

上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金
2017 年年度报告摘要
2017 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：二〇一八年三月二十九日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2018 年 3 月 28 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	上投摩根大盘蓝筹股票
基金主代码	376510
交易代码	376510
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 20 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	228,804,896.90 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资大盘蓝筹股票，力争最大程度的分享中国经济持续发展带来的中长期收益。在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
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，“自下而上”的精选个股，重点投资于在行业内占有领先地位、业绩良好且稳定增长、价值相对低估的大盘蓝筹上市公司。同时结合宏观经济运行状况和金融市场运行分析趋势的市场研判，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：沪深 300 指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金属于股票型基金产品，在开放式基金中，其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于风险水平较高的基金产品。 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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cifm.com
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

§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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	59,847,204.70	-34,477,311.01	125,261,546.70
本期利润	95,735,991.76	-39,661,185.74	81,104,856.39
加权平均基金份额本期利润	0.5235	-0.2893	0.4169
本期基金份额净值增长率	43.22%	-18.08%	27.82%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.8494	0.2912	0.5759
期末基金资产净值	423,141,848.44	159,750,253.52	226,235,029.51
期末基金份额净值	1.849	1.291	1.576

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
过去三个月	7.63%	1.29%	4.32%	0.68%	3.31%	0.61%
过去六个月	13.51%	1.10%	8.48%	0.59%	5.03%	0.51%
过去一年	43.22%	1.05%	18.61%	0.54%	24.61%	0.51%
过去三年	49.96%	1.84%	13.52%	1.43%	36.44%	0.41%
过去五年	128.55%	1.66%	53.57%	1.31%	74.98%	0.35%
自基金合同生效起至今	84.90%	1.52%	25.32%	1.25%	59.58%	0.27%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%

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

上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金

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

(2010 年 12 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日)



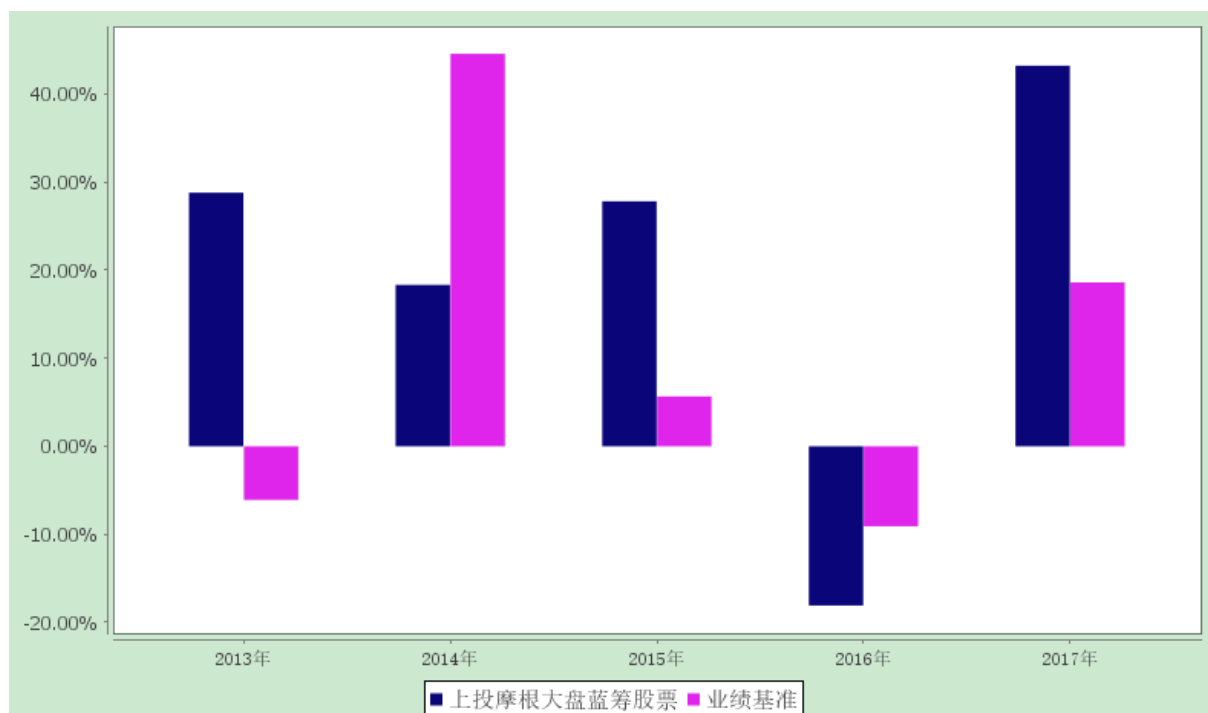
注：本基金建仓期自 2010 年 12 月 20 日至 2011 年 6 月 19 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金合同生效日为 2010 年 12 月 20 日，图示时间段为 2010 年 12 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日。

