

**上投摩根中小盘混合型证券投资基金**  
**2019 年半年度报告**  
**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：二〇一九年八月二十四日

## 1 重要提示及目录

### 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 2019 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	错误!未定义书签。
2.2 基金产品说明.....	错误!未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人.....	错误!未定义书签。
2.4 信息披露方式.....	错误!未定义书签。
2.5 其他相关资料.....	错误!未定义书签。
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	错误!未定义书签。
3.2 基金净值表现.....	错误!未定义书签。
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	错误!未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	错误!未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	错误!未定义书签。
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.....	错误!未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	错误!未定义书签。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	错误!未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	错误!未定义书签。
<b>5 托管人报告</b> .....	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	错误!未定义书签。
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.....	错误!未定义书签。
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	错误!未定义书签。
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
6.1 资产负债表.....	错误!未定义书签。
6.2 利润表.....	错误!未定义书签。
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	错误!未定义书签。
6.4 报表附注.....	错误!未定义书签。
<b>7 投资组合报告</b> .....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	错误!未定义书签。
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	错误!未定义书签。
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
7.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
7.5 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动.....	错误!未定义书签。
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	错误!未定义书签。
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	错误!未定义书签。
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	错误!未定义书签。
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	错误!未定义书签。
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	错误!未定义书签。
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	错误!未定义书签。
7.13 投资组合报告附注.....	错误!未定义书签。
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	错误!未定义书签。

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	错误!未定义书签。
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	错误!未定义书签。
<b>9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>43</b>
<b>10 重大事件揭示.....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	错误!未定义书签。
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.....	错误!未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	错误!未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变.....	错误!未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	错误!未定义书签。
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.....	错误!未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	错误!未定义书签。
10.8 其他重大事件.....	错误!未定义书签。
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>45</b>
<b>12 备查文件目录.....</b>	<b>错误!未定义书签。</b>
12.1 备查文件目录.....	错误!未定义书签。
12.2 存放地点.....	错误!未定义书签。
12.3 查阅方式.....	错误!未定义书签。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根中小盘混合型证券投资基金
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	271,468,291.22 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： $40\% \times \text{天相中盘指数收益率} + 40\% \times \text{天相小盘指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$
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 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
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区	北京市西城区金融大街25号

	富城路99号震旦国际大楼25楼	
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区 富城路99号震旦国际大楼25楼	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	陈兵	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cifm.com">http://www.cifm.com</a>
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上投摩根基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 震旦国际大楼 25 楼

## 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（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	55,146,070.74
本期利润	99,269,834.77
加权平均基金份额本期利润	0.3714
本期加权平均净值利润率	22.04%
本期基金份额净值增长率	29.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	199,460,434.03
期末可供分配基金份额利润	0.7347
期末基金资产净值	470,928,725.25
期末基金份额净值	1.735
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	87.51%

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	1.17%	1.71%	1.87%	1.05%	-0.70%	0.66%
过去三个月	-6.11%	2.03%	-6.09%	1.37%	-0.02%	0.66%
过去六个月	29.57%	1.97%	16.66%	1.36%	12.91%	0.61%
过去一年	-4.19%	1.91%	-0.66%	1.29%	-3.53%	0.62%
过去三年	-9.89%	1.59%	-9.52%	0.98%	-0.37%	0.61%
自基金合同生效起至今	87.51%	1.81%	87.93%	1.32%	-0.42%	0.49%

