

上投摩根中小盘混合型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6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:二〇一九年七月十六日

基金管理人及基金托管人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2019年7月15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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告日期为2019年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

基金名称:上投摩根中小盘混合型证券投资基金
基金代码:170610
基金简称:170610
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元
主要财务指标
(2019年4月1日至2019年6月30日)

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)

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,本期利润为本期实现收益减去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据。

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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, 1-3, 2-6

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

上投摩根中小盘混合型证券投资基金成立以来基金份额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(2009年1月21日至2019年6月30日)



注:本基金合同生效日为2009年1月21日,图示时间为2009年1月21日至2019年6月30日。
本基金建仓期自2009年1月21日至2009年7月20日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同约定。

4.1 基金经理或基金经理小组简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职本基金的基金经理日期, 证券从业年限

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。

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,基金管理人未发生《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根中小盘混合型证券投资基金基金合同》的规定,基金经理对个股的投资组合比例调整符合投资决策委员会的授权限制,基金投资组合符合基金合同和法律法规的要求。

4.1.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金严格执行《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制度的各项规定,严格执行内上投摩根公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行,严格执行内上投摩根公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行。

对于交易所市场交易活动,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、比例分配的原则进行公平分配。

对于场外市场交易活动,本公司通过对于申购赎回交易,本公司通过对于申购赎回交易,本公司通过对于申购赎回交易,本公司通过对于申购赎回交易。

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%的情况。

4.1.2 异常交易的专项说明

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。

4.1.3 交易所市场交易活动

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。

4.1.4 场外市场交易活动

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。

4.2 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

4.3 其他重要事项

4.3.1 中国证监文件目录
4.3.2 基金管理人持有本基金份额变动情况

4.3.3 其他重要事项

4.3.4 其他重要事项

4.3.5 其他重要事项

4.3.6 其他重要事项

4.3.7 其他重要事项

4.3.8 其他重要事项

4.3.9 其他重要事项

4.3.10 其他重要事项

4.3.11 其他重要事项

4.3.12 其他重要事项

4.3.13 其他重要事项

4.3.14 其他重要事项

4.3.15 其他重要事项

4.3.16 其他重要事项

4.3.17 其他重要事项

4.3.18 其他重要事项

4.3.19 其他重要事项

4.3.20 其他重要事项

4.3.21 其他重要事项

4.3.22 其他重要事项

4.3.23 其他重要事项

4.3.24 其他重要事项

4.3.25 其他重要事项

4.3.26 其他重要事项

4.3.27 其他重要事项

4.3.28 其他重要事项

4.3.29 其他重要事项

4.3.30 其他重要事项

4.3.31 其他重要事项

4.3.32 其他重要事项

4.3.33 其他重要事项

4.3.34 其他重要事项

4.3.35 其他重要事项

4.3.36 其他重要事项

4.3.37 其他重要事项

4.3.38 其他重要事项

4.3.39 其他重要事项

4.3.40 其他重要事项

上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6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:二〇一九年七月十六日

基金管理人及基金托管人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2019年7月15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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告日期为2019年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

基金名称:上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金
基金代码:001192
基金简称:001192
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元
主要财务指标
(2019年4月1日至2019年6月30日)

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)

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,本期利润为本期实现收益减去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据。

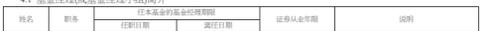
3.2 基金净值表现

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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, 1-3, 2-6

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

上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金成立以来基金份额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(2015年4月23日至2019年6月30日)



注:本基金合同生效日为2015年4月23日,图示时间为2015年4月23日至2019年6月30日。
本基金建仓期自2015年4月23日至2015年10月22日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同约定。

4.1 基金经理或基金经理小组简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职本基金的基金经理日期, 证券从业年限

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。

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,基金管理人未发生《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,基金经理对个股的投资组合比例调整符合投资决策委员会的授权限制,基金投资组合符合基金合同和法律法规的要求。

4.1.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金严格执行《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制度的各项规定,严格执行内上投摩根公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行,严格执行内上投摩根公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行。