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

上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金

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 2010 年 12 月 20 日正式成立，图示的时间段为 2012 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年来未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007 年 10 月 8 日更名为“上海国际信托有限公司”）与摩根资产管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。截至 2017 年 12 月底，公司管理的基金共有六十只，均为开放式基金，分别是：上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场

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

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		
征茂平	本基金基金经理	2013-07-22	-	17 年	征茂平先生自 2001 年 3 月至 2004 年 3 月在上海证大投资管理有限公司任高级研究员从事证券研究的工作；2004 年 3 月至 2005 年 4 月在平安证券有限公司任高级研究员从事证券研究的工作；2005 年 5 月至 2008 年 5 月在大成基金管理有限公司任研究员从事成长股票组合的管理工作；2008 年 5 月起加入上投摩根基金管理有限公司，担任行业专家兼基金经理助理，自 2013 年 7 月起担任上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金基金经理，自 2013 年 9 月起同时担任上投摩根红利回报混合型证券投资基金基金经理，2014 年 1 月至 2015 年 2 月担任上投摩根阿尔法混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 9 月起同时担任上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 11 月起同时担任上投摩根中国世纪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、《上投摩根大盘蓝筹股票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% 的次数为四次，均发生在量化投资组合与主动管理投资组合之间。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年 A 股市场风格分化明显：优质白马蓝筹股股价屡创新高，全年涨幅巨大，并带动沪深 300 指数全年涨幅超过 20%；与此相反，估值较高的中小创大部分个股全年基本以震荡调整为主，创业板指数年度下跌幅度超过 10%。

A 股市场分化的背后原因较多，行业盈利好转和估值回归是主要因素：随着消费升级和经济转型，大消费和大金融板块盈利趋于好转，而高估值的中小创个股估值出现回归。

2017 年初本基金判断在去杠杆、防风险的大背景下，全年 A 股市场的风险偏好难以回升，坚持以绝对收益的策略来应对市场的不确定性，重点增持白酒、家电、医药、消费电子等行业内盈利增长持续性较强个股，适当回避受政策调控负面影响较大的地产以及估值较高的创业板上市公司；从投资结果看，本基金组合重仓持有的大消费板块和盈利确定性较高的白马成长股全年涨幅较高，因此组合净值全年表现较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为 43.22%，同期业绩比较基准收益率为 18.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基于国内基建投资继续维持较高水平、全球经济复苏趋势明显，我们对 2018 年国内经济并不悲观；流动性总体维持中性偏紧的格局不会变，但 2017 年的 A 股市场的赚钱效应、去杠杆和严监管背景下银行等金融机构资产结构调整等因素将改变证券市场过往的存量博弈格局，2018 年 A 股市场全年的流动性好于预期的概率较大；从投资标的看，白马成长股的估值修复在 2017 年大多已完成，后续将是基于盈利增长获取超额收益；另一方面，市场结构分化格局仍将持续，估值较低或盈利确定性较高的行业将是首选配置品种，将重点关注盈利匹配较好的家电、食品饮料、大金融等基本面持续好转、有估值优势的相关板块与标的。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券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

报告期内，本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本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

上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金 2017 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计、注册会计师薛竞、沈兆杰签字出具了“无保留意见的审计报告”(编号：普华永道中天审字(2018)第 21917 号)。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	59,987,920.42	8,602,652.12
结算备付金		2,549,842.47	1,217,395.96
存出保证金		246,576.98	152,552.93
交易性金融资产	7.4.7.2	397,171,803.70	150,670,121.26
其中：股票投资		397,171,803.70	145,670,121.26
基金投资		-	-
债券投资		-	5,000,000.00
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		-	235,906.00
应收利息	7.4.7.5	11,912.65	117,843.67
应收股利		-	-
应收申购款		3,094,227.79	82,440.42

