

上投摩根安全战略股票型证券投资基金

2017年第三季度报告

截至本报告期末，本基金三季度重仓配置了景气度高、业绩较好的新能源汽车、电子和食品饮料板块，取得了不错业绩。

展望未来，虽然短期监管限定降准降准预期较强，但我们认为，未来流动性环境中偏紧状态的持续概率较低。我们经整体资产配置保持平稳运行，但较去年同期高基数影响，未来业绩可能保持较高水准的确定性较强。而进一步宽松的货币政策，将对我们资产配置和投资业绩带来积极影响。在这样的背景下，本基金看好估值合理、景气度较高的消费行业（如零售、食品饮料等板块）、电子和新能源汽车等板块。未来本基金将继续寻找景气度高、盈利能力强、同时估值合理的投资标的，力争实现基金投资目标。

4.4报告期内基金的业绩表现
本报告期末本基金份额净增长率为7.23%，同期业绩比较基准收益率为4.57%。
4.5报告期内本基金持有人数或基金份额净值变动情况说明
无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	856,404,133.71	81.88
2	其中:股票	856,404,133.71	81.88
3	固定收益投资	866,976.70	0.08
4	其中:债券	866,976.70	0.08
5	货币支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和拆借资产合计	89,444,321.76	8.62
10	其他资产	100,570,333.82	9.64
11	合计	1,048,364,765.09	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)	占基金资产净值的比例(%)
A	农林、牧、渔业	25,796,240.00	2.48
B	采矿业	6,262,993.60	0.60
C	制造业	682,210,727.82	65.56
D	电力、热力、燃气及生产供应业	6,387,402.44	0.61
E	建筑业	7,915,967.02	0.76
F	批发和零售业	27,568,260.02	2.64
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,967,164.91	2.21
J	金融业	76,78,819.19	7.37
K	房地产业	-	-
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	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	12,776.05	0.00
S	综合	866,404,133.71	82.29

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)	占基金资产净值的比例(%)
1	002680	魏桥能源	497,488	60,890,702.40	5.85
2	300115	长安汽车	1,689,262	58,396,478.74	5.61
3	002466	天齐锂业	673,688	47,366,187.22	4.54
4	300040	先声药业	576,719	43,172,437.40	4.15
5	002686	华泰证券	1,983,428	39,969,839.32	3.83
6	002799	华友钴业	393,400	35,984,288.00	3.46
7	100569	华研新创	1,953,539	35,707,362.19	3.43
8	000897	伊府股份	1,082,800	29,229,760.00	2.81
9	300145	中集车辆	1,669,526	27,892,456.00	2.70
10	002008	大族激光	629,968	27,462,244.00	2.64

5.4 报告期内基金投资组合的重大变动

注:1.在报告期内和前一报告期内本基金决定确定的聘任日期和聘期。2.本基金建仓期自2015年2月26日至2015年8月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

