887	伊利股份	93,200	2,563,000.00	0.51
8	601288	农业银行	588,900	2,249,598.00	0.45
9	600030	中信证券	121,200	2,204,628.00	0.44
10	601668	中国建筑	232,100	2,153,888.00	0.43

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	25,956,000.00	5.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,994,000.00	0.60
	其中:政策性金融债	2,994,000.00	0.60
4	企业债券	43,220,786.20	8.60
5	企业短期融资券	150,434,000.00	29.95
6	中期票据	19,541,000.00	3.89
7	可转债(可交换债)	8,925,467.80	1.78
8	同业存单	111,760,700.00	22.25
9	其他	-	-
10	合计	362,831,954.00	72.24

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细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111782322	17宁波银行CD149	630,000	62,300,700.00	12.40
2	111710500	17兴业银行CD500	500,000	49,460,000.00	9.85
3	011769013	17重汽SCP002	200,000	20,092,000.00	4.00
4	011751047	17珠海华发SCP003	200,000	20,082,000.00	4.00
5	011754101	17康美SCP002	200,000	20,062,000.00	3.99

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明细

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国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的中信证券股份有限公司(以下称"中信证券",股票代码600030)于2017年5月25日公告称,中信证券收到中国证监会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2017]57号),主要内容如下:

中信证券违反了《证券公司融资融券业务管理办法》(证监会公告[2011]31号)第十一条"对未按照要求提供有关情况、在本公司及与本公司具有控制关系的其他证券公司从事证券交易的时间连续计算不足半年、证券公司不得向其融资、融券"的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(七)项"未按照规定与客户签订业务合同"所述行为。

依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第(七)项的规定,中国证监会拟决定:

一、责令中信证券改正,给予警告,没收违法所得人民币61,655,849.78元,并处以人民币308,279,248.90元罚款;

二、对相关责任人给予警告,并分别处以人民币10万元罚款。

对上述股票投资决策程序的说明:本基金管理人在投资中信证券前严格执行了内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库,由研究员跟踪并分析。上述事件发生后,本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

除上述股票外,本基金投资的其余前九名证券的发行主体本期未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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,629.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,034,126.91
5	应收申购款	9,104.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,049,860.94

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	2,228,400.00	0.44
2	132004	15国盛EB	924,500.00	0.18
3	120001	16以岭EB	776,384.40	0.15
4	128010	顺昌转债	587,871.90	0.12
5	123001	蓝标转债	491,070.80	0.10
6	132005	15国资EB	364,500.00	0.07
7	110033	国贸转债	245,020.00	0.05
8	132003	15清控EB	204,800.00	0.04
9	128013	洪涛转债	177,082.50	0.04
10	110032	三一转债	118,060.00	0.02

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

因四舍五入原因,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

项目	上投摩根天颐年丰混合A	上投摩根天颐年丰混合C
本报告期期初基金份额总额	542,992,757.55	-
报告期基金总申购份额	3,622,288.89	-
减:报告期基金总赎回份额	57,461,820.97	-
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	489,153,225.47	-

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	396,870,903.67	0.00	50,000,000.00	346,870,903.67	70.84%
机构	2	20170711-20170930	100,195,336.86	986,174.58	0.00	101,181,511.44	20.66%
产品特有风险							
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%,如果投资者发生大额赎回,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本过高导致投资者的利益受到损害的风险。							

注:红利再投资计入申购份额。

7.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录

1 中国证监会批准上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金设立的文件;
2《上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金合同》;
3《上投摩根天颐年丰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、营业执照;
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处。

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。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一七年十月二十六日