

**上投摩根中小盘混合型证券投资基金**  
**2019 年年度报告**  
**2019 年 12 月 31 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：二〇二〇年四月二十七日

## §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 2020 年 4 月 24 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 9  |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 11 |
| 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.....             | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 14 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 15 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 15 |
| 4.9 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.....       | 16 |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 16 |
| 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..... | 16 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....       | 16 |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | 16 |
| 6.1 审计意见.....                                | 16 |
| 6.2 形成审计意见的基础.....                           | 17 |
| 6.3 管理层对财务报表的责任.....                         | 17 |
| 6.4 注册会计师的责任.....                            | 17 |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | 18 |
| 7.1 资产负债表.....                               | 18 |
| 7.2 利润表.....                                 | 20 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 21 |
| 7.4 报表附注.....                                | 23 |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | 49 |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 49 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 49 |
| 8.3 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.....       | 50 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 52 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 57 |

|            |                                         |           |
|------------|-----------------------------------------|-----------|
| 8.6        | 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 .....    | 57        |
| 8.7        | 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 ..... | 57        |
| 8.8        | 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 ..... | 57        |
| 8.9        | 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 .....    | 57        |
| 8.10       | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....              | 57        |
| 8.12       | 投资组合报告附注 .....                          | 58        |
| <b>§9</b>  | <b>基金份额持有人信息</b> .....                  | <b>59</b> |
| 9.1        | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 59        |
| 9.2        | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 59        |
| 9.3        | 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 .....     | 59        |
| <b>§10</b> | <b>开放式基金份额变动</b> .....                  | <b>59</b> |
| <b>§11</b> | <b>重大事件揭示</b> .....                     | <b>60</b> |
| 11.1       | 基金份额持有人大会决议 .....                       | 60        |
| 11.2       | 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 .....       | 60        |
| 11.3       | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....            | 60        |
| 11.4       | 基金投资策略的改变 .....                         | 60        |
| 11.5       | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                  | 60        |
| 11.6       | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....          | 60        |
| 11.7       | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                 | 60        |
| 11.8       | 其他重大事件 .....                            | 62        |
| <b>12</b>  | <b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....             | <b>62</b> |
| <b>§13</b> | <b>备查文件目录</b> .....                     | <b>62</b> |
| 13.1       | 备查文件目录 .....                            | 62        |
| 13.2       | 存放地点 .....                              | 62        |
| 13.3       | 查阅方式 .....                              | 62        |

## §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 | 259,748,769.57 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。<br>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   | 邹树波                              | 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<br>富城路99号震旦国际大楼25楼 | 北京市西城区金融大街25号         |
| 办公地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区<br>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<br>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                             |
|--------|----------------------|----------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | 中国·上海市                           |
| 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<br>震旦国际大楼25楼 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 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 | 2019 年         | 2018 年          | 2017 年         |
|---------------|----------------|-----------------|----------------|
| 本期已实现收益       | 132,459,787.50 | -110,583,710.51 | 2,488,096.99   |
| 本期利润          | 237,281,939.48 | -176,771,953.63 | 62,532,793.76  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.9148         | -0.6959         | 0.2823         |
| 本期加权平均净值利润率   | 49.60%         | -39.26%         | 13.99%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 70.80%         | -32.33%         | 16.43%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019 年末        | 2018 年末         | 2017 年末        |
| 期末可供分配利润      | 272,724,341.29 | 91,488,274.53   | 217,412,539.13 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 1.0500         | 0.3391          | 1.0039         |
| 期末基金资产净值      | 594,058,416.72 | 361,248,717.26  | 449,650,524.60 |
| 期末基金份额净值      | 2.287          | 1.339           | 2.076          |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2019 年末        | 2018 年末         | 2017 年末        |
| 基金份额累计净值增长率   | 147.17%        | 44.71%          | 113.85%        |

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，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   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 13.44%   | 1.22%       | 6.10%      | 0.68%         | 7.34%  | 0.54% |
| 过去六个月 | 31.82%   | 1.29%       | 5.76%      | 0.80%         | 26.06% | 0.49% |
| 过去一年  | 70.80%   | 1.65%       | 23.54%     | 1.11%         | 47.26% | 0.54% |

|            |         |       |        |       |        |       |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三年       | 34.57%  | 1.62% | -6.74% | 0.99% | 41.31% | 0.63% |
| 过去五年       | 38.14%  | 2.10% | 3.43%  | 1.37% | 34.71% | 0.73% |
| 自基金合同生效起至今 | 147.17% | 1.78% | 98.96% | 1.30% | 48.21% | 0.48% |

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

### 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

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2009 年 1 月 21 日至 2019 年 12 月 31 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 12 月 31 日。

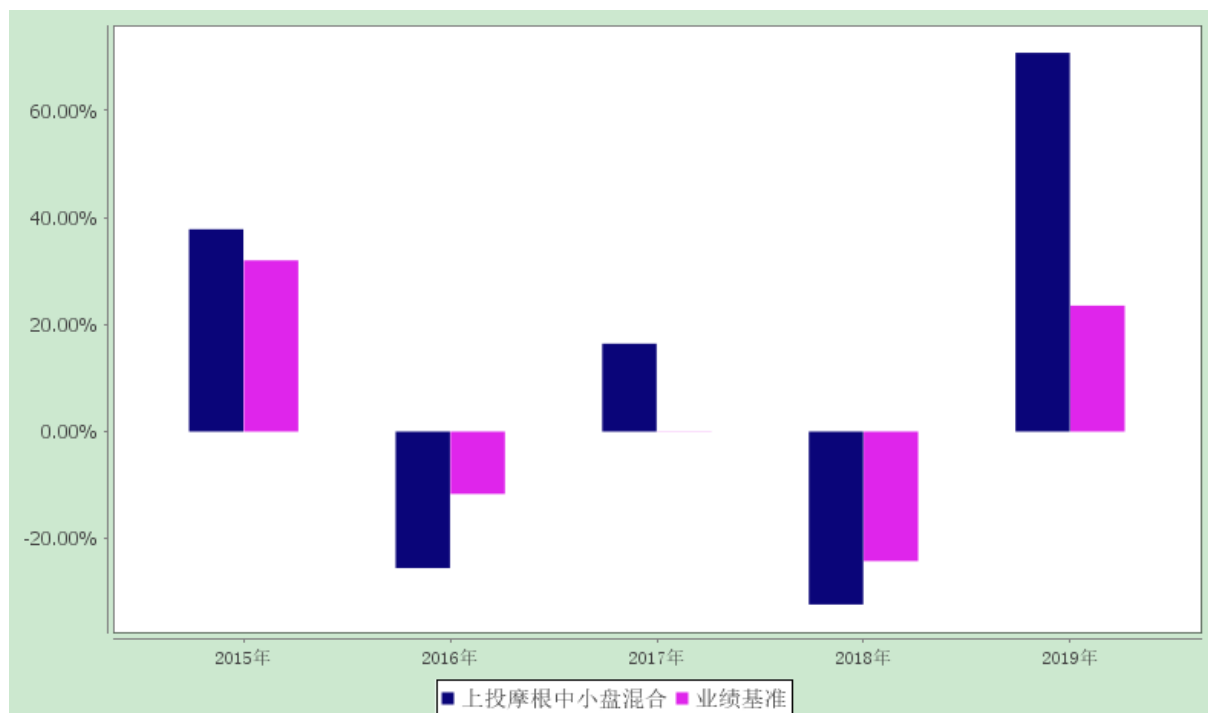
本基金建仓期自 2009 年 1 月 21 日至 2009 年 7 月 20 日。建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根中小盘混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图





