

**上投摩根中小盘混合型证券投资基金**  
**2017 年半年度报告摘要**  
**2017 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：二〇一七年八月二十八日

## 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金简称       | 上投摩根中小盘混合        |
| 基金主代码      | 379010           |
| 交易代码       | 379010           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2009 年 1 月 21 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     |
| 报告期末基金份额总额 | 220,326,061.38 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金重点投资于中国 A 股市场上的中小盘股票，通过缜密的资产配置原则和严格的行业个股选择，分享中国经济高速增长给优势中小市值上市公司带来的机遇，并积极运用战略和战术资产配置策略，动态优化投资组合，力求实现基金资产长期稳健增值。                         |
| 投资策略   | 本基金充分借鉴摩根资产管理集团全球行之有效的投资理念和技术，运用“自下而上”精选个股与“自上而下”资产配置相结合的投资策略，重点投资于具有行业优势、公司优势和估值优势的中小市值上市公司股票。同时结合市场研判，对相关资产类别的预期收益进行监控，动态调整股票、债券等大类资产配置。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为： $40\% \times$ 天相中盘指数收益率 $+40\% \times$ 天相小盘指数收益率 $+20\% \times$ 上证国债指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。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。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人             | 基金托管人                |
|-------------|------|-------------------|----------------------|
| 名称          |      | 上投摩根基金管理有限公司      | 中国建设银行股份有限公司         |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 胡迪                | 田青                   |
|             | 联系电话 | 021-38794888      | 010-67595096         |
|             | 电子邮箱 | services@cifm.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话      |      | 400-889-4888      | 010-67595096         |
| 传真          |      | 021-20628400      | 010-66275853         |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                     |
|----------------------|---------------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.cifm.com |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人的办公场所    |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2017年1月1日至2017年6月30日） |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | -24,290,119.76            |
| 本期利润          | 39,418,483.93             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1755                    |
| 本期基金份额净值增长率   | 9.87%                     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日)          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.8805                    |
| 期末基金资产净值      | 431,572,779.60            |
| 期末基金份额净值      | 1.959                     |

注：1. 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。对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

2. 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

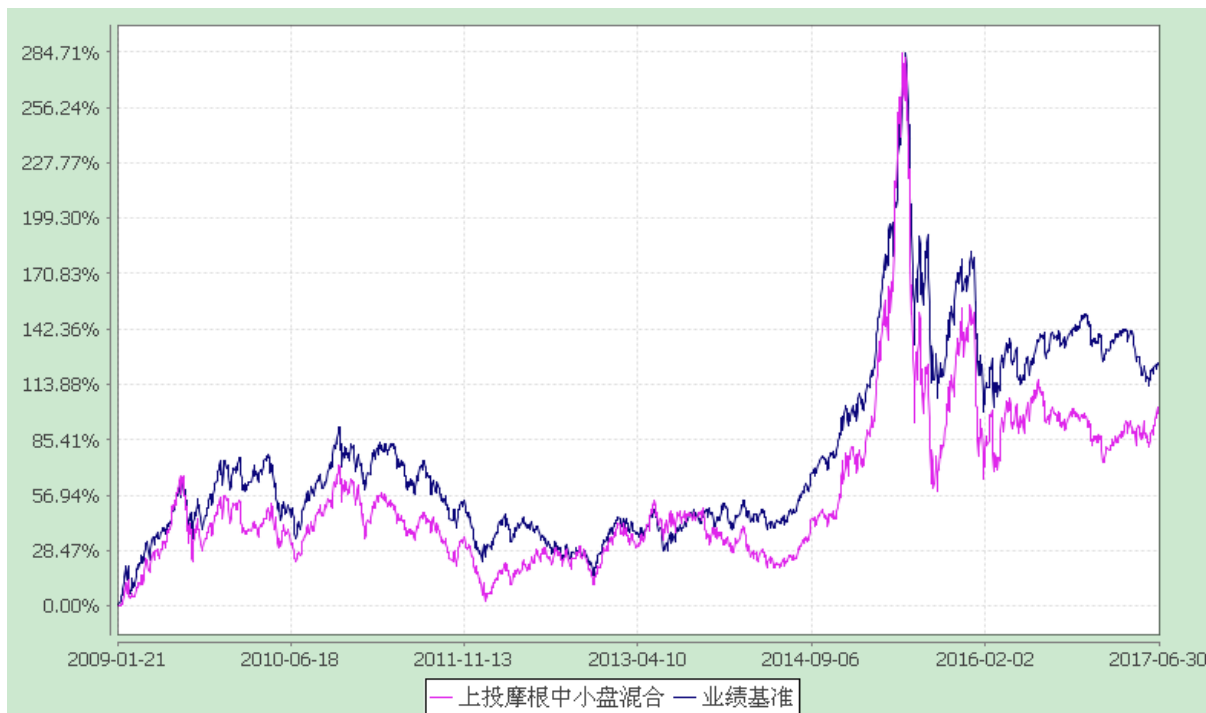
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月      | 9.69%    | 1.04%       | 3.49%      | 0.66%         | 6.20%   | 0.38% |
| 过去三个月      | 6.06%    | 1.25%       | -2.84%     | 0.70%         | 8.90%   | 0.55% |
| 过去六个月      | 9.87%    | 1.11%       | -1.35%     | 0.64%         | 11.22%  | 0.47% |
| 过去一年       | -3.02%   | 1.08%       | 1.00%      | 0.68%         | -4.02%  | 0.40% |
| 过去三年       | 60.71%   | 2.30%       | 52.13%     | 1.54%         | 8.58%   | 0.76% |
| 自基金合同生效起至今 | 101.80%  | 1.81%       | 124.99%    | 1.37%         | -23.19% | 0.44% |