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		463,062,284.01	161,078,912.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
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		35,881,569.45	-
应付赎回款		2,129,752.14	180,532.68
应付管理人报酬		521,584.73	208,620.53
应付托管费		86,930.76	34,770.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,152,968.57	724,606.19
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	147,629.92	180,129.32
负债合计		39,920,435.57	1,328,658.84
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.9	228,804,896.90	123,722,789.57
未分配利润	7.4.7.10	194,336,951.54	36,027,463.95
所有者权益合计		423,141,848.44	159,750,253.52
负债和所有者权益总计		463,062,284.01	161,078,912.36

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.849 元，基金份额总额 228,804,896.90 份。

7.2 利润表

会计主体：上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 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
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		106,970,636.30	-30,571,609.31
1.利息收入		276,467.33	243,596.72
其中：存款利息收入	7.4.7.11	274,560.48	125,960.01
债券利息收入		1,906.85	117,636.71
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）		70,364,869.93	-25,694,496.69
其中：股票投资收益	7.4.7.12	68,654,067.67	-26,533,376.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,500.00	-301,756.48
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	1,708,302.26	1,140,636.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	35,888,787.06	-5,183,874.73
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	440,511.98	63,165.39
减：二、费用		11,234,644.54	9,089,576.43
1. 管理人报酬		4,415,449.41	2,680,087.42
2. 托管费		735,908.19	446,681.29

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	5,913,663.34	5,748,187.97
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	169,623.60	214,619.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		95,735,991.76	-39,661,185.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		95,735,991.76	-39,661,185.74

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	123,722,789.57	36,027,463.95	159,750,253.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	95,735,991.76	95,735,991.76
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）	105,082,107.33	62,573,495.83	167,655,603.16
其中：1.基金申购款	331,173,633.35	215,748,038.84	546,921,672.19
2.基金赎回款	-226,091,526.02	-153,174,543.01	-379,266,069.03
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）	228,804,896.90	194,336,951.54	423,141,848.44
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	143,560,943.85	82,674,085.66	226,235,029.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-39,661,185.74	-39,661,185.74
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）	-19,838,154.28	-6,985,435.97	-26,823,590.25
其中：1.基金申购款	30,339,600.46	8,307,198.72	38,646,799.18
2.基金赎回款	-50,177,754.74	-15,292,634.69	-65,470,389.43
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）	123,722,789.57	36,027,463.95	159,750,253.52

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：章硕麟，主管会计工作负责人：胡志强，会计机构负责人：张璐

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上投摩根大盘蓝筹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”)证监基金字[2010]1245 号《关于核准上投摩根大盘蓝筹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《上投摩根大盘蓝筹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人民币 1,190,182,910.59 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(2010)第 408 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 12 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,190,330,307.52 份基金份额,其中认购资金利息折合 147,396.93 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《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根大盘蓝筹股票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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中:股票类资产占基金资产的比例为 80%-95%,其中投资于大盘蓝筹股票的比例不低于股票类资产的 80%,债券类资产投资比例为基金资产的 0-20%,权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%,现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 85%+上证国债指数收益率 \times 15%。

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 2018 年 3 月 28 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》、《上投摩根大盘蓝筹股票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 2017 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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

7.4.4.1 本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

7.4.4.2 本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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)》，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，本基金自 2017 年 12 月 25 日起改为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。该估值技术变更对本基金无影响。

除以上会计估计变更外，本基金本报告期所采用的其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

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)》，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，本基金自 2017 年 12 月 25 日起改为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。该估值技术变更对本基金无影响。

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

7.4.7 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：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据浦发银行于 2016 年 3 月 16 日发布的《上海浦东发展银行股份有限公司关于发行股份购买资产暨关联交易之标的资产过户完成的公告》，浦发银行发行股份购买资产暨关联交易事项已经中国证监会证监许可[2015]2677 号《关于核准上海浦东发展银行股份有限公司向上海国际集团有限公司等发行股份购买资产的批复》核准。于 2016 年 3 月 15 日，上海信托已完成了相关工商变更登记手续，成为浦发银行的控股子公司。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,415,449.41	2,680,087.42
其中：支付销售机构的客户维护费	1,375,905.31	893,555.65