4.1 基金投资策略或基金经理小组简介

4.2 基金经理

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4 报告期内本基金投资运作情况

4.5 公平交易专项说明

4.6 异常交易行为的专项说明

4.7 关联交易事项的专项说明

4.8 报告期内基金投资组合的重大变动

4.9 报告期内基金投资组合的重大变动

4.10 报告期内基金投资组合的重大变动

4.11 报告期内基金投资组合的重大变动

4.12 异常交易行为的专项说明

4.13 公平交易专项说明

4.14 异常交易行为的专项说明

4.15 关联交易事项的专项说明

4.16 报告期内基金投资组合的重大变动

4.17 报告期内基金投资组合的重大变动

4.18 报告期内基金投资组合的重大变动

4.19 报告期内基金投资组合的重大变动

4.20 报告期内基金投资组合的重大变动

4.21 报告期内基金投资组合的重大变动

4.22 异常交易行为的专项说明

4.23 公平交易专项说明

4.24 异常交易行为的专项说明

4.25 关联交易事项的专项说明

4.26 报告期内基金投资组合的重大变动

4.27 报告期内基金投资组合的重大变动

4.28 报告期内基金投资组合的重大变动

4.29 报告期内基金投资组合的重大变动

4.30 报告期内基金投资组合的重大变动

4.31 报告期内基金投资组合的重大变动

4.32 异常交易行为的专项说明

4.33 公平交易专项说明

4.34 异常交易行为的专项说明

4.35 关联交易事项的专项说明

4.36 报告期内基金投资组合的重大变动

4.37 报告期内基金投资组合的重大变动

4.38 报告期内基金投资组合的重大变动

4.39 报告期内基金投资组合的重大变动

4.40 报告期内基金投资组合的重大变动

4.41 报告期内基金投资组合的重大变动

4.42 异常交易行为的专项说明

4.43 公平交易专项说明

4.44 异常交易行为的专项说明

4.45 关联交易事项的专项说明

4.46 报告期内基金投资组合的重大变动

4.47 报告期内基金投资组合的重大变动

4.48 报告期内基金投资组合的重大变动

4.49 报告期内基金投资组合的重大变动

4.50 报告期内基金投资组合的重大变动

4.51 报告期内基金投资组合的重大变动

4.52 异常交易行为的专项说明

4.53 公平交易专项说明

4.54 异常交易行为的专项说明

4.55 关联交易事项的专项说明

4.56 报告期内基金投资组合的重大变动

4.57 报告期内基金投资组合的重大变动

4.58 报告期内基金投资组合的重大变动

4.59 报告期内基金投资组合的重大变动

4.60 报告期内基金投资组合的重大变动

4.61 报告期内基金投资组合的重大变动

4.62 异常交易行为的专项说明

4.63 公平交易专项说明

4.64 异常交易行为的专项说明

4.65 关联交易事项的专项说明

4.66 报告期内基金投资组合的重大变动

4.67 报告期内基金投资组合的重大变动

4.68 报告期内基金投资组合的重大变动

4.69 报告期内基金投资组合的重大变动

4.70 报告期内基金投资组合的重大变动

4.71 报告期内基金投资组合的重大变动

4.72 异常交易行为的专项说明

4.73 公平交易专项说明

4.74 异常交易行为的专项说明

4.75 关联交易事项的专项说明

4.76 报告期内基金投资组合的重大变动

4.77 报告期内基金投资组合的重大变动

4.78 报告期内基金投资组合的重大变动

4.79 报告期内基金投资组合的重大变动

4.80 报告期内基金投资组合的重大变动

4.81 报告期内基金投资组合的重大变动

4.82 异常交易行为的专项说明

4.83 公平交易专项说明

4.84 异常交易行为的专项说明

4.85 关联交易事项的专项说明

4.86 报告期内基金投资组合的重大变动

4.87 报告期内基金投资组合的重大变动

4.88 报告期内基金投资组合的重大变动

4.89 报告期内基金投资组合的重大变动

4.90 报告期内基金投资组合的重大变动

4.91 报告期内基金投资组合的重大变动

4.92 异常交易行为的专项说明

4.93 公平交易专项说明

4.94 异常交易行为的专项说明

4.95 关联交易事项的专项说明

4.96 报告期内基金投资组合的重大变动

4.97 报告期内基金投资组合的重大变动

4.98 报告期内基金投资组合的重大变动

4.99 报告期内基金投资组合的重大变动

4.100 报告期内基金投资组合的重大变动

4.101 报告期内基金投资组合的重大变动

4.102 异常交易行为的专项说明

4.103 公平交易专项说明

4.104 异常交易行为的专项说明

4.105 关联交易事项的专项说明

4.106 报告期内基金投资组合的重大变动

4.107 报告期内基金投资组合的重大变动

4.108 报告期内基金投资组合的重大变动

4.109 报告期内基金投资组合的重大变动

4.110 报告期内基金投资组合的重大变动

4.111 报告期内基金投资组合的重大变动

4.112 异常交易行为的专项说明

4.113 公平交易专项说明

4.114 异常交易行为的专项说明

4.115 关联交易事项的专项说明

4.116 报告期内基金投资组合的重大变动

4.117 报告期内基金投资组合的重大变动

4.118 报告期内基金投资组合的重大变动

4.119 报告期内基金投资组合的重大变动

4.120 报告期内基金投资组合的重大变动

4.121 报告期内基金投资组合的重大变动

4.122 异常交易行为的专项说明

4.123 公平交易专项说明

4.124 异常交易行为的专项说明

4.125 关联交易事项的专项说明

4.126 报告期内基金投资组合的重大变动

4.127 报告期内基金投资组合的重大变动

4.128 报告期内基金投资组合的重大变动

4.129 报告期内基金投资组合的重大变动

4.130 报告期内基金投资组合的重大变动

4.131 报告期内基金投资组合的重大变动

4.132 异常交易行为的专项说明

4.133 公平交易专项说明

4.134 异常交易行为的专项说明

4.135 关联交易事项的专项说明

4.136 报告期内基金投资组合的重大变动

4.137 报告期内基金投资组合的重大变动

4.138 报告期内基金投资组合的重大变动

4.139 报告期内基金投资组合的重大变动

4.140 报告期内基金投资组合的重大变动

4.141 报告期内基金投资组合的重大变动

4.142 异常交易行为的专项说明

4.143 公平交易专项说明

4.144 异常交易行为的专项说明

4.145 关联交易事项的专项说明

4.146 报告期内基金投资组合的重大变动

4.147 报告期内基金投资组合的重大变动

4.148 报告期内基金投资组合的重大变动

4.149 报告期内基金投资组合的重大变动

4.150 报告期内基金投资组合的重大变动

4.151 报告期内基金投资组合的重大变动

4.152 异常交易行为的专项说明

4.153 公平交易专项说明

4.154 异常交易行为的专项说明

4.155 关联交易事项的专项说明

4.156 报告期内基金投资组合的重大变动

4.157 报告期内基金投资组合的重大变动

4.158 报告期内基金投资组合的重大变动

4.159 报告期内基金投资组合的重大变动

4.160 报告期内基金投资组合的重大变动

4.161 报告期内基金投资组合的重大变动

4.162 异常交易行为的专项说明

4.163 公平交易专项说明

4.164 异常交易行为的专项说明

4.165 关联交易事项的专项说明

4.166 报告期内基金投资组合的重大变动

4.167 报告期内基金投资组合的重大变动

4.168 报告期内基金投资组合的重大变动

4.169 报告期内基金投资组合的重大变动

4.170 报告期内基金投资组合的重大变动

4.171 报告期内基金投资组合的重大变动

4.172 异常交易行为的专项说明

4.173 公平交易专项说明

4.174 异常交易行为的专项说明

4.175 关联交易事项的专项说明

4.176 报告期内基金投资组合的重大变动

4.177 报告期内基金投资组合的重大变动

4.178 报告期内基金投资组合的重大变动

4.179 报告期内基金投资组合的重大变动

4.180 报告期内基金投资组合的重大变动

4.181 报告期内基金投资组合的重大变动

4.182 异常交易行为的专项说明

4.183 公平交易专项说明

4.184 异常交易行为的专项说明

4.185 关联交易事项的专项说明

4.186 报告期内基金投资组合的重大变动

4.187 报告期内基金投资组合的重大变动

4.188 报告期内基金投资组合的重大变动

4.189 报告期内基金投资组合的重大变动

4.190 报告期内基金投资组合的重大变动