注：本基金的业绩比较基准为： $40\% \times$ 天相中盘指数收益率 $+40\% \times$ 天相小盘指数收益率 $+20\% \times$ 上证国债指数收益率。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2009 年 1 月 21 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为 2009 年 1 月 21 日，图示时间段为 2009 年 1 月 21 日至 2017 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规定。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007 年 10 月 8 日更名为“上海国际信托有限公司”）与摩根资产管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。截至 2017 年 6 月底，公司管理的基金共有五十七只，均为开放式基金，分别是：上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货

币市场基金、上投摩根阿尔法混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋混合型证券投资基金、上投摩根内需动力混合型证券投资基金、上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘混合型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金、上投摩根分红添利债券型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选混合型证券投资基金、上投摩根轮动添利债券型证券投资基金、上投摩根智选30混合型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金、上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金、上投摩根红利回报混合型证券投资基金、上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根优信增利债券型证券投资基金、上投摩根现金管理货币市场基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添盈货币市场基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根纯债添利债券型证券投资基金、上投摩根稳进回报混合型证券投资基金、上投摩根安全战略股票型证券投资基金、上投摩根卓越制造股票型证券投资基金、上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置证券投资基金、上投摩根智慧互联股票型证券投资基金、上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根新兴服务股票型证券投资基金、上投摩根医疗健康股票型证券投资基金、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根策略精选灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金、上投摩根岁岁丰定期开放债券型证券投资基金、上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、上投摩根全球多元配置证券投资基金(QDII)、上投摩根安丰回报混合型证券投资基金、上投摩根安泽回报混合型证券投资基金、上投摩根安瑞回报混合型证券投资基金、上投摩根岁岁金定期开放债券型证券投资基金、上投摩根安通回报混合型证券投资基金。

**4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介**

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理<br>(助理) 期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明  |
|----|---------|----------------------|------|------------|---|
|    |         | 任职日期                 | 离任日期 |            |   |
| 郭晨 | 本基金基金经理 | 2015-01-30           | -    | 10 年       | 郭晨先生，自 2007 年 5 月至 2008 年 4 月在平安资产管理有限公司担任分析师；2008 年 4 月至 2009 年 11 月在东吴基金管理有 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | 限公司担任研究员；2009 年 11 月至 2014 年 10 月在华富基金管理有限公司先后担任基金经理助理、基金经理，自 2014 年 10 月起加入上投摩根基金管理有限公司，自 2015 年 1 月起担任上投摩根中小盘混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 6 月起同时担任上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金经理，自 2015 年 8 月起同时担任上投摩根新兴服务股票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合规守信情况的说明

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。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根中小盘混合型证券投资基金基金合同》的规定。除以下情况外，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：本基金曾出现个别由于市场原因引起的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形，但已在规定时间内调整完毕。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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、交易方向等的抽样分析，未发现存在异常交易行为。