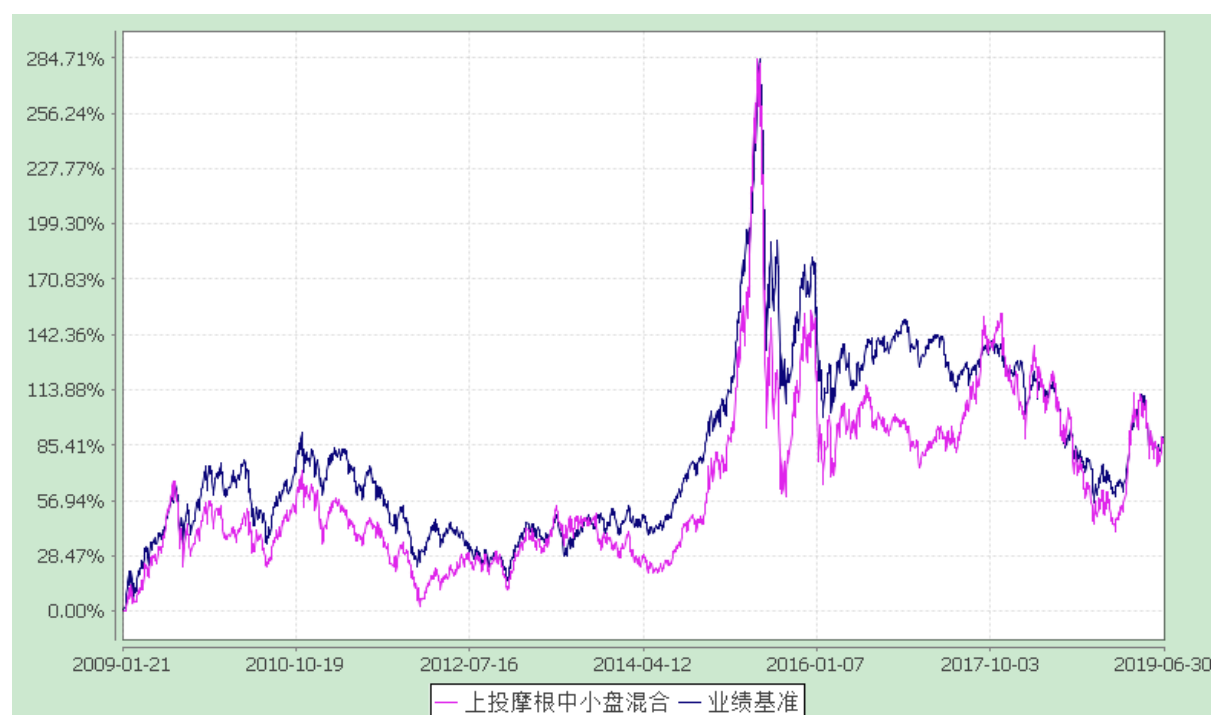
注：本基金的业绩比较基准为： $40\% \times$ 天相中盘指数收益率 $+40\% \times$ 天相小盘指数收益率 $+20\% \times$ 上证国债指数收益率。

#### 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 2019 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为 2009 年 1 月 21 日，图示时间段为 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 2019 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有六十四只，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、上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）、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、上投摩根安通回报混合型证券投资基金、上投摩根优选多因子股票型证券投资基金、上投摩根丰瑞债券型证券投资基金、上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金、上投摩根安隆回报混合型证券投资基金、上投摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金 (QDII)、上投摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、上投摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、上投摩根安裕回报混合型证券投资基金、上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金 (QDII)、上投摩根核心精选股票型证券投资基金、上投摩根动力精选混合型证券投资基金、上投摩根领先优选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 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
郭晨	本基金基金经 理	2015-01-3 0	-	12 年	郭晨先生, 自 2007 年 7 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担任基金经理, 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, 自 2019 年 3 月起同时担任上投摩根创新商业模式灵活配置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。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 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% 的次数为一次，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

一季度市场发生了逆转，上证综指在元旦后见底回升，创业板在春节后发力上攻，整个市场普涨，中小创相对收益更大一些。上涨的原因主要是以下几点：1、市场在 18 年年末过度悲观，对宏观经济和政策预期非常低。2、整个市场在悲观预期下，估值非常低，全球范围看都处于较低的水平，也是 A 股历史上估值较低的水平。3、国内权益投资市场在国民经济中的战略地位显著提高，成为国内经济发展的重要动力来源，科创板和注册制的推出是标志性事件。4、中美贸易摩擦出现缓和，