注：本基金于 2009 年 1 月 21 日正式成立，图示的时间段为 2012 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度    | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额    | 年度利润分配合计      | 备注 |
|-------|-------------|---------------|--------------|---------------|----|
| 2018年 | 0.880       | 15,735,915.31 | 8,267,846.28 | 24,003,761.59 | -  |
| 合计    | 0.880       | 15,735,915.31 | 8,267,846.28 | 24,003,761.59 | -  |

## §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 12 月底，公司旗下运作的基金共有六十八只，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、上投摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)、上投摩根瑞利纯债债券型证券投资基金、上投摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、上投摩根瑞益纯债债券型证券投资基金。

#### 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 | 2015-01-30      | -    | 13 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 公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求,制订了《上投摩根基金管理有限公司公平交易制度》,规范了公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动,同时涵盖了授权、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各个环节,以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

公司执行自上而下的三级授权体系，依次为投资决策委员会、投资总监、经理人，经理人在其授权范围内自主决策，投资决策委员会和投资总监均不得干预其授权范围内的投资活动。公司已建立客观的研究方法，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。对于交易所市场投资活动，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机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易室询价机制，严格防范交易对手风险并抽检价格公允性；对于一级市场申购投资行为，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。

公司制订了《异常交易监控与报告制度》，通过系统和人工相结合的方式对投资交易行为的监控分析，并执行异常交易行为监控分析记录工作机制，确保公平交易可稽核。公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行上述公平交易制度和控制方法，开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的收益率差异、以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易时机和交易价差等方面的监控分析，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

其中，在同向交易的监控和分析方面，根据法规要求，公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控，通过定期抽查前述的同向交易行为，定性分析交易时机、对比不同投资组合长期的交易趋势，重点关注任何可能导致不公平交易的情形。对于识别的异常情况，由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释。同时，公司根据法规的要求，通过系统模块定期对连续四个季度内不同投资组合在不同时间窗内（日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行分析，采用概率统计方法，主要关注不同投资组合之间同向交易价差均值为零的显著性检验，以及同向交易价格占优的交易次数占比分析。

报告期内，通过前述分析方法，未发现不同投资组合之间同向交易价差异异常的情况。

#### 4.3.3 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，公司未发现存在异常交易行为。

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

2019 年市场整体表现不错，上证综指上涨 22.30%，创业板指数上涨 43.79%，市场机会很多，投资者大多取得了正收益。2018 年市场表现较差，投资者预期都极度悲观，进入 2019 年后，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 2018 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，并开始大举加仓。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，资本市场的风险偏好降低，市场调整幅度较大，外资阶段性流出。另外，一季度市场经历大涨之后，基本面并没有跟上，宏观经济增速和上市公司盈利增速依然处于下行之中，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，没有持续上涨的逻辑。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。

进入下半年科技股是最大的亮点，表现强势。国内宏观经济表现平稳，美国经济有见顶的迹象，全球各大央行开始降息，国内各项改革措施继续深入，对房地产保持高压态势，货币政策有保有压，没有全面放松。中美贸易摩擦经过激烈博弈之后，年底得了阶段性进展，未来可能进入一段比较平静的时期，市场逐渐认识到贸易摩擦的长期性和复杂性，敏感度逐渐降低。科创板顺利开出，市场热度很高。市场走势重新回到了行业及公司基本面的轨道上，我们基于大量的行业研究及公司调研发现，5G 商用牌照正式发放之后，相关产业链景气度显著提高，这也是科技股表现较好的基本面背景，我们逐渐可以从相关企业的投资、研发、订单和财务上得到印证。市场在四季度震荡上行，成长股表现强于蓝筹股，电子、新能源汽车，传媒表现较为亮眼，传统行业中家电、建材、有色等表现也不错。海外投资者继续大举增持国内 A 股，国内投资者积极布局，寻找未来高景气的行业和个股。

2019 年市场各板块精彩纷呈，上半年消费医药表现较好，下半年科技股更加亮眼，本基金也取得了不错的收益。2018 年年底我们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，力争降低净值的波动和回撤。经过大量的研究和调研，本基金在三季度增加了科技股的配置，取得了很好的效果，基金仓位也有所提升，四季度增加了新能源汽车和传媒行业的配置，年底超配了电子、医药、传媒、新能源汽车等行业。不管市场如何变化，本基金在 2019 年始终坚持价值投资，坚持配置高景气度行业，选择朝阳行业中最优秀的龙头公司长期投资，经过大量的研究和调研，我们关注高科技、先进制造等成长板块和与百姓生活相关的消费、医药行业的投资机会，致力长期投资高景气度、高成长，低估值的优秀龙头公司。

#### 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:70.80%，同期业绩比较基准收益率为:23.54%。

#### 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 2020 年我们持谨慎乐观态度。宏观经济大概率保持平稳，上市公司盈利增速有望见底。美国经济转弱，全球继续降息周期，国内货币政策空间打开。中美贸易摩擦未来有望平稳一段时间。新冠肺炎疫情对经济有短期的影响，不妨碍经济和资本市场运行的长期趋势，各行业受疫情影响的情况有很大差别，应从基本面的角度逐一区别对待。

过去几年随着外资的大量涌入，以外资和公募基金为代表的机构投资者在市场上占据主流地位，市场的投资理念发生了很大变化，价值投资成为主流，专业机构投资者的优势也越发突出，2019 年的投资业绩非常明显的体现出这一点，公募基金平均收益率大大跑赢市场指数。从成熟市场的经验来看，机构投资者占比提高是未来的长期趋势，机构投资者持股周期较长，投资更加理性，市场未来暴涨暴跌的走势会越来越少了，结构性的慢牛行情逐步出现。

目前 A 股估值在全球来看处于较低的水平，中国的经济基本面在全球排名前列，A 股对海外资金有巨大的吸引力。国内无风险收益率趋势性下降，房地产、理财等投资渠道的投资收益预期逐渐下降，A 股的吸引力也越来越大。长期来看，股票市场是国内极具吸引力的投资方向，我们长期看好中国 A 股的投资机会。行业上，5G 相关的科技股、游戏、新能源汽车、医药、光伏等行业的景气度较高。我们重点关注高景气行业及稳定的消费行业的投资机会。我们将重点配置高景气度行业的优质龙头上市公司，合理的估值，业绩增速，成长的确定性是本基金最看重的。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中以继续坚持“建立风险综合防控机制、保障合规诚信、支持业务发展、提高工作水平”为总体目标，一切从合规运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部门按照工作计划结合实际情况对公司各项业务进行全面的监察稽核工作，保障和促进公司各项业务合法合规运作，推动内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议并督促有关部门改进。

在本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作贯穿三条主线：

1. 注意密切追踪监管法规政策变化和监管新要求，组织员工学习理解监管精神，推动公司各部门完善制度建设和业务流程，防范日常运作中的违规行为发生。
2. 继续紧抓员工行为、公平交易、利益冲突等方面的日常监控，坚守“三条底线”不动摇；进一步加强内部合规培训和合规宣传，强化合规意识，规范员工行为操守，严格防范利益冲突。
3. 针对风险控制的需求和重点，强化内部审计，提高内部审计工作的水平和效果；按照监管部门的要求，严格推行风险控制自我评估制度，对控制不足的风险点，制订了进一步的控制措施。