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：报告期内，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% 的次数为两次，均发生在量化投资组合与主动管理投资组合之间。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年的市场一直处于窄幅震荡之中，成交量低迷，活跃度不高，存量资金博弈，市场的风险偏好很低，绩优白马股保持强势，漂亮 50 是市场的热点，资金不断追逐绝对估值低，增长确定的个股和行业，市场热点集中在家电、白酒、消费电子等行业。一季度市场曾对经济复苏抱有较高的预期，配合上游原材料的涨价，周期股有过阶段性的表现。上半年 IPO 的速度很快，对中小市值股票估值产生一定压力。上半年国内和美国宏观经济表现都不错，人民币表现稳健，季末的流动性较宽松，债券市场和股票市场都没有受到流动性的冲击。房地产调控继续严格执行，房地产后周期行业和基建相关的行业景气度继续保持，家电、白酒、工程机械、化工等行业持续受益。

上半年的市场二八分化严重，机会主要集中在少数绩优白马股，本基金加大了消费电子、新能源汽车板块的配置，降低换手率，适应弱势市场环境，坚定持有绩优股，取得了良好的效果。

##### 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 9.87%，同期业绩比较基准收益率为-1.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，本基金预计市场将保持震荡格局，货币政策继续稳健，市场利率保持平稳，市场出现大机会的可能性较小。受宏观调控影响，房地产投资大概率走弱，经济保持平稳，可能比上半年略弱，通胀维持较低水平，流动性可能比上半年略好，一些细分板块依然会有亮点。本基金认为下半年基本面比较确定的两个板块是新能源汽车和消费电子产业链，新能源汽车受之前补贴政策影



响，上半年销量不佳，随着国内补贴政策逐渐落地，特斯拉新车型的量产，产业链景气度将逐步提升，有超市场预期可能。消费电子行业受苹果和国内品牌手机三四季度新品发布以及订单爆发的影响，下半年也将受益。我们将继续精选行业和个股，合理的估值，业绩增速，成长的确定性是本基金所看重的。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员，参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：上投摩根中小盘混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            | -                              | -                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 44,937,019.71                  | 46,130,953.59                    |
| 结算备付金           |            | 782,832.48                     | 2,834,775.02                     |
| 存出保证金           |            | 177,557.69                     | 260,509.92                       |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 390,561,655.35                 | 364,640,697.87                   |
| 其中：股票投资         |            | 390,561,655.35                 | 364,640,697.87                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 180,454.48                     | 2,910,559.24                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 9,956.79                       | 9,374.95                         |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 61,796.00                      | 63,890.59                        |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>436,711,272.50</b>          | <b>416,850,761.18</b>            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            | -                              | -                                |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |

|                   |          |                       |                       |
|-------------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 卖出回购金融资产款         |          | -                     | -                     |
| 应付证券清算款           |          | 3,441,547.88          | 9,748,032.99          |
| 应付赎回款             |          | 457,930.71            | 274,274.36            |
| 应付管理人报酬           |          | 508,400.97            | 526,971.79            |
| 应付托管费             |          | 84,733.50             | 87,828.63             |
| 应付销售服务费           |          | -                     | -                     |
| 应付交易费用            | 6.4.7.7  | 535,878.25            | 1,162,026.86          |
| 应交税费              |          | -                     | -                     |
| 应付利息              |          | -                     | -                     |
| 应付利润              |          | -                     | -                     |
| 递延所得税负债           |          | -                     | -                     |
| 其他负债              | 6.4.7.8  | 110,001.59            | 290,679.68            |
| <b>负债合计</b>       |          | <b>5,138,492.90</b>   | <b>12,089,814.31</b>  |
| <b>所有者权益：</b>     |          | -                     | -                     |
| 实收基金              | 6.4.7.9  | 220,326,061.38        | 226,987,604.17        |
| 未分配利润             | 6.4.7.10 | 211,246,718.22        | 177,773,342.70        |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>431,572,779.60</b> | <b>404,760,946.87</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>436,711,272.50</b> | <b>416,850,761.18</b> |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.959 元，基金份额总额 220,326,061.38 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上投摩根中小盘混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>      |          | <b>45,572,476.36</b>                     | <b>-84,492,427.48</b>                         |
| 1.利息收入           |          | 178,229.60                               | 324,244.08                                    |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.11 | 178,229.60                               | 279,766.70                                    |
| 债券利息收入           |          | -  | 44,477.38                                     |
| 资产支持证券利息收入       |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入       |          | -  | -   |
| 其他利息收入           |          | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | -18,340,711.47                           | -51,097,171.38                                |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.12 | -19,744,319.52                           | -51,410,679.18                                |
| 基金投资收益           |          | -  | -   |
| 债券投资收益           | 6.4.7.13 | -  | -630,796.98                                   |
| 资产支持证券投资收益       |          | -  | -   |
| 贵金属投资收益          |          | -  | -   |