对于交易所市场交易活动,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、比例分配的原则进行公平分配。

对于场外市场交易活动,本公司通过对于申购赎回交易,本公司通过对于申购赎回交易,本公司通过对于申购赎回交易,本公司通过对于申购赎回交易。

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%的情况。

4.1.2 异常交易的专项说明

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。

4.1.3 交易所市场交易活动

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。

4.1.4 场外市场交易活动

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。

4.2 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

4.3 其他重要事项

4.3.1 中国证监文件目录
4.3.2 基金管理人持有本基金份额变动情况

4.3.3 其他重要事项

4.3.4 其他重要事项

4.3.5 其他重要事项

4.3.6 其他重要事项

4.3.7 其他重要事项

4.3.8 其他重要事项

4.3.9 其他重要事项

4.3.10 其他重要事项

4.3.11 其他重要事项

4.3.12 其他重要事项

4.3.13 其他重要事项

4.3.14 其他重要事项

4.3.15 其他重要事项

4.3.16 其他重要事项

4.3.17 其他重要事项

4.3.18 其他重要事项

4.3.19 其他重要事项

4.3.20 其他重要事项

4.3.21 其他重要事项

4.3.22 其他重要事项

4.3.23 其他重要事项

4.3.24 其他重要事项

4.3.25 其他重要事项

4.3.26 其他重要事项

4.3.27 其他重要事项

4.3.28 其他重要事项

4.3.29 其他重要事项

4.3.30 其他重要事项

4.3.31 其他重要事项

4.3.32 其他重要事项

4.3.33 其他重要事项

4.3.34 其他重要事项

4.3.35 其他重要事项

4.3.36 其他重要事项

4.3.37 其他重要事项

4.3.38 其他重要事项

4.3.39 其他重要事项

4.3.40 其他重要事项

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:二〇一九年七月十六日

基金管理人及基金托管人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2019年7月15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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告日期为2019年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

基金名称:上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金(QDII)
基金代码:001192
基金简称:001192
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元
主要财务指标
(2019年4月1日至2019年6月30日)

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)

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,本期利润为本期实现收益减去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据。

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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, 1-3, 2-6

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

上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金(QDII)成立以来基金份额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(2018年10月31日至2019年6月30日)



注:本基金合同生效日为2018年10月31日,图示时间为2018年10月31日至2019年6月30日。
本基金建仓期自2018年10月31日至2019年4月29日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同约定。

4.1 基金经理或基金经理小组简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职本基金的基金经理日期, 证券从业年限

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。

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,基金管理人未发生《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金(QDII)基金合同》的规定,基金经理对个股的投资组合比例调整符合投资决策委员会的授权限制,基金投资组合符合基金合同和法律法规的要求。

4.1.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金严格执行《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制度的各项规定,严格执行内上投摩根公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行,严格执行内上投摩根公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行。

对于交易所市场交易活动,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、比例分配的原则进行公平分配。

对于场外市场交易活动,本公司通过对于申购赎回交易,本公司通过对于申购赎回交易,本公司通过对于申购赎回交易,本公司通过对于申购赎回交易。

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%的情况。

4.1.2 异常交易的专项说明

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。

4.1.3 交易所市场交易活动

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。

4.1.4 场外市场交易活动

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。

4.2 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

4.3 其他重要事项

4.3.1 中国证监文件目录
4.3.2 基金管理人持有本基金份额变动情况

4.3.3 其他重要事项

4.3.4 其他重要事项

4.3.5 其他重要事项

4.3.6 其他重要事项

4.3.7 其他重要事项

4.3.8 其他重要事项

4.3.9 其他重要事项

4.3.10 其他重要事项

4.3.11 其他重要事项

4.3.12 其他重要事项

4.3.13 其他重要事项

4.3.14 其他重要事项

4.3.15 其他重要事项

4.3.16 其他重要事项

4.3.17 其他重要事项

4.3.18 其他重要事项

4.3.19 其他重要事项

4.3.20 其他重要事项

4.3.21 其他重要事项

4.3.22 其他重要事项

4.3.23 其他重要事项

4.3.24 其他重要事项

4.3.25 其他重要事项

4.3.26 其他重要事项

4.3.27 其他重要事项

4.3.28 其他重要事项

4.3.29 其他重要事项

4.3.30 其他重要事项

4.3.31 其他重要事项

4.3.32 其他重要事项

4.3.33 其他重要事项

4.3.34 其他重要事项

4.3.35 其他重要事项

4.3.36 其他重要事项

4.3.37 其他重要事项

4.3.38 其他重要事项

4.3.39 其他重要事项

4.3.40 其他重要事项