国内减税降费等利好政策开始落实。5、外资持续流入抄底，逐步推升整体市场的估值水平。在这些综合因素的作用下，A 股出现了久违的上涨，成交量显著放大，赚钱效应明显，公募基金也取得了很好的收益。上证综指一季度迅速上涨到 3200 点之后，中美贸易摩擦出现了波折，即将签署协议前，双方在谈判中出现分歧，大大超出了市场的预期，打压华为成为标志性事件，资本市场的风险偏好降低，市场调整幅度较大。另外，一季度市场经历大涨之后，宏观经济增速和上市公司盈利增速没有出现明显改善，市场需要回调整盘等待基本面的改善。一季度市场投机氛围较浓，很多基本面较差的股票涨幅很大，持续上涨的逻辑不强。整个二季度处于震荡调整之中，很多中小盘个股跌幅很大，少数大盘白马股继续保持强势。本季度基金随着市场的回调，净值也出现了一定幅度的回撤。

本基金去年年底对市场保持乐观的态度，仓位较高，并对 2019 年进行布局，行业集中在光伏、养殖、新能源汽车中下游、5G、券商等行业，持股待涨，一季度取得了不错的收益。二季度在市场调整过程中积极对仓位和持仓结构进行调整，适当降低仓位，同时增加防御类品种的配置比例。对年初涨幅较大，获利较多，基本面与估值不匹配的个股进行调整，降低行业和个股的集中度，尽力降低净值的波动和回撤。在市场回调的过程中，基本面研究更加重要，一些基本面优秀、估值合理的个股迎来了更好的买入机会。目前本基金重点关注光伏、养殖、新能源汽车、5G、券商、轻工，食品饮料等行业、2019 年战略性看好国家支持的高科技、先进制造等成长板块和与老百姓日常生活相关的消费行业，致力于长期投资高成长，低估值，低 PEG 的优秀公司。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期上投摩根中小盘混合份额净值增长率为:29.57%，同期业绩比较基准收益率为:16.66%。

#### 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，我们保持乐观态度。宏观经济和上市公司盈利有望见底。美国经济转弱，全球开启宽松周期，美联储下半年降息概率大，国内货币政策空间打开。中美贸易摩擦有缓和的迹象，大概率会重启谈判。科创板推进顺利，三季度即将迎来第一批挂牌企业，为市场带来新的热点。A 股市场在国民经济中的战略地位已经奠定，估值依然处于历史底部区间，海外资金流入的大趋势不会逆转，下半年有同时迎来基本面见底和风险偏好提升的可能性。

在目前宏观经济背景下，2019 年本基金战略看好高科技成长板块和消费板块，中小盘成长股经历了两三年的调整之后，很多个股估值逐步跌入合理水平，机构投资者仓位较低，长期来看高科技产业是中国产业升级的唯一出路，国家从战略层面上会出台更多的政策来鼓励高科技行业的发展，比如科创板等。此外目前中国 GDP 增速一半以上来自于消费，消费升级的逻辑长期存在，受益于集中度提升和产品价格提升的优质消费龙头公司值得长期关注。合理的估值、业绩增速、成长的确定

性是本基金最看重的选股维度。行业上我们重点关注新能源汽车、5G、光伏、轻工、食品饮料、券商等行业。

#### 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投资基金行业从业经验。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

无。

#### 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合规守信、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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	87,146,068.77	89,740,843.58
结算备付金		1,308,674.30	1,255,668.44
存出保证金		277,982.60	273,243.23
交易性金融资产	6.4.7.2	390,869,277.57	273,574,838.38
其中：股票投资		390,869,277.57	273,574,838.38
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	15,775.44	18,094.51
应收股利		-	-
应收申购款		103,564.35	173,312.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>479,721,343.03</b>	<b>365,036,000.30</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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		1,421,344.02	2,149,379.66
应付赎回款		5,754,474.66	165,115.89
应付管理人报酬		569,754.47	480,963.85
应付托管费		94,959.07	80,160.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	839,766.87	691,323.08
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	112,318.69	220,339.93
<b>负债合计</b>		<b>8,792,617.78</b>	<b>3,787,283.04</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	271,468,291.22	269,760,442.73
未分配利润	6.4.7.10	199,460,434.03	91,488,274.53
<b>所有者权益合计</b>		<b>470,928,725.25</b>	<b>361,248,717.26</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>479,721,343.03</b>	<b>365,036,000.30</b>