|                            |          |                      |                       |
|----------------------------|----------|----------------------|-----------------------|
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14 | -                    | -                     |
| 股利收益                       | 6.4.7.15 | 1,403,608.05         | 944,304.78            |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.16 | 63,708,603.69        | -33,788,656.82        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                    | -                     |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.17 | 26,354.54            | 69,156.64             |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>6,153,992.43</b>  | <b>9,187,962.31</b>   |
| 1. 管理人报酬                   |          | 3,037,835.84         | 3,608,937.85          |
| 2. 托管费                     |          | 506,306.02           | 601,489.66            |
| 3. 销售服务费                   |          | -                    | -                     |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18 | 2,486,483.64         | 4,826,296.18          |
| 5. 利息支出                    |          | -                    | -                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -                    | -                     |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 123,366.93           | 151,238.62            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>39,418,483.93</b> | <b>-93,680,389.79</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                    | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>39,418,483.93</b> | <b>-93,680,389.79</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根中小盘混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |                |                |
|--|---------------------------------------|----------------|----------------|
|  | 实收基金                                  | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 226,987,604.17                        | 177,773,342.70 | 404,760,946.87 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 39,418,483.93  | 39,418,483.93  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -6,661,542.79                         | -5,945,108.41  | -12,606,651.20 |
| 其中：1.基金申购款                             | 16,247,070.96                         | 13,231,968.59  | 29,479,039.55  |
| 2.基金赎回款                                | -22,908,613.75                        | -19,177,077.00 | -42,085,690.75 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                     | -              | -              |
| 五、期末所有者权益（基                            | 220,326,061.38                        | 211,246,718.22 | 431,572,779.60 |

| 项目                                     | 上年度可比期间                         |                |                |
|--|---------------------------------|----------------|----------------|
|  | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |                |                |
|  | 实收基金                            | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 255,384,083.17                  | 356,109,241.50 | 611,493,324.67 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | -93,680,389.79 | -93,680,389.79 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 2,114,401.79                    | 197,584.09     | 2,311,985.88   |
| 其中：1.基金申购款                             | 37,634,028.81                   | 33,010,327.91  | 70,644,356.72  |
| 2.基金赎回款                                | -35,519,627.02                  | -32,812,743.82 | -68,332,370.84 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                               | -              | -              |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 257,498,484.96                  | 262,626,435.80 | 520,124,920.76 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：章硕麟，主管会计工作负责人：胡志强，会计机构负责人：张璐

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上投摩根中小盘混合型证券投资基金(原名为上投摩根中小盘股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]1316 号《关于核准上投摩根中小盘股票型证券投资基金募集的批复》核准，由上投摩根基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2008 年 12 月 22 日至 2009 年 1 月 16 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 825,940,005.46 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 015 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 1 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 826,057,598.05 份基金份额，其中认购资金利息折合 117,592.59 份基金份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，上投摩根中小盘股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 21 日公告后更名为上投摩根中小盘混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根中小盘混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的 A 股、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金投资组合中股票投资的比例范围为基金资产的 60%-95%，债券、权证、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 5%-40%，并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金将不低于 80%的股票资产投资于中小盘股票。本基金的业绩比较基准为：天相中盘指数收益率 X 40%+天相小盘指数收益率 X 40%+上证国债指数收益率 X 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于 2017 年 8 月 25 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根中小盘混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股

息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

- (4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，本基金的基金管理人接外方股东摩根资产管理（英国）有限公司的通知，其控制的公司 J.P. Morgan Investment Management Limited 已完成清算，因此该公司不再是我司及我司旗下投资组合的关联方。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系             |
|------------------------|---------------------|
| 上投摩根基金管理有限公司           | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司("中国建设银行") | 基金托管人、基金代销机构        |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年6月<br>30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,037,835.84                   | 3,608,937.85                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 382,068.81                     | 430,819.23                          |

注：支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元



| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2017年1月1日至2017年6月30日 | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 506,306.02           | 601,489.66           |