在本报告期内的监察稽核工作中，未发现基金投资运作存在违法违规或未履行基金合同承诺从而对基金份额持有人利益的情形。

公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。本基金运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。我们将继续以合规运作和风险管理为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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 审计报告

普华永道中天审字(2020)第 22590 号

上投摩根中小盘混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

#### 6.1 审计意见

我们审计了上投摩根中小盘混合型证券投资基金(以下简称“上投摩根中小盘基金”)的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了上投摩根中小盘基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。



## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于上投摩根中小盘基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

## 6.3 管理层对财务报表的责任

上投摩根中小盘基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估上投摩根中小盘基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算上投摩根中小盘基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督上投摩根中小盘基金的财务报告过程。

## 6.4 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发

表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对上投摩根中小盘基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致上投摩根中小盘基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

薛 竞 沈兆杰

中国·上海市

2020 年 4 月 24 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产      | 附注号     | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产：     |         | -                       | -                        |
| 银行存款    | 7.4.7.1 | 39,487,563.97           | 89,740,843.58            |
| 结算备付金   |         | 1,943,416.97            | 1,255,668.44             |
| 存出保证金   |         | 211,654.35              | 273,243.23               |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 551,640,639.23          | 273,574,838.38           |

|                 |            |                                 |                                  |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 其中：股票投资         |            | 551,640,639.23                  | 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          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 4,233,051.29                    | -                                |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 12,968.93                       | 18,094.51                        |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 1,342,519.86                    | 173,312.16                       |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>598,871,814.60</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<br/>2019 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> |
| 负 债：            |            | -                               | -                                |
| 短期借款            |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                               | 2,149,379.66                     |
| 应付赎回款           |            | 2,572,554.12                    | 165,115.89                       |
| 应付管理人报酬         |            | 750,506.91                      | 480,963.85                       |
| 应付托管费           |            | 125,084.47                      | 80,160.63                        |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 1,179,617.86                    | 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              | 7.4.7.8  | 185,634.52            | 220,339.93            |
| <b>负债合计</b>       |          | <b>4,813,397.88</b>   | <b>3,787,283.04</b>   |
| <b>所有者权益：</b>     |          | -                     | -                     |
| 实收基金              | 7.4.7.9  | 259,748,769.57        | 269,760,442.73        |
| 未分配利润             | 7.4.7.10 | 334,309,647.15        | 91,488,274.53         |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>594,058,416.72</b> | <b>361,248,717.26</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>598,871,814.60</b> | <b>365,036,000.30</b> |

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日,基金份额净值 2.287 元,基金份额总额 259,748,769.57 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|------------------|----------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|                  |          | 2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 12 月 31 日 | 2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 12 月 31 日 |
| <b>一、收入</b>      |          | <b>252,366,343.24</b>               | <b>-163,908,137.32</b>              |
| 1.利息收入           |          | 480,002.41                          | 404,385.50                          |
| 其中：存款利息收入        | 7.4.7.11 | 479,864.80                          | 404,293.32                          |
| 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） |          | 146,645,369.97                      | -98,256,797.15                      |
| 其中：股票投资收益        | 7.4.7.12 | 144,191,470.79                      | -100,250,486.20                     |
| 基金投资收益           |          | -                                   | -                                   |
| 债券投资收益           | 7.4.7.13 | 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                     | 7.4.7.14 | -                     | -                      |
| 股利收益                       | 7.4.7.15 | 2,380,221.28          | 1,980,028.27           |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 7.4.7.16 | 104,822,151.98        | -66,188,243.12         |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                     | -                      |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 7.4.7.17 | 418,818.88            | 132,517.45             |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>15,084,403.76</b>  | <b>12,863,816.31</b>   |
| 1. 管理人报酬                   |          | 7,157,731.36          | 6,737,473.33           |
| 2. 托管费                     |          | 1,192,955.20          | 1,122,912.23           |
| 3. 销售服务费                   |          | -                     | -                      |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.18 | 6,525,047.95          | 4,755,820.00           |
| 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                    | 7.4.7.19 | 208,668.81            | 247,610.41             |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>237,281,939.48</b> | <b>-176,771,953.63</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                     | -                      |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>237,281,939.48</b> | <b>-176,771,953.63</b> |

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期                               |               |                |
|-----------------|----------------------------------|---------------|----------------|
|                 | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）               | -                                | 237,281,939.48  | 237,281,939.48  |
| 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）      | -10,011,673.16                   | 5,539,433.14    | -4,472,240.02   |
| 其中：1.基金申购款                             | 182,988,658.87                   | 172,252,404.68  | 355,241,063.55  |
| 2.基金赎回款                                | -193,000,332.03                  | -166,712,971.54 | -359,713,303.57 |
| 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）                        | 259,748,769.57                   | 334,309,647.15  | 594,058,416.72  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年12月31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）               | -                                | -176,771,953.63 | -176,771,953.63 |
| 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）      | 53,191,840.86                    | 59,182,067.02   | 112,373,907.88  |
| 其中：1.基金申购款                             | 129,792,269.93                   | 123,742,343.13  | 253,534,613.06  |
| 2.基金赎回款                                | -76,600,429.07                   | -64,560,276.11  | -141,160,705.18 |
| 四、本期向基金份额持                             | -                                | -24,003,761.59  | -24,003,761.59  |

|                              |                |               |                |
|------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 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）              | 269,760,442.73 | 91,488,274.53 | 361,248,717.26 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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 2020 年 4 月 24 日批准报出。

#### 7.4.2 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<年度报告和中期报告>》、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 7.4.4 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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。



本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终

止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为

负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行

间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 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。

##### **7.4.5.2 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。

##### **7.4.5.3 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。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 39,487,563.97           | 89,740,843.58            |
| 定期存款           | -                       | -                        |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                       | -                        |
| 存款期限 1-3 个月    | -                       | -                        |
| 存款期限 3 个月以上    | -                       | -                        |

|      |               |               |
|------|---------------|---------------|
| 其他存款 | -             | -             |
| 合计   | 39,487,563.97 | 89,740,843.58 |

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2019年12月31日  |                |                |
|---------------|-------|---------------------|----------------|----------------|
|               |       | 成本                  | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 468,135,769.49      | 551,640,639.23 | 83,504,869.74  |
| 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            |       | 468,135,769.49      | 551,640,639.23 | 83,504,869.74  |
| 项目            |       | 上年度末<br>2018年12月31日 |                |                |
|               |       | 成本                  | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 294,892,120.62      | 273,574,838.38 | -21,317,282.24 |
| 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 | 294,892,120.62 | 273,574,838.38 | -21,317,282.24 |
|----|----------------|----------------|----------------|

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

无余额。

**7.4.7.4 买入返售金融资产**

无余额。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 11,897.60               | 17,336.19                |
| 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  | 962.06                  | 621.50                   |
| 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    | 4.44                    | 1.63                     |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                       | -                        |
| 其他         | 104.83                  | 135.19                   |
| 合计         | 12,968.93               | 18,094.51                |

**7.4.7.6 其他资产**

无余额。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,179,617.86            | 691,323.08               |



|             |              |            |
|-------------|--------------|------------|
| 银行间市场应付交易费用 | -            | -          |
| 合计          | 1,179,617.86 | 691,323.08 |

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | 5,634.52                | 339.93                   |
| 预提费用        | 180,000.00              | 220,000.00               |
| 合计          | 185,634.52              | 220,339.93               |