注：报告截止日 2019 年 06 月 30 日,基金份额净值 1.735 元,基金份额总额 271,468,291.22 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>106,279,213.78</b>	<b>-39,596,193.39</b>
1.利息收入		220,297.32	181,836.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	220,159.71	181,744.81
债券利息收入		137.61	92.18
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）		61,710,866.75	5,755,885.51
其中：股票投资收益	6.4.7.12	59,609,232.73	4,472,902.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	73,677.90	13,660.78
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	2,027,956.12	1,269,322.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	44,123,764.03	-45,630,706.12
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	224,285.68	96,790.23
<b>减：二、费用</b>		<b>7,009,379.01</b>	<b>6,259,993.04</b>
1. 管理人报酬		3,338,002.07	3,494,132.53
2. 托管费		556,333.67	582,355.44

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,010,400.03	2,060,784.56
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.44	0.34
7. 其他费用	6.4.7.19	104,642.80	122,720.17
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>99,269,834.77</b>	<b>-45,856,186.43</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>99,269,834.77</b>	<b>-45,856,186.43</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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	269,760,442.73	91,488,274.53	361,248,717.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	99,269,834.77	99,269,834.77
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）	1,707,848.49	8,702,324.73	10,410,173.22
其中：1. 基金申购款	105,074,508.24	83,089,612.09	188,164,120.33
2. 基金赎回款	-103,366,659.75	-74,387,287.36	-177,753,947.11
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）	271,468,291.22	199,460,434.03	470,928,725.25
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	216,568,601.87	233,081,922.73	449,650,524.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-45,856,186.43	-45,856,186.43



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）	56,086,968.80	58,296,324.65	114,383,293.45
其中：1.基金申购款	100,734,971.07	106,648,655.34	207,383,626.41
2.基金赎回款	-44,648,002.27	-48,352,330.69	-93,000,332.96
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）	272,655,570.67	245,522,060.95	518,177,631.62

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：王大智，主管会计工作负责人：杨怡，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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2019 年 8 月 23 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 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[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》、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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	87,146,068.77
定期存款	-
其他存款	-
合计	87,146,068.77

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	368,062,795.78	390,869,277.57	22,806,481.79
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	368,062,795.78	390,869,277.57	22,806,481.79

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

无余额。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	13,415.46
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	588.90
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1,645.98
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	125.10
合计	15,775.44

**6.4.7.6 其他资产**

无余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	839,766.87
银行间市场应付交易费用	-
合计	839,766.87

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	21,448.65
预提费用	90,870.04
合计	112,318.69

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	269,760,442.73	269,760,442.73
本期申购	105,074,508.24	105,074,508.24
本期赎回（以“-”号填列）	-103,366,659.75	-103,366,659.75
本期末	271,468,291.22	271,468,291.22

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	141,660,917.59	-50,172,643.06	91,488,274.53
本期利润	55,146,070.74	44,123,764.03	99,269,834.77
本期基金份额交易产生的变动数	5,537,113.24	3,165,211.49	8,702,324.73
其中：基金申购款	70,517,793.08	12,571,819.01	83,089,612.09
基金赎回款	-64,980,679.84	-9,406,607.52	-74,387,287.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	202,344,101.57	-2,883,667.54	199,460,434.03

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,198.66
其他	3,930.75
合计	220,159.71

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	927,095,846.68

买卖股票差价收入	59,609,232.73
----------	---------------

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	528,419.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	454,600.00
减：应收利息总额	141.60
买卖债券差价收入	73,677.90

**6.4.7.14 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,027,956.12
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,027,956.12

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	44,123,764.03
——股票投资	44,123,764.03
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	44,123,764.03

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	211,659.80
转换费收入	12,597.07
其他	28.81
合计	224,285.68