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期                   |            | 上年度可比期间              |            |
|--------|----------------------|------------|----------------------|------------|
|        | 2017年1月1日至2017年6月30日 |            | 2016年1月1日至2016年6月30日 |            |
|        | 期末余额                 | 当期利息收入     | 期末余额                 | 当期利息收入     |
| 中国建设银行 | 44,937,019.71        | 164,815.63 | 38,371,568.66        | 253,362.88 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.9 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.9.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |       |        |           |            |            |    |
|---------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|-----------|------------|------------|----|
| 证券代码                | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位：股)  | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 002859              | 洁美科技 | 2017-03-24 | 2018-04-07 | 限售股    | 29.82 | 73.00  | 6,666.00  | 198,780.12 | 486,618.00 | -  |
| 002879              | 长缆科技 | 2017-06-05 | 2017-07-07 | 网下中签   | 18.02 | 18.02  | 1,313.00  | 23,660.26  | 23,660.26  | -  |
| 002882              | 金龙羽  | 2017-06-15 | 2017-07-17 | 网下中签   | 6.20  | 6.20   | 2,966.00  | 18,389.20  | 18,389.20  | -  |
| 300670              | 大烨智能 | 2017-06-26 | 2017-07-03 | 网下中签   | 10.93 | 10.93  | 1,259.00  | 13,760.87  | 13,760.87  | -  |
| 300671              | 富满电子 | 2017-06-27 | 2017-07-05 | 网下中签   | 8.11  | 8.11   | 942.00    | 7,639.62   | 7,639.62   | -  |
| 300672              | 国科微  | 2017-06-30 | 2017-07-12 | 网下中签   | 8.48  | 8.48   | 1,257.00  | 10,659.36  | 10,659.36  | -  |
| 603823              | 百合花  | 2016-12-09 | 2017-12-20 | 限售股    | 10.60 | 21.18  | 36,764.00 | 389,698.40 | 778,661.52 | -  |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期       | 复牌开盘单价 | 数量(单位：股)   | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|------------|---------------|---------------|----|
| 300065 | 海兰信  | 2016-12-08 | 重大事项 | 24.49  | 2017-07-06 | 23.07  | 527,346.00 | 13,161,298.58 | 12,914,703.54 | -  |

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

**6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

**6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

**6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****(1) 增值税**

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(2) 除增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

**7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目    | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资  | 390,561,655.35 | 89.43         |
|    | 其中：股票 | 390,561,655.35 | 89.43         |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 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 | 买入返售金融资产          | -              | -      |
|   | 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      | 45,719,852.19  | 10.47  |
| 7 | 其他各项资产            | 429,764.96     | 0.10   |
| 8 | 合计                | 436,711,272.50 | 100.00 |

## 7.2 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              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 343,442,242.17 | 79.58        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 26,908,004.62  | 6.23         |
| J  | 金融业              | 8,384,206.00   | 1.94         |
| 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    | 150,812.50     | 0.03         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | 10,143,060.06  | 2.35         |
| Q  | 卫生和社会工作          | -              | -            |

|   |           |                |       |
|---|-----------|----------------|-------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,533,330.00   | 0.36  |
| S | 综合        | -              | -     |
|   | 合计        | 390,561,655.35 | 90.50 |