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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          | 182,988,658.87                         | 182,988,658.87  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -193,000,332.03                        | -193,000,332.03 |
| 本期末           | 259,748,769.57                         | 259,748,769.57  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 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           | 132,459,787.50 | 104,822,151.98 | 237,281,939.48 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,396,363.80  | 6,935,796.94   | 5,539,433.14   |
| 其中：基金申购款       | 147,364,906.46 | 24,887,498.22  | 172,252,404.68 |

|         |                 |                |                 |
|---------|-----------------|----------------|-----------------|
| 基金赎回款   | -148,761,270.26 | -17,951,701.28 | -166,712,971.54 |
| 本期已分配利润 | -               | -              | -               |
| 本期末     | 272,724,341.29  | 61,585,305.86  | 334,309,647.15  |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
|           | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 活期存款利息收入  | 446,033.93            | 377,174.14            |
| 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 | 25,789.20             | 22,022.02             |
| 其他        | 8,041.67              | 5,097.16              |
| 合计        | 479,864.80            | 404,293.32            |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------|-----------------------|-----------------------|
|            | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 卖出股票成交总额   | 2,119,645,926.69      | 1,549,884,855.45      |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,975,454,455.90      | 1,650,135,341.65      |
| 买卖股票差价收入   | 144,191,470.79        | -100,250,486.20       |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                        | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 528,419.50            | 774,310.80            |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 454,600.00            | 760,500.00            |
| 减：应收利息总额               | 141.60                | 150.02                |

|          |           |           |
|----------|-----------|-----------|
| 买卖债券差价收入 | 73,677.90 | 13,660.78 |
|----------|-----------|-----------|

**7.4.7.14 衍生工具收益**

无。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-------------|-----------------------|-----------------------|
|             | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 2,380,221.28          | 1,980,028.27          |
| 基金投资产生的股利收益 | -                     | -                     |
| 合计          | 2,380,221.28          | 1,980,028.27          |

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                        | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 1.交易性金融资产              | 104,822,151.98        | -66,188,243.12        |
| ——股票投资                 | 104,822,151.98        | -66,188,243.12        |
| ——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                     | 104,822,151.98        | -66,188,243.12        |

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期                    | 上年度可比期间               |
|---------|-----------------------|-----------------------|
|         | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | 386,414.83            | 120,163.42            |
| 转换费收入   | 32,375.24             | 12,354.03             |
| 其他      | 28.81                 | -                     |
| 合计      | 418,818.88            | 132,517.45            |

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

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
|           | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 6,525,047.95          | 4,755,820.00          |
| 银行间市场交易费用 | -                     | -                     |
| 交易基金产生的费用 | -                     | -                     |
| 其中：申购费    | -                     | -                     |
| 赎回费       | -                     | -                     |
| 合计        | 6,525,047.95          | 4,755,820.00          |

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                    | 上年度可比期间               |
|---------|-----------------------|-----------------------|
|         | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 审计费用    | 60,000.00             | 60,000.00             |
| 信息披露费   | 120,000.00            | 160,000.00            |
| 银行费用    | 10,668.81             | 9,610.41              |
| 债券帐户维护费 | 18,000.00             | 18,000.00             |
| 合计      | 208,668.81            | 247,610.41            |

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 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。

**7.4.8.2 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。

**7.4.9 关联方关系**

| 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、基金销售机构                   |
| 上海国际信托有限公司(“上海信托”)                       | 基金管理人的股东                       |
| 摩根资产管理(英国)有限公司                           | 基金管理人的股东                       |
| 上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)                   | 基金管理人的股东上海国际信托有限公司的控股股东、基金销售机构 |
| 尚腾资本管理有限公司                               | 基金管理人的子公司                      |
| 上投摩根资产管理(香港)有限公司                         | 基金管理人的子公司                      |
| 上信资产管理有限公司                               | 基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司        |
| 上海国利货币经纪有限公司                             | 基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司        |
| J.P. Morgan 8CS Investments (GP) Limited | 基金管理人的股东摩根资产管理(英国)有限公司控制的公司    |

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。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

无。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年12<br>月31日 |
|----|---------------------------------|--------------------------------------|
|    |                                 |                                      |

|                 |              |              |
|-----------------|--------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 7,157,731.36 | 6,737,473.33 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,216,512.66 | 935,287.05   |

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                    | 上年度可比期间               |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
|                | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,192,955.20          | 1,122,912.23          |

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：

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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12月31日 |            | 2018年1月1日至2018年12月31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 | 39,487,563.97         | 446,033.93 | 89,740,843.58         | 377,174.14 |

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

| 7.4.12.1.1 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 |
| 002973               | 侨银环保 | 2019-12-27 | 2020-01-06 | 新股未上市  | 5.74  | 5.74   | 1,146.00   | 6,578.04     | 6,578.04     | -  |
| 003816               | 中国广核 | 2019-08-14 | 2020-02-27 | 新股锁定期内 | 2.49  | 3.53   | 562,958.00 | 1,401,765.42 | 1,987,241.74 | -  |
| 601077               | 渝农商行 | 2019-10-16 | 2020-04-29 | 新股锁定期内 | 7.36  | 6.26   | 147,778.00 | 1,087,646.08 | 925,090.28   | -  |
| 688005               | 容百科技 | 2019-07-12 | 2020-01-22 | 新股锁定期内 | 26.62 | 31.84  | 17,937.00  | 477.482.94   | 571,114.08   | -  |
| 68808                | 兴图   | 2019-1     | 2020-0     | 新股     | 28.21 | 28.21  | 3,153.     | 88,946       | 88,946       | -  |

|        |      |             |            |        |       |        |           |            |              |   |
|--------|------|-------------|------------|--------|-------|--------|-----------|------------|--------------|---|
| 1      | 新科   | 2-26        | 1-06       | 未上市    |       |        | 00        | .13        | .13          |   |
| 688101 | 三达膜  | 2019-1-08   | 2020-05-15 | 新股锁定期内 | 18.26 | 17.89  | 13,483.00 | 246,199.58 | 241,210.87   | - |
| 688108 | 赛诺医疗 | 2019-1-0-22 | 2020-04-30 | 新股锁定期内 | 6.99  | 12.40  | 9,304.00  | 65,034.96  | 115,369.60   | - |
| 688181 | 八亿时空 | 2019-1-2-27 | 2020-01-06 | 新股未上市  | 43.98 | 43.98  | 4,306.00  | 189,377.88 | 189,377.88   | - |
| 688188 | 柏楚电子 | 2019-07-31  | 2020-02-10 | 新股锁定期内 | 68.58 | 152.09 | 7,847.00  | 538,147.26 | 1,193,450.23 | - |

注：1、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。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。

#### 7.4.12.2 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<br>价 | 数量<br>(单位：股) | 期末<br>成本总额    | 期末<br>估值总额    | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|------------|--------------|---------------|---------------|----|
| 603799 | 华友钴业 | 2019-12-31 | 重要事项 | 39.39  | 2020-01-02 | 40.43      | 422,175.00   | 12,088,103.26 | 16,629,473.25 | -  |

注：本基金截至 2019 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。



#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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“风险和收益相匹配”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督和风险评估，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。

### 7.4.13.2 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人中国建设银行，因而与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 12 月 31 日，本基金无债券投资(2018 年 12 月 31 日：同)。

### 7.4.13.3 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。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计

息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不付息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 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《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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期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发行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票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，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%(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上述比例限制)。

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 7.4.12。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%。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 3.69%。

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。于 2019 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 573,413,402.39 元，超过经确认的当日净赎回金额。