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	3,010,400.03
银行间市场交易费用	-
合计	3,010,400.03

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	61,117.26
银行费用	4,772.76
债券帐户维护费	9,000.00
合计	104,642.80

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。



## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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

无。

### 6.4.9.2 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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,338,002.07	3,494,132.53
其中：支付销售机构的客户维护费	551,024.57	516,387.89

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	556,333.67	582,355.44

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.4.2 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。

**6.4.10.5 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	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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	87,146,068.77	203,030.30	84,900,251.04	169,066.09

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。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明****6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

本报告期本基金未实施利润分配。

**6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新股未上市	14.85	14.85	1,556.00	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股未上市	3.46	3.46	9,789.00	33,869.94	33,869.94	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“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”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先

充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律，法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监查和风险评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管，并提出内控建议。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有债券。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持全部证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司

可流通股票的 15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制), 本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算, 确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时, 本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度; 按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理, 以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外, 本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度: 根据质押品的资质确定质押率水平; 持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额; 并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时, 可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险, 包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险, 其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控, 并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息, 因此本基金的收入及经营活动的现金流量在

很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	87,146,068.77	-	-	-	87,146,068.77
结算备付金	1,308,674.30	-	-	-	1,308,674.30
存出保证金	277,982.60	-	-	-	277,982.60
交易性金融资产	-	-	-	390,869,277.57	390,869,277.57
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	15,775.44	15,775.44
应收申购款	8,546.48	-	-	95,017.87	103,564.35
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	88,741,272.15	-	-	390,980,070.88	479,721,343.03
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,421,344.02	1,421,344.02
应付赎回款	-	-	-	5,754,474.66	5,754,474.66
应付管理人报酬	-	-	-	569,754.47	569,754.47
应付托管费	-	-	-	94,959.07	94,959.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	839,766.87	839,766.87
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	112,318.69	112,318.69

负债总计	-	-	-	8,792,617.78	8,792,617.78
利率敏感度缺口	88,741,272.15	-	-	382,187,453.10	470,928,725.25
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	89,740,843.58	-	-	-	89,740,843.58
结算备付金	1,255,668.44	-	-	-	1,255,668.44
存出保证金	273,243.23	-	-	-	273,243.23
交易性金融资产	-	-	-	273,574,838.38	273,574,838.38
应收利息	-	-	-	18,094.51	18,094.51
应收申购款	11,616.33	-	-	161,695.83	173,312.16
资产总计	91,281,371.58	-	-	273,754,628.72	365,036,000.30
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,149,379.66	2,149,379.66
应付赎回款	-	-	-	165,115.89	165,115.89
应付管理人报酬	-	-	-	480,963.85	480,963.85
应付托管费	-	-	-	80,160.63	80,160.63
应付交易费用	-	-	-	691,323.08	691,323.08
其他负债	-	-	-	220,339.93	220,339.93
负债总计	-	-	-	3,787,283.04	3,787,283.04
利率敏感度缺口	91,281,371.58	-	-	269,967,345.68	361,248,717.26

表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。



#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	390,869,277.57	83.00	273,574,838.38	75.73

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	390,869,277.57	83.00	273,574,838.3 8	75.73

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除天相中盘指数 X 50%+天相小盘指数 X 50%以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 3,013	增加约 2,106
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 3,013	减少约 2,106

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	390,869,277.57	81.48
	其中：股票	390,869,277.57	81.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返 售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	88,454,743.07	18.44
8	其他各项资产	397,322.39	0.08
9	合计	479,721,343.03	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	12,749,323.80	2.71
B	采矿业	279,562.50	0.06
C	制造业	243,738,055.23	51.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,606,095.00	0.98
F	批发和零售业	14,883,614.01	3.16
G	交通运输、仓储和邮政业	3,168,380.00	0.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	73,058,368.27	15.51
J	金融业	29,131,751.86	6.19
K	房地产业	2,073,258.00	0.44
L	租赁和商务服务业	1,622,295.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	83,527.50	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,487,499.80	0.95
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	964,440.00	0.20
	合计	390,869,277.57	83.00