### 7.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 002456 | 欧菲光  | 2,318,885 | 42,134,140.45 | 9.76         |
| 2  | 002460 | 赣锋锂业 | 903,866   | 41,803,802.50 | 9.69         |
| 3  | 002466 | 天齐锂业 | 765,329   | 41,595,631.15 | 9.64         |
| 4  | 002411 | 必康股份 | 1,180,420 | 34,137,746.40 | 7.91         |
| 5  | 300136 | 信维通信 | 673,684   | 26,960,833.68 | 6.25         |
| 6  | 600406 | 国电南瑞 | 1,524,100 | 26,900,365.00 | 6.23         |
| 7  | 300115 | 长盈精密 | 659,794   | 19,252,788.92 | 4.46         |
| 8  | 603626 | 科森科技 | 205,800   | 13,414,044.00 | 3.11         |
| 9  | 002008 | 大族激光 | 384,900   | 13,332,936.00 | 3.09         |
| 10 | 002241 | 歌尔股份 | 673,607   | 12,987,142.96 | 3.01         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（www.cifm.com）的半年度报告正文。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 002460 | 赣锋锂业 | 40,526,505.16 | 10.01          |
| 2  | 002466 | 天齐锂业 | 40,219,798.40 | 9.94           |
| 3  | 300115 | 长盈精密 | 35,130,651.20 | 8.68           |
| 4  | 002456 | 欧菲光  | 26,695,313.64 | 6.60           |
| 5  | 600406 | 国电南瑞 | 25,842,444.11 | 6.38           |
| 6  | 300136 | 信维通信 | 23,793,542.89 | 5.88           |
| 7  | 002709 | 天赐材料 | 17,226,707.99 | 4.26           |
| 8  | 002827 | 高争民爆 | 15,628,244.07 | 3.86           |
| 9  | 002768 | 国恩股份 | 15,300,848.24 | 3.78           |
| 10 | 002241 | 歌尔股份 | 14,836,919.76 | 3.67           |
| 11 | 603377 | 东方时尚 | 14,224,830.59 | 3.51           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 12 | 300570 | 太辰光  | 14,016,207.89 | 3.46 |
| 13 | 000065 | 北方国际 | 12,222,409.48 | 3.02 |
| 14 | 002384 | 东山精密 | 11,947,636.02 | 2.95 |
| 15 | 603900 | 通灵珠宝 | 11,928,767.02 | 2.95 |
| 16 | 603626 | 科森科技 | 11,926,376.78 | 2.95 |
| 17 | 601800 | 中国交建 | 11,808,351.76 | 2.92 |
| 18 | 002589 | 瑞康医药 | 11,579,227.70 | 2.86 |
| 19 | 002475 | 立讯精密 | 11,544,489.40 | 2.85 |
| 20 | 600068 | 葛洲坝  | 11,297,531.18 | 2.79 |
| 21 | 002008 | 大族激光 | 11,267,572.31 | 2.78 |
| 22 | 000820 | 神雾节能 | 11,162,860.08 | 2.76 |
| 23 | 300073 | 当升科技 | 11,111,236.59 | 2.75 |
| 24 | 603799 | 华友钴业 | 10,927,006.29 | 2.70 |
| 25 | 600703 | 三安光电 | 10,751,958.17 | 2.66 |
| 26 | 002045 | 国光电器 | 10,233,262.59 | 2.53 |
| 27 | 002635 | 安洁科技 | 9,949,293.00  | 2.46 |
| 28 | 601117 | 中国化学 | 9,735,057.77  | 2.41 |
| 29 | 002497 | 雅化集团 | 8,743,984.75  | 2.16 |
| 30 | 603036 | 如通股份 | 8,519,270.22  | 2.10 |
| 31 | 300340 | 科恒股份 | 8,286,872.68  | 2.05 |
| 32 | 603708 | 家家悦  | 8,253,270.00  | 2.04 |
| 33 | 000878 | 云南铜业 | 8,219,421.03  | 2.03 |
| 34 | 600884 | 杉杉股份 | 8,209,061.71  | 2.03 |
| 35 | 600030 | 中信证券 | 8,130,939.00  | 2.01 |