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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担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、结算备付金、存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019年12月31<br>日 | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计            |
|------------------------|---------------|------|------|-----|---------------|
| 资产                     |               |      |      |     |               |
| 银行存款                   | 39,487,563.97 | -    | -    | -   | 39,487,563.97 |

|                         |               |              |              |                |                |
|-------------------------|---------------|--------------|--------------|----------------|----------------|
| 结算备付金                   | 1,943,416.97  | -            | -            | -              | 1,943,416.97   |
| 存出保证金                   | 211,654.35    | -            | -            | -              | 211,654.35     |
| 交易性金融资产                 | -             | -            | -            | 551,640,639.23 | 551,640,639.23 |
| 应收证券清算款                 | -             | -            | -            | 4,233,051.29   | 4,233,051.29   |
| 应收利息                    | -             | -            | -            | 12,968.93      | 12,968.93      |
| 应收申购款                   | 25,048.67     | -            | -            | 1,317,471.19   | 1,342,519.86   |
| 资产总计                    | 41,667,683.96 | -            | -            | 557,204,130.64 | 598,871,814.60 |
| 负债                      |               |              |              |                |                |
| 应付赎回款                   | -             | -            | -            | 2,572,554.12   | 2,572,554.12   |
| 应付管理人报酬                 | -             | -            | -            | 750,506.91     | 750,506.91     |
| 应付托管费                   | -             | -            | -            | 125,084.47     | 125,084.47     |
| 应付交易费用                  | -             | -            | -            | 1,179,617.86   | 1,179,617.86   |
| 其他负债                    | -             | -            | -            | 185,634.52     | 185,634.52     |
| 负债总计                    | -             | -            | -            | 4,813,397.88   | 4,813,397.88   |
| 利率敏感度缺口                 | 41,667,683.96 | -            | -            | 552,390,732.76 | 594,058,416.72 |
| <b>上年度末</b>             |               |              |              |                |                |
| <b>2018 年 12 月 31 日</b> | <b>1 年以内</b>  | <b>1-5 年</b> | <b>5 年以上</b> | <b>不计息</b>     | <b>合计</b>      |
| 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 |

注：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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2018 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2019年12月31日 |                          | 上年度末<br>2018年12月31日 |                          |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|               | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 551,640,639.23     | 92.86                    | 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   | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 合计            | 551,640,639.23     | 92.86                    | 273,574,838.38      | 75.73                    |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准(附注 7.4.1)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<br>2019年12月31日           | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|    | 1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%       | 增加约 3,552                    | 增加约 2,106           |
|    | 2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%       | 减少约 3,552                    | 减少约 2,106           |

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 529,692,787.13 元，属于第二层次的余额为 21,947,852.10 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 269,560,728.65 元，第二层次 4,014,109.73 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。



## §8 投资组合报告

## 8.1 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              | 551,640,639.23 | 92.11         |
|    | 其中：股票             | 551,640,639.23 | 92.11         |
| 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      | 41,430,980.94  | 6.92          |
| 8  | 其他各项资产            | 5,800,194.43   | 0.97          |
| 9  | 合计                | 598,871,814.60 | 100.00        |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 2,161,754.92   | 0.36          |
| B  | 采矿业              | -              | -             |
| C  | 制造业              | 421,106,044.89 | 70.89         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,990,283.74   | 0.34          |
| E  | 建筑业              | -              | -             |
| F  | 批发和零售业           | 52,938.06      | 0.01          |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
| 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 | 90,870,446.66  | 15.30 |
| J | 金融业             | 925,090.28     | 0.16  |
| 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      | 34,436,482.64  | 5.80  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 97,598.04      | 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         | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -              | -     |
| S | 综合              | -              | -     |
|   | 合计              | 551,640,639.23 | 92.86 |

### 8.3 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  | 603986 | 兆易创新 | 203,234   | 41,640,614.26 | 7.01         |
| 2  | 000661 | 长春高新 | 81,756    | 36,544,932.00 | 6.15         |
| 3  | 603259 | 药明康德 | 373,822   | 34,436,482.64 | 5.80         |
| 4  | 603501 | 韦尔股份 | 232,170   | 33,293,178.00 | 5.60         |
| 5  | 300601 | 康泰生物 | 375,503   | 32,965,408.37 | 5.55         |
| 6  | 002241 | 歌尔股份 | 1,596,918 | 31,810,606.56 | 5.35         |
| 7  | 002475 | 立讯精密 | 765,346   | 27,935,129.00 | 4.70         |
| 8  | 002555 | 三七互娱 | 726,521   | 19,565,210.53 | 3.29         |
| 9  | 300136 | 信维通信 | 411,300   | 18,664,794.00 | 3.14         |
| 10 | 300014 | 亿纬锂能 | 371,022   | 18,610,463.52 | 3.13         |
| 11 | 300618 | 寒锐钴业 | 206,480   | 17,011,887.20 | 2.86         |
| 12 | 603799 | 华友钴业 | 422,175   | 16,629,473.25 | 2.80         |
| 13 | 300315 | 掌趣科技 | 2,642,700 | 16,305,459.00 | 2.74         |
| 14 | 300496 | 中科创达 | 311,700   | 14,070,138.00 | 2.37         |
| 15 | 600584 | 长电科技 | 597,572   | 13,134,632.56 | 2.21         |
| 16 | 600703 | 三安光电 | 660,554   | 12,127,771.44 | 2.04         |