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000858	五粮液	218,600	25,783,870.00	5.48
2	300059	东方财富	1,771,530	24,004,231.50	5.10
3	600438	通威股份	1,673,184	23,524,967.04	5.00
4	002157	正邦科技	1,045,415	17,416,613.90	3.70
5	300033	同花顺	154,259	15,172,915.24	3.22
6	000568	泸州老窖	185,000	14,953,550.00	3.18
7	600519	贵州茅台	14,700	14,464,800.00	3.07
8	603899	晨光文具	316,280	13,906,831.60	2.95
9	601933	永辉超市	1,352,181	13,805,768.01	2.93
10	600570	恒生电子	202,225	13,781,633.75	2.93
11	002405	四维图新	842,250	13,560,225.00	2.88
12	002714	牧原股份	215,573	12,673,536.67	2.69
13	603986	兆易创新	132,870	11,519,829.00	2.45
14	002768	国恩股份	424,821	10,726,730.25	2.28
15	601012	隆基股份	458,122	10,587,199.42	2.25
16	601211	国泰君安	573,600	10,525,560.00	2.24
17	603816	顾家家居	308,960	9,862,003.20	2.09
18	603019	中科曙光	267,400	9,385,740.00	1.99
19	002371	北方华创	134,278	9,298,751.50	1.97
20	002511	中顺洁柔	690,700	8,481,796.00	1.80
21	600536	中国软件	121,106	6,499,759.02	1.38
22	000977	浪潮信息	261,239	6,233,162.54	1.32
23	601688	华泰证券	273,990	6,115,456.80	1.30
24	600809	山西汾酒	87,874	6,067,699.70	1.29
25	600309	万华化学	139,300	5,960,647.00	1.27
26	600958	东方证券	518,468	5,537,238.24	1.18
27	603589	口子窖	75,759	4,880,394.78	1.04
28	601128	常熟银行	621,700	4,799,524.00	1.02
29	300347	泰格医药	52,098	4,016,755.80	0.85
30	603501	韦尔股份	64,277	3,529,450.07	0.75
31	300274	阳光电源	374,609	3,502,594.15	0.74
32	002099	海翔药业	477,100	3,387,410.00	0.72
33	002821	凯莱英	29,134	2,857,462.72	0.61
34	000860	顺鑫农业	56,680	2,644,122.00	0.56
35	300450	先导智能	78,076	2,623,353.60	0.56
36	601186	中国铁建	245,700	2,444,715.00	0.52
37	603658	安图生物	34,900	2,385,764.00	0.51
38	002583	海能达	264,790	2,221,588.10	0.47
39	601390	中国中铁	331,500	2,161,380.00	0.46
40	600848	上海临港	66,600	2,073,258.00	0.44
41	603128	华贸物流	218,800	2,056,720.00	0.44

42	002236	大华股份	134,786	1,957,092.72	0.42
43	000661	长春高新	5,344	1,806,272.00	0.38
44	300595	欧普康视	47,080	1,676,048.00	0.36
45	601888	中国国旅	18,300	1,622,295.00	0.34
46	600837	海通证券	105,100	1,491,369.00	0.32
47	600872	中炬高新	34,400	1,473,352.00	0.31
48	300006	莱美药业	312,500	1,459,375.00	0.31
49	603601	再升科技	172,718	1,374,835.28	0.29
50	000066	中国长城	129,100	1,327,148.00	0.28
51	300567	精测电子	24,600	1,291,992.00	0.27
52	600018	上港集团	163,000	1,111,660.00	0.24
53	603939	益丰药房	15,400	1,077,846.00	0.23
54	002594	比亚迪	20,335	1,031,391.20	0.22
55	600895	张江高科	47,000	964,440.00	0.20
56	000651	格力电器	16,800	924,000.00	0.20
57	300575	中旗股份	27,540	786,542.40	0.17
58	300015	爱尔眼科	15,200	470,744.00	0.10
59	601555	东吴证券	43,458	445,444.50	0.09
60	002385	大北农	75,910	401,563.90	0.09
61	000876	新希望	22,341	388,063.17	0.08
62	002124	天邦股份	28,451	371,001.04	0.08
63	002567	唐人神	31,051	358,639.05	0.08
64	002838	道恩股份	29,638	331,945.60	0.07
65	600968	海油发展	78,750	279,562.50	0.06
66	000063	中兴通讯	5,984	194,659.52	0.04
67	600030	中信证券	7,698	183,289.38	0.04
68	603288	海天味业	900	94,500.00	0.02
69	000888	峨眉山 A	13,875	83,527.50	0.02
70	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.02
71	600975	新五丰	6,871	75,787.13	0.02
72	002643	万润股份	5,721	57,782.10	0.01
73	002050	三花智控	4,608	48,614.40	0.01
74	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
75	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
76	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
77	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
78	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
79	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00