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 603377 | 东方时尚 | 24,056,821.94 | 5.94            |
| 2  | 300340 | 科恒股份 | 21,805,106.07 | 5.39            |
| 3  | 603108 | 润达医疗 | 19,480,612.74 | 4.81            |
| 4  | 300115 | 长盈精密 | 18,848,370.42 | 4.66            |
| 5  | 002709 | 天赐材料 | 16,094,221.16 | 3.98            |
| 6  | 002827 | 高争民爆 | 14,962,888.68 | 3.70            |
| 7  | 002768 | 国恩股份 | 14,853,290.20 | 3.67            |
| 8  | 603799 | 华友钴业 | 14,780,441.06 | 3.65            |
| 9  | 000980 | 众泰汽车 | 13,664,174.40 | 3.38            |
| 10 | 002310 | 东方园林 | 13,216,354.42 | 3.27            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 11 | 002343 | 慈文传媒 | 13,173,449.59 | 3.25 |
| 12 | 300570 | 太辰光  | 12,868,152.18 | 3.18 |
| 13 | 300073 | 当升科技 | 12,596,352.45 | 3.11 |
| 14 | 601233 | 桐昆股份 | 12,551,069.75 | 3.10 |
| 15 | 600068 | 葛洲坝  | 12,164,438.08 | 3.01 |
| 16 | 603900 | 通灵珠宝 | 11,505,788.96 | 2.84 |
| 17 | 000065 | 北方国际 | 11,428,422.24 | 2.82 |
| 18 | 601800 | 中国交建 | 11,297,622.96 | 2.79 |
| 19 | 002589 | 瑞康医药 | 11,135,235.25 | 2.75 |
| 20 | 600497 | 驰宏锌锗 | 11,016,508.23 | 2.72 |
| 21 | 002236 | 大华股份 | 10,637,934.18 | 2.63 |
| 22 | 300296 | 利亚德  | 9,745,930.96  | 2.41 |
| 23 | 600362 | 江西铜业 | 9,584,923.04  | 2.37 |
| 24 | 002407 | 多氟多  | 9,160,326.51  | 2.26 |
| 25 | 000878 | 云南铜业 | 9,063,653.63  | 2.24 |
| 26 | 300377 | 赢时胜  | 9,042,578.24  | 2.23 |
| 27 | 002195 | 二三四五 | 9,037,476.01  | 2.23 |
| 28 | 000060 | 中金岭南 | 8,874,471.53  | 2.19 |
| 29 | 601117 | 中国化学 | 8,622,657.85  | 2.13 |
| 30 | 600809 | 山西汾酒 | 8,385,545.86  | 2.07 |
| 31 | 603708 | 家家悦  | 8,192,349.01  | 2.02 |
| 32 | 600990 | 四创电子 | 8,173,153.29  | 2.02 |

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

|               |                |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 807,373,895.59 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 825,417,222.28 |

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 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。

**7.8 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贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 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。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 177,557.69 |
| 2  | 应收证券清算款 | 180,454.48 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 9,956.79   |
| 5  | 应收申购款   | 61,796.00  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |



|   |    |            |
|---|----|------------|
| 8 | 其他 | -          |
| 9 | 合计 | 429,764.96 |

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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无流通受限情况。

#### 7.12.6 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。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构         |        |                |        |
|----------|-----------|---------------|--------|----------------|--------|
|          |           | 机构投资者         |        | 个人投资者          |        |
|          |           | 持有份额          | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 20,117   | 10,952.23 | 28,801,940.97 | 13.07% | 191,524,120.41 | 86.93% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 1,936.28  | 0.0009%  |

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2009年1月21日）基金份额总额 | 826,057,598.05 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 226,987,604.17 |
| 本报告期基金总申购份额               | 16,247,070.96  |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 22,908,613.75  |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额              | 220,326,061.38 |

**10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

基金管理人：

无。

基金托管人：

无。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

报告期内无基金投资策略的改变。

**10.5 报告期内改聘会计师事务所情况**

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

报告期内，管理人、托管人未受稽查或处罚，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 川财证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中投证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 平安证券 | 1      | 802,398,916.15 | 49.27%       | 747,274.79 | 49.27%     | -  |
| 华泰证券 | 1      | 405,319,808.89 | 24.89%       | 377,476.09 | 24.89%     | -  |
| 西南证券 | 1      | 252,121,457.33 | 15.48%       | 234,801.90 | 15.48%     | -  |
| 国信证券 | 1      | 168,623,911.76 | 10.35%       | 157,037.53 | 10.35%     | -  |

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

## 2. 交易单元的选择标准：

- 1) 资本金雄厚,信誉良好。
- 2) 财务状况良好,经营行为规范。
- 3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

5) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

## 3. 交易单元的选择程序：

1) 本基金管理人定期召开会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进行评估，确定选用交易单元的券商。

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

4. 本报告期本基金无新增席位，无注销席位。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |          | 回购交易 |          | 权证交易 |          |
|------|------|----------|------|----------|------|----------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总 | 成交金额 | 占当期回购成交总 | 成交金额 | 占当期权证成交总 |

|      |   | 额的比例 |   | 额的比例 |   | 额的比例 |
|------|---|------|---|------|---|------|
| 川财证券 | - | -    | - | -    | - | -    |
| 中投证券 | - | -    | - | -    | - | -    |
| 平安证券 | - | -    | - | -    | - | -    |
| 华泰证券 | - | -    | - | -    | - | -    |
| 西南证券 | - | -    | - | -    | - | -    |
| 国信证券 | - | -    | - | -    | - | -    |

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无

上投摩根基金管理有限公司

二〇一七年八月二十八日