|    |        |      |         |               |      |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 17 | 300033 | 同花顺  | 110,100 | 12,013,011.00 | 2.02 |
| 18 | 688088 | 虹软科技 | 254,084 | 12,005,469.00 | 2.02 |
| 19 | 300750 | 宁德时代 | 110,300 | 11,735,920.00 | 1.98 |
| 20 | 002371 | 北方华创 | 126,200 | 11,105,600.00 | 1.87 |
| 21 | 600031 | 三一重工 | 576,856 | 9,835,394.80  | 1.66 |
| 22 | 002768 | 国恩股份 | 419,821 | 9,777,631.09  | 1.65 |
| 23 | 002460 | 赣锋锂业 | 269,300 | 9,379,719.00  | 1.58 |
| 24 | 688111 | 金山办公 | 49,029  | 8,035,853.10  | 1.35 |
| 25 | 002812 | 恩捷股份 | 154,441 | 7,799,270.50  | 1.31 |
| 26 | 002605 | 姚记科技 | 329,200 | 6,402,940.00  | 1.08 |
| 27 | 002602 | 世纪华通 | 557,803 | 6,375,688.29  | 1.07 |
| 28 | 300769 | 德方纳米 | 52,300  | 5,956,447.00  | 1.00 |
| 29 | 002690 | 美亚光电 | 149,200 | 5,833,720.00  | 0.98 |
| 30 | 002036 | 联创电子 | 311,370 | 5,296,403.70  | 0.89 |
| 31 | 002353 | 杰瑞股份 | 129,527 | 4,787,317.92  | 0.81 |
| 32 | 002624 | 完美世界 | 104,300 | 4,603,802.00  | 0.77 |
| 33 | 300115 | 长盈精密 | 247,300 | 4,399,467.00  | 0.74 |
| 34 | 601865 | 福莱特  | 299,600 | 3,634,148.00  | 0.61 |
| 35 | 600801 | 华新水泥 | 125,600 | 3,319,608.00  | 0.56 |
| 36 | 000401 | 冀东水泥 | 187,000 | 3,180,870.00  | 0.54 |
| 37 | 300088 | 长信科技 | 227,000 | 2,331,290.00  | 0.39 |
| 38 | 003816 | 中国广核 | 563,803 | 1,990,283.74  | 0.34 |
| 39 | 000998 | 隆平高科 | 135,200 | 1,988,792.00  | 0.33 |
| 40 | 688363 | 华熙生物 | 22,374  | 1,865,991.60  | 0.31 |
| 41 | 002174 | 游族网络 | 74,400  | 1,731,288.00  | 0.29 |
| 42 | 603659 | 璞泰来  | 15,900  | 1,353,885.00  | 0.23 |
| 43 | 600640 | 号百控股 | 52,180  | 1,346,765.80  | 0.23 |
| 44 | 688188 | 柏楚电子 | 7,847   | 1,193,450.23  | 0.20 |
| 45 | 601077 | 渝农商行 | 147,778 | 925,090.28    | 0.16 |
| 46 | 002236 | 大华股份 | 45,503  | 904,599.64    | 0.15 |
| 47 | 600438 | 通威股份 | 48,982  | 643,133.66    | 0.11 |
| 48 | 688005 | 容百科技 | 17,937  | 571,114.08    | 0.10 |
| 49 | 300357 | 我武生物 | 12,631  | 557,658.65    | 0.09 |
| 50 | 002583 | 海能达  | 59,928  | 503,994.48    | 0.08 |
| 51 | 002384 | 东山精密 | 16,558  | 383,317.70    | 0.06 |
| 52 | 300679 | 电连技术 | 9,871   | 375,591.55    | 0.06 |
| 53 | 600309 | 万华化学 | 5,661   | 317,978.37    | 0.05 |
| 54 | 688101 | 三达膜  | 13,483  | 241,210.87    | 0.04 |
| 55 | 603589 | 口子窖  | 3,891   | 213,654.81    | 0.04 |
| 56 | 603899 | 晨光文具 | 3,949   | 192,474.26    | 0.03 |
| 57 | 688181 | 八亿时空 | 4,306   | 189,377.88    | 0.03 |
| 58 | 002456 | 欧菲光  | 11,831  | 184,563.60    | 0.03 |
| 59 | 603338 | 浙江鼎力 | 2,527   | 180,680.50    | 0.03 |
| 60 | 002714 | 牧原股份 | 1,948   | 172,962.92    | 0.03 |

|    |        |       |        |            |      |
|----|--------|-------|--------|------------|------|
| 61 | 603601 | 再升科技  | 20,418 | 156,197.70 | 0.03 |
| 62 | 688108 | 赛诺医疗  | 9,304  | 115,369.60 | 0.02 |
| 63 | 603288 | 海天味业  | 900    | 96,759.00  | 0.02 |
| 64 | 000888 | 峨眉山 A | 13,875 | 91,020.00  | 0.02 |
| 65 | 688081 | 兴图新科  | 3,153  | 88,946.13  | 0.01 |
| 66 | 002643 | 万润股份  | 5,721  | 86,901.99  | 0.01 |
| 67 | 603983 | 丸美股份  | 1,446  | 86,803.38  | 0.01 |
| 68 | 601012 | 隆基股份  | 2,601  | 64,582.83  | 0.01 |
| 69 | 300782 | 卓胜微   | 143    | 58,682.91  | 0.01 |
| 70 | 603939 | 益丰药房  | 723    | 52,938.06  | 0.01 |
| 71 | 300709 | 精研科技  | 527    | 51,461.55  | 0.01 |
| 72 | 002972 | 科安达   | 1,075  | 21,532.25  | 0.00 |
| 73 | 300661 | 圣邦股份  | 81     | 20,450.88  | 0.00 |
| 74 | 603109 | 神驰机电  | 684    | 18,105.48  | 0.00 |
| 75 | 688012 | 中微公司  | 172    | 15,892.80  | 0.00 |
| 76 | 603538 | 美诺华   | 612    | 15,110.28  | 0.00 |
| 77 | 002273 | 水晶光电  | 600    | 9,696.00   | 0.00 |
| 78 | 002973 | 侨银环保  | 1,146  | 6,578.04   | 0.00 |