#### 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	002567	唐人神	28,837,847.00	7.98
2	600438	通威股份	26,684,006.93	7.39
3	002594	比亚迪	26,179,987.33	7.25
4	300033	同花顺	25,301,909.85	7.00
5	002157	正邦科技	23,350,476.00	6.46
6	000858	五粮液	22,226,151.14	6.15
7	601555	东吴证券	20,807,166.24	5.76
8	002230	科大讯飞	20,765,663.71	5.75
9	300450	先导智能	19,966,083.72	5.53
10	002299	圣农发展	19,852,019.31	5.50
11	000977	浪潮信息	19,002,170.26	5.26
12	603986	兆易创新	18,637,081.81	5.16
13	601066	中信建投	18,369,130.97	5.08
14	002384	东山精密	16,647,877.99	4.61
15	300059	东方财富	15,481,612.76	4.29
16	603019	中科曙光	15,474,819.00	4.28
17	002714	牧原股份	15,310,356.34	4.24
18	002234	民和股份	15,151,480.37	4.19
19	601688	华泰证券	15,093,502.90	4.18
20	300274	阳光电源	15,063,120.85	4.17
21	002405	四维图新	14,284,375.34	3.95
22	600570	恒生电子	13,843,667.00	3.83
23	600519	贵州茅台	13,724,978.90	3.80
24	000568	泸州老窖	13,656,925.00	3.78
25	600958	东方证券	13,328,735.97	3.69
26	601933	永辉超市	13,165,218.58	3.64
27	603899	晨光文具	12,706,198.91	3.52
28	000876	新希望	12,683,728.37	3.51
29	600588	用友网络	12,190,168.34	3.37
30	600536	中国软件	12,115,752.98	3.35
31	002124	天邦股份	11,566,274.45	3.20
32	002458	益生股份	11,469,267.00	3.17
33	002709	天赐材料	11,060,790.50	3.06
34	600809	山西汾酒	11,010,521.00	3.05
35	300188	美亚柏科	10,874,126.01	3.01
36	601012	隆基股份	10,550,548.30	2.92
37	601211	国泰君安	10,478,927.54	2.90
38	000728	国元证券	10,348,063.87	2.86
39	603816	顾家家居	9,763,264.00	2.70
40	002385	大北农	9,734,025.00	2.69
41	300618	寒锐钴业	9,270,612.20	2.57

42	603305	旭升股份	9,212,772.00	2.55
43	002371	北方华创	9,138,873.00	2.53
44	300687	赛意信息	8,847,865.20	2.45
45	603589	口子窖	8,489,349.00	2.35
46	000596	古井贡酒	8,461,830.00	2.34
47	300571	平治信息	8,195,059.46	2.27
48	300502	新易盛	7,996,338.00	2.21
49	600352	浙江龙盛	7,898,877.00	2.19
50	601166	兴业银行	7,841,960.00	2.17
51	600975	新五丰	7,598,994.00	2.10
52	600037	歌华有线	7,538,082.76	2.09

