

2018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:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

基金持有人的董事、监事、高级管理人员及基金经理等人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性承担个别及连带责任。

基金持有人承诺,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。

本报告期未对基金财务资料未审计。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

上投摩根香港精选港股通混合型证券投资基金

基金代码:005701

交易代码:005701

基金合同生效日:2018年6月8日

报告期末基金资产总额:205,070,328.35元

投资目标

本基金采用定量及定性研究方法,充分考虑在港股通范围内的上市公司,通过严格的风险控制,力求实现基金资产的长期增值。

资产配置策略:本基金将综合考虑港股的基本面、政策面、市场面等多方面因素,通过定量和定性分析,确定港股的配置比例,并根据宏观经济形势和行业景气度,适时调整资产配置比例,力争在控制风险的前提下,实现基金资产的长期增值。

投资策略

本基金将综合考虑港股的基本面、政策面、市场面等多方面因素,通过定量和定性分析,确定港股的配置比例,并根据宏观经济形势和行业景气度,适时调整资产配置比例,力争在控制风险的前提下,实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准

中证港股通综合指数收益率\*70%+恒生指数收益率\*30%

风险收益特征

本基金为股票型基金,属于股票型基金中较高风险品种。本基金的风险收益特征与股票型基金的风险收益特征相似,但本基金的风险收益特征会定期根据合同约定进行调整,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

中国工商银行股份有限公司

§ 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

报告期:2018年7月1日-2018年9月30日

1.本期已实现收益 -5,420,232.00

2.本期利润 -6,294,256.89

3.加权平均基金份额净值 0.0289

4.期末基金资产净值 196,346,062.97

5.期末基金份额净值 0.9622

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)和公允价值变动收益的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金业绩评价不包括持有人认购或交易基金的交易费用(例如,开放式基金的申购费用、赎回费用、基金转换费用等),计划费用的实时收益水平将低于所列数字。

3.2.2 本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

上投摩根香港精选港股通混合型证券投资基金

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(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

张淑梅 女士,台大硕士,金融MBA,自1987年5月至今

1998年1月起至2000年1月任上投摩根基金管理有限公司投资经理,2000年1月起至2002年1月任上投摩根基金管理有限公司投资经理,2002年1月起至2004年1月任上投摩根基金管理有限公司投资经理,2004年1月起至2006年1月任上投摩根基金管理有限公司投资经理,2006年1月起至2008年1月任上投摩根基金管理有限公司投资经理,2008年1月起至2010年1月任上投摩根基金管理有限公司投资经理,2010年1月起至2012年1月任上投摩根基金管理有限公司投资经理,2012年1月起至2014年1月任上投摩根基金管理有限公司投资经理,2014年1月起至2016年1月任上投摩根基金管理有限公司投资经理,2016年1月起至2018年6月任上投摩根基金管理有限公司投资经理,2018年6月起至2019年1月任上投摩根基金管理有限公司投资经理。

注:张淑梅女士为本基金基金经理,其任职日期以基金合同生效日为准。

2.张淑梅女士为本基金基金经理,其任职日期以基金合同生效日为准。

3.基金经理从本报告期内基金运作情况说明

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、《上投摩根香港精选港股通混合型证券投资基金基金合同》的规定,基金管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,基金经理按合同约定履行了对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 平均交易量的执行情况

本基金在建仓期自2018年7月1日至2018年9月30日,未出现不公平交易行为。

4.3.2 交易时机选择的执行情况

本基金在建仓期自2018年7月1日至2018年9月30日,未出现不公平交易行为。

4.3.3 差异化待遇的执行情况

本基金在建仓期自2018年7月1日至2018年9月30日,未出现不公平交易行为。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

本基金在建仓期自2018年7月1日至2018年9月30日,未出现不公平交易行为。

4.3.5 交易价格的执行情况

本基金在建仓期自2018年7月1日至2018年9月30日,未出现不公平交易行为。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

本基金在建仓期自2018年7月1日至2018年9月30日,未出现不公平交易行为。

4.3.7 交易异常行为的专项说明

本基金在建仓期自2018年7月1日至2018年9月30日,未发现可能导致不公平交易行为。

4.3.8 其他异常交易行为的专项说明

本基金在建仓期自2018年7月1日至2018年9月30日,未发现可能导致不公平交易行为。

4.4 报告期内基金的经营情况说明

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.5 报告期内基金的估值政策

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.6 报告期内基金的收益分配情况

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.7 报告期内基金的费用情况

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.8 报告期内基金的税收情况

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.9 报告期内基金的关联交易

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.10 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.11 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.12 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.13 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.14 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.15 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.16 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.17 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.18 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.19 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.20 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.21 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.22 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.23 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.24 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.25 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.26 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.27 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.28 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.29 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.30 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.31 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.32 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.33 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.34 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.35 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.36 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.37 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.38 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.39 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.40 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.41 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.42 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.43 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.44 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.45 报告期内基金的其他重大事项

报告期内,本基金未发生重大影响基金业绩的事件。

4.46 报告期内基金的其他重大事项