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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  | 300033 | 同花顺  | 57,600,053.40 | 15.94           |
| 2  | 603986 | 兆易创新 | 52,539,731.96 | 14.54           |
| 3  | 002157 | 正邦科技 | 45,027,715.80 | 12.46           |
| 4  | 300601 | 康泰生物 | 39,839,430.07 | 11.03           |
| 5  | 000858 | 五粮液  | 36,201,817.06 | 10.02           |
| 6  | 603259 | 药明康德 | 36,010,007.69 | 9.97            |
| 7  | 000661 | 长春高新 | 31,821,658.68 | 8.81            |
| 8  | 600438 | 通威股份 | 31,100,432.93 | 8.61            |
| 9  | 603501 | 韦尔股份 | 30,396,754.87 | 8.41            |
| 10 | 002384 | 东山精密 | 29,230,706.63 | 8.09            |
| 11 | 002567 | 唐人神  | 28,837,847.00 | 7.98            |
| 12 | 002241 | 歌尔股份 | 28,551,901.88 | 7.90            |
| 13 | 603799 | 华友钴业 | 27,314,700.00 | 7.56            |
| 14 | 002714 | 牧原股份 | 27,200,783.34 | 7.53            |
| 15 | 300618 | 寒锐钴业 | 26,221,767.04 | 7.26            |
| 16 | 002594 | 比亚迪  | 26,179,987.33 | 7.25            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 17 | 300136 | 信维通信 | 25,409,468.00 | 7.03 |
| 18 | 000977 | 浪潮信息 | 24,737,794.96 | 6.85 |
| 19 | 300274 | 阳光电源 | 24,225,269.98 | 6.71 |
| 20 | 300450 | 先导智能 | 22,313,528.87 | 6.18 |
| 21 | 601688 | 华泰证券 | 22,137,551.90 | 6.13 |
| 22 | 002234 | 民和股份 | 21,896,231.19 | 6.06 |
| 23 | 300750 | 宁德时代 | 21,319,510.91 | 5.90 |
| 24 | 002475 | 立讯精密 | 21,131,964.57 | 5.85 |
| 25 | 601555 | 东吴证券 | 20,807,166.24 | 5.76 |
| 26 | 002230 | 科大讯飞 | 20,765,663.71 | 5.75 |
| 27 | 601012 | 隆基股份 | 20,690,702.12 | 5.73 |
| 28 | 000876 | 新希望  | 20,293,167.56 | 5.62 |
| 29 | 002371 | 北方华创 | 20,105,651.00 | 5.57 |
| 30 | 002511 | 中顺洁柔 | 19,879,746.40 | 5.50 |
| 31 | 002299 | 圣农发展 | 19,852,019.31 | 5.50 |
| 32 | 601066 | 中信建投 | 18,369,130.97 | 5.08 |
| 33 | 000568 | 泸州老窖 | 18,348,806.00 | 5.08 |
| 34 | 603899 | 晨光文具 | 17,582,975.91 | 4.87 |
| 35 | 002124 | 天邦股份 | 17,181,584.44 | 4.76 |
| 36 | 600031 | 三一重工 | 17,146,679.96 | 4.75 |
| 37 | 002812 | 恩捷股份 | 17,118,752.52 | 4.74 |
| 38 | 000938 | 紫光股份 | 17,098,489.92 | 4.73 |
| 39 | 300014 | 亿纬锂能 | 16,916,301.08 | 4.68 |
| 40 | 002555 | 三七互娱 | 16,824,331.97 | 4.66 |
| 41 | 000651 | 格力电器 | 16,122,963.60 | 4.46 |
| 42 | 601166 | 兴业银行 | 16,036,854.98 | 4.44 |
| 43 | 002458 | 益生股份 | 15,931,696.30 | 4.41 |
| 44 | 300059 | 东方财富 | 15,481,612.76 | 4.29 |
| 45 | 603019 | 中科曙光 | 15,474,819.00 | 4.28 |
| 46 | 002405 | 四维图新 | 15,236,748.34 | 4.22 |
| 47 | 300315 | 掌趣科技 | 15,158,545.96 | 4.20 |
| 48 | 600809 | 山西汾酒 | 14,742,737.00 | 4.08 |
| 49 | 002602 | 世纪华通 | 14,387,627.52 | 3.98 |
| 50 | 600570 | 恒生电子 | 13,843,667.00 | 3.83 |
| 51 | 601211 | 国泰君安 | 13,786,401.54 | 3.82 |
| 52 | 600519 | 贵州茅台 | 13,724,978.90 | 3.80 |
| 53 | 600536 | 中国软件 | 13,559,814.98 | 3.75 |
| 54 | 300496 | 中科创达 | 13,426,830.82 | 3.72 |
| 55 | 300357 | 我武生物 | 13,384,486.32 | 3.71 |
| 56 | 600958 | 东方证券 | 13,328,735.97 | 3.69 |
| 57 | 601933 | 永辉超市 | 13,165,218.58 | 3.64 |
| 58 | 600584 | 长电科技 | 13,148,422.38 | 3.64 |
| 59 | 688088 | 虹软科技 | 13,090,252.26 | 3.62 |
| 60 | 600703 | 三安光电 | 12,956,570.61 | 3.59 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 61 | 002100 | 天康生物 | 12,795,883.11 | 3.54 |
| 62 | 002123 | 梦网集团 | 12,572,515.00 | 3.48 |
| 63 | 300502 | 新易盛  | 12,366,376.00 | 3.42 |
| 64 | 600309 | 万华化学 | 12,242,087.46 | 3.39 |
| 65 | 600588 | 用友网络 | 12,190,168.34 | 3.37 |
| 66 | 601336 | 新华保险 | 11,731,682.56 | 3.25 |
| 67 | 601288 | 农业银行 | 11,371,684.00 | 3.15 |
| 68 | 002709 | 天赐材料 | 11,060,790.50 | 3.06 |
| 69 | 300188 | 美亚柏科 | 10,874,126.01 | 3.01 |
| 70 | 603816 | 顾家家居 | 10,691,614.00 | 2.96 |
| 71 | 000728 | 国元证券 | 10,348,063.87 | 2.86 |
| 72 | 000333 | 美的集团 | 10,240,391.18 | 2.83 |
| 73 | 002690 | 美亚光电 | 10,216,085.96 | 2.83 |
| 74 | 300348 | 长亮科技 | 10,055,044.17 | 2.78 |
| 75 | 002385 | 大北农  | 9,734,025.00  | 2.69 |
| 76 | 603305 | 旭升股份 | 9,676,018.00  | 2.68 |
| 77 | 002925 | 盈趣科技 | 9,655,123.40  | 2.67 |
| 78 | 002236 | 大华股份 | 9,542,840.75  | 2.64 |
| 79 | 300088 | 长信科技 | 9,021,490.00  | 2.50 |
| 80 | 300253 | 卫宁健康 | 8,995,099.96  | 2.49 |
| 81 | 300687 | 赛意信息 | 8,847,865.20  | 2.45 |
| 82 | 300369 | 绿盟科技 | 8,695,956.00  | 2.41 |
| 83 | 603589 | 口子窖  | 8,489,349.00  | 2.35 |
| 84 | 000596 | 古井贡酒 | 8,461,830.00  | 2.34 |
| 85 | 002460 | 赣锋锂业 | 8,324,513.96  | 2.30 |
| 86 | 002456 | 欧菲光  | 8,248,349.51  | 2.28 |
| 87 | 300571 | 平治信息 | 8,195,059.46  | 2.27 |
| 88 | 300223 | 北京君正 | 7,939,940.87  | 2.20 |
| 89 | 600352 | 浙江龙盛 | 7,898,877.00  | 2.19 |
| 90 | 002466 | 天齐锂业 | 7,884,799.15  | 2.18 |
| 91 | 600837 | 海通证券 | 7,725,292.00  | 2.14 |
| 92 | 600975 | 新五丰  | 7,598,994.00  | 2.10 |
| 93 | 600037 | 歌华有线 | 7,538,082.76  | 2.09 |
| 94 | 002407 | 多氟多  | 7,443,559.25  | 2.06 |
| 95 | 300113 | 顺网科技 | 7,247,716.64  | 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。