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	002594	比亚迪	45,475,944.74	12.59
2	600438	通威股份	33,457,261.78	9.26
3	601012	隆基股份	31,255,723.20	8.65
4	002567	唐人神	24,788,757.30	6.86
5	300033	同花顺	24,510,229.29	6.78
6	000063	中兴通讯	23,816,374.61	6.59
7	300450	先导智能	22,550,728.89	6.24
8	601688	华泰证券	22,548,818.00	6.24
9	601555	东吴证券	22,475,786.59	6.22
10	002230	科大讯飞	22,177,953.80	6.14
11	300136	信维通信	21,189,758.92	5.87
12	002299	圣农发展	20,614,810.40	5.71
13	601066	中信建投	20,596,200.88	5.70
14	300274	阳光电源	19,386,249.63	5.37
15	002234	民和股份	19,322,006.47	5.35
16	002458	益生股份	18,708,974.48	5.18
17	002384	东山精密	17,936,782.85	4.97
18	002124	天邦股份	17,891,554.56	4.95
19	000876	新希望	16,100,520.75	4.46
20	002157	正邦科技	14,976,240.88	4.15
21	300073	当升科技	13,112,729.96	3.63
22	603305	旭升股份	12,934,678.61	3.58
23	600570	恒生电子	12,840,056.10	3.55

24	300188	美亚柏科	12,489,936.57	3.46
25	600588	用友网络	12,314,374.74	3.41
26	002709	天赐材料	11,524,723.08	3.19
27	000977	浪潮信息	11,216,562.95	3.10
28	002821	凯莱英	11,177,198.19	3.09
29	000728	国元证券	11,036,668.12	3.06
30	603986	兆易创新	10,693,623.06	2.96
31	300037	新宙邦	10,187,336.49	2.82
32	600352	浙江龙盛	9,594,662.00	2.66
33	300687	赛意信息	9,230,824.79	2.56
34	300498	温氏股份	9,050,122.83	2.51
35	000596	古井贡酒	8,891,678.44	2.46
36	300618	寒锐钴业	8,325,106.44	2.30
37	603501	韦尔股份	8,257,097.94	2.29
38	603369	今世缘	8,248,514.63	2.28
39	002385	大北农	7,964,038.14	2.20
40	300502	新易盛	7,912,077.15	2.19
41	600958	东方证券	7,484,772.94	2.07
42	002714	牧原股份	7,424,056.92	2.06

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	1,000,266,521.84
卖出股票的收入（成交）总额	986,705,079.41

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所有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	277,982.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,775.44
5	应收申购款	103,564.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	397,322.39

**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不存在流通受限情况。

#### 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
21,236	12,783.40	45,218,084. 61	16.66%	226,250,206 .61	83.34%

#### 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	2,039.45	0.0008%

#### 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 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	269,760,442.73
本报告期基金总申购份额	105,074,508.24
减：本报告期基金总赎回份额	103,366,659.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	271,468,291.22

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本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：基金管理人于 2019 年 5 月 31 日公告，自 2019 年 5 月 31 日起，王大智先生担任公司总经理，章硕麟先生不再担任公司总经理。

基金托管人：

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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	

中投证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	1,239,367,755.22	62.47%	1,154,221.85	62.47%	-
华泰证券	1	744,582,001.23	37.53%	693,422.64	37.53%	-

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. 本基金本期无新增席位、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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中投证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	42,731.30	8.09%	-	-	-	-
华泰证券	485,688.20	91.91%	-	-	-	-

**10.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2019-05-31
2	上投摩根基金管理有限公司关于旗下部分基金投资科创板的公告	同上	2019-06-22

**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

**12 备查文件目录****12.1 备查文件目录**

1. 中国证监会批准上投摩根中小盘混合型证券投资基金设立的文件；
2. 《上投摩根中小盘混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《上投摩根中小盘混合型证券投资基金基金托管协议》；
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和营业执照。

**12.2 存放地点**

基金管理人或基金托管人处。

**12.3 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。

网址：[www.cifm.com](http://www.cifm.com)

上投摩根基金管理有限公司

二〇一九年八月二十四日