#### 8.4.2 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<br>(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1  | 300033 | 同花顺  | 59,634,370.16 | 16.51        |
| 2  | 600438 | 通威股份 | 58,718,585.30 | 16.25        |
| 3  | 002157 | 正邦科技 | 54,672,147.43 | 15.13        |
| 4  | 601012 | 隆基股份 | 49,653,108.60 | 13.74        |
| 5  | 002594 | 比亚迪  | 46,499,840.94 | 12.87        |
| 6  | 000858 | 五粮液  | 39,953,664.26 | 11.06        |
| 7  | 601688 | 华泰证券 | 35,266,822.91 | 9.76         |
| 8  | 002714 | 牧原股份 | 33,209,969.57 | 9.19         |
| 9  | 300274 | 阳光电源 | 32,149,824.12 | 8.90         |
| 10 | 002384 | 东山精密 | 31,537,921.10 | 8.73         |
| 11 | 603986 | 兆易创新 | 30,416,719.46 | 8.42         |
| 12 | 300136 | 信维通信 | 29,643,163.32 | 8.21         |
| 13 | 300059 | 东方财富 | 29,278,086.08 | 8.10         |
| 14 | 600570 | 恒生电子 | 28,089,379.60 | 7.78         |
| 15 | 300450 | 先导智能 | 27,407,999.26 | 7.59         |
| 16 | 603501 | 韦尔股份 | 26,407,517.48 | 7.31         |
| 17 | 002234 | 民和股份 | 25,849,728.09 | 7.16         |
| 18 | 002567 | 唐人神  | 25,150,219.45 | 6.96         |
| 19 | 000876 | 新希望  | 24,620,644.42 | 6.82         |
| 20 | 000063 | 中兴通讯 | 24,018,633.81 | 6.65         |
| 21 | 002124 | 天邦股份 | 23,971,249.38 | 6.64         |
| 22 | 000977 | 浪潮信息 | 23,846,128.79 | 6.60         |
| 23 | 002458 | 益生股份 | 23,605,001.55 | 6.53         |
| 24 | 601555 | 东吴证券 | 22,914,198.65 | 6.34         |
| 25 | 002230 | 科大讯飞 | 22,177,953.80 | 6.14         |
| 26 | 002511 | 中顺洁柔 | 21,891,219.78 | 6.06         |
| 27 | 002299 | 圣农发展 | 20,614,810.40 | 5.71         |
| 28 | 601066 | 中信建投 | 20,596,200.88 | 5.70         |
| 29 | 603899 | 晨光文具 | 20,277,044.95 | 5.61         |
| 30 | 000568 | 泸州老窖 | 19,516,073.89 | 5.40         |
| 31 | 300601 | 康泰生物 | 17,911,587.96 | 4.96         |
| 32 | 002821 | 凯莱英  | 17,765,851.83 | 4.92         |
| 33 | 600536 | 中国软件 | 17,509,738.85 | 4.85         |
| 34 | 000651 | 格力电器 | 17,104,432.19 | 4.73         |
| 35 | 603799 | 华友钴业 | 16,737,208.48 | 4.63         |
| 36 | 601166 | 兴业银行 | 15,797,020.81 | 4.37         |
| 37 | 600809 | 山西汾酒 | 15,730,258.92 | 4.35         |
| 38 | 000938 | 紫光股份 | 15,420,562.87 | 4.27         |
| 39 | 600519 | 贵州茅台 | 14,779,688.82 | 4.09         |
| 40 | 603019 | 中科曙光 | 14,248,530.29 | 3.94         |
| 41 | 002371 | 北方华创 | 13,879,534.36 | 3.84         |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 42 | 603305 | 旭升股份 | 13,389,088.61 | 3.71 |
| 43 | 601211 | 国泰君安 | 13,388,346.63 | 3.71 |
| 44 | 300498 | 温氏股份 | 13,228,743.70 | 3.66 |
| 45 | 300073 | 当升科技 | 13,112,729.96 | 3.63 |
| 46 | 601933 | 永辉超市 | 13,046,577.76 | 3.61 |
| 47 | 600958 | 东方证券 | 12,990,002.14 | 3.60 |
| 48 | 002456 | 欧菲光  | 12,982,184.13 | 3.59 |
| 49 | 300357 | 我武生物 | 12,741,439.66 | 3.53 |
| 50 | 002405 | 四维图新 | 12,649,908.24 | 3.50 |
| 51 | 002241 | 歌尔股份 | 12,540,359.50 | 3.47 |
| 52 | 300188 | 美亚柏科 | 12,489,936.57 | 3.46 |
| 53 | 600588 | 用友网络 | 12,314,374.74 | 3.41 |
| 54 | 300502 | 新易盛  | 12,242,485.17 | 3.39 |
| 55 | 002100 | 天康生物 | 12,164,785.79 | 3.37 |
| 56 | 600309 | 万华化学 | 12,123,078.28 | 3.36 |
| 57 | 300348 | 长亮科技 | 11,965,948.80 | 3.31 |
| 58 | 603816 | 顾家家居 | 11,536,852.39 | 3.19 |
| 59 | 002709 | 天赐材料 | 11,524,723.08 | 3.19 |
| 60 | 601288 | 农业银行 | 11,499,189.44 | 3.18 |
| 61 | 601336 | 新华保险 | 11,163,007.45 | 3.09 |
| 62 | 000728 | 国元证券 | 11,036,668.12 | 3.06 |
| 63 | 300750 | 宁德时代 | 10,817,444.74 | 2.99 |
| 64 | 002123 | 梦网集团 | 10,794,312.42 | 2.99 |
| 65 | 300618 | 寒锐钴业 | 10,629,113.36 | 2.94 |
| 66 | 002463 | 沪电股份 | 10,336,535.13 | 2.86 |
| 67 | 000333 | 美的集团 | 10,268,022.88 | 2.84 |
| 68 | 300037 | 新宙邦  | 10,187,336.49 | 2.82 |
| 69 | 002812 | 恩捷股份 | 10,076,332.75 | 2.79 |
| 70 | 002236 | 大华股份 | 9,792,724.16  | 2.71 |
| 71 | 600352 | 浙江龙盛 | 9,594,662.00  | 2.66 |
| 72 | 300687 | 赛意信息 | 9,230,824.79  | 2.56 |
| 73 | 300223 | 北京君正 | 9,013,708.68  | 2.50 |
| 74 | 000596 | 古井贡酒 | 8,891,678.44  | 2.46 |
| 75 | 002466 | 天齐锂业 | 8,717,242.83  | 2.41 |
| 76 | 002925 | 盈趣科技 | 8,622,117.93  | 2.39 |
| 77 | 603589 | 口子窖  | 8,615,906.41  | 2.39 |
| 78 | 300253 | 卫宁健康 | 8,615,773.17  | 2.38 |
| 79 | 300369 | 绿盟科技 | 8,539,393.49  | 2.36 |
| 80 | 002385 | 大北农  | 8,373,814.04  | 2.32 |
| 81 | 603369 | 今世缘  | 8,248,514.63  | 2.28 |
| 82 | 002583 | 海能达  | 8,230,679.90  | 2.28 |
| 83 | 300567 | 精测电子 | 7,995,248.19  | 2.21 |
| 84 | 300347 | 泰格医药 | 7,960,659.95  | 2.20 |
| 85 | 002602 | 世纪华通 | 7,865,882.76  | 2.18 |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 86 | 600031 | 三一重工 | 7,612,102.80 | 2.11 |
| 87 | 300088 | 长信科技 | 7,502,621.41 | 2.08 |
| 88 | 603338 | 浙江鼎力 | 7,377,561.23 | 2.04 |
| 89 | 000066 | 中国长城 | 7,245,328.20 | 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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 2,148,698,104.77 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 2,119,645,926.69 |

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

**8.11.1 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。

**8.12 投资组合报告附注**

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

**8.12.3 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   | 211,654.35   |
| 2  | 应收证券清算款 | 4,233,051.29 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 12,968.93    |
| 5  | 应收申购款   | 1,342,519.86 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 5,800,194.43 |

**8.12.4 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。

**8.12.5 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。

**8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

## 9.1 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<br>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<br>比例 | 持有份额           | 占总份额<br>比例 |
| 19,642   | 13,224.15     | 61,930,819.25 | 23.84%     | 197,817,950.32 | 76.16%     |

## 9.2 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<br>本基金 | 92.32     | 0.0000%  |

## 9.3 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                 |

## §10 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               | 182,988,658.87 |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 193,000,332.03 |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额              | 259,748,769.57 |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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：本基金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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 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情况。报告年度应支付给聘任普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 60,000 元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 11 年。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 |    |
| 中金财富证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国盛证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 平安证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 招商证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 川财证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|      |   |                  |        |              |        |   |
|------|---|------------------|--------|--------------|--------|---|
| 西南证券 | 1 | 2,746,657,710.63 | 64.73% | 2,557,963.05 | 64.73% | - |
| 华泰证券 | 1 | 1,042,807,602.80 | 24.57% | 971,161.05   | 24.57% | - |
| 国信证券 | 1 | 453,902,790.18   | 10.70% | 422,712.13   | 10.70% | - |

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. 本基金本年度无新增席位，无注销席位。

### 11.7.2 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<br>比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的<br>比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的<br>比例 |
| 中金财富证券 | -          | -                | -    | -                | -    | -                |
| 国盛证券   | -          | -                | -    | -                | -    | -                |
| 平安证券   | -          | -                | -    | -                | -    | -                |
| 招商证券   | -          | -                | -    | -                | -    | -                |
| 川财证券   | -          | -                | -    | -                | -    | -                |
| 西南证券   | 42,731.30  | 8.09%            | -    | -                | -    | -                |
| 华泰证券   | 485,688.20 | 91.91%           | -    | -                | -    | -                |
| 国信证券   | -          | -                | -    | -                | -    | -                |

**11.8 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 |

**12 影响投资者决策的其他重要信息****12.1 影响投资者决策的其他重要信息**

无。

**§13 备查文件目录****13.1 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。

**13.2 存放地点**

基金管理人或基金托管人处。

**13.3 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

二〇二〇年四月二十七日