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	735,908.19	446,681.29

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31 日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31 日
期初持有的基金份额	1,280,852.54	1,280,852.54
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	1,280,852.54	1,280,852.54
期末持有的基金份额占基金总 份额比例	0.56%	1.04%

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016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	59,987,920.42	242,283.72	8,602,652.12	95,491.45

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	17.01	17.01	954.00	16,227.54	16,227.54	-
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	8.88	8.88	3,640.00	32,323.20	32,323.20	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股未上市	13.60	13.60	1,187.00	16,143.20	16,143.20	-

603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	16.75	16.75	1,239.00	20,753.25	20,753.25	-
--------	------	------------	------------	-------	-------	-------	----------	-----------	-----------	---

注：基金可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项	35.26	2018-01-02	38.79	821.00	10,311.76	28,948.46	-
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项	41.55	2018-01-02	45.71	821.00	6,863.56	34,112.55	-

注：本基金截至 2017 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 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 2017 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 397,023,295.50 元, 属于第二层次的余额为 148,508.20 元, 无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日: 第一层次 129,834,034.58 元, 第二层次 20,836,086.68 元, 无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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 2017 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(2016 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定, 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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定, 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外, 财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	397,171,803.70	85.77
	其中：股票	397,171,803.70	85.77
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	62,537,762.89	13.51
7	其他各项资产	3,352,717.42	0.72
8	合计	463,062,284.01	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	263,931,331.99	62.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.01
J	金融业	133,139,950.00	31.46
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.01
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	397,171,803.70	93.86

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002456	欧菲科技	1,904,553	39,214,746.27	9.27
2	000568	泸州老窖	585,351	38,633,166.00	9.13
3	300136	信维通信	753,080	38,181,156.00	9.02
4	000333	美的集团	473,817	26,263,676.31	6.21
5	600887	伊利股份	803,100	25,851,789.00	6.11
6	600036	招商银行	887,000	25,740,740.00	6.08
7	601398	工商银行	4,112,820	25,499,484.00	6.03
8	600519	贵州茅台	36,505	25,461,872.45	6.02
9	601318	中国平安	334,100	23,380,318.00	5.53
10	000858	五粮液	262,709	20,985,194.92	4.96

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

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	601398	工商银行	91,269,585.80	57.13
2	600036	招商银行	87,830,926.36	54.98
3	000333	美的集团	72,451,084.48	45.35
4	000568	泸州老窖	69,829,389.49	43.71
5	601318	中国平安	69,422,514.92	43.46
6	000858	五粮液	58,291,925.43	36.49
7	600519	贵州茅台	56,937,277.64	35.64
8	000651	格力电器	56,461,555.93	35.34
9	600703	三安光电	53,406,308.66	33.43
10	002142	宁波银行	53,228,796.34	33.32
11	601688	华泰证券	45,243,420.18	28.32
12	300136	信维通信	45,206,463.78	28.30
13	002241	歌尔股份	43,377,367.39	27.15
14	601288	农业银行	42,922,669.00	26.87
15	002035	华帝股份	42,406,074.31	26.55
16	300115	长盈精密	41,991,145.04	26.29
17	002236	大华股份	35,294,331.00	22.09
18	603799	华友钴业	34,618,339.88	21.67
19	601668	中国建筑	32,957,656.23	20.63
20	600406	国电南瑞	31,942,264.21	20.00
21	002456	欧菲科技	30,332,354.10	18.99
22	300145	中金环境	29,994,889.04	18.78
23	002466	天齐锂业	27,480,250.86	17.20
24	600887	伊利股份	26,788,824.19	16.77
25	000069	华侨城 A	25,765,378.16	16.13
26	002508	老板电器	25,553,418.16	16.00
27	601933	永辉超市	25,413,773.00	15.91
28	002572	索菲亚	24,407,742.75	15.28
29	002460	赣锋锂业	23,745,257.97	14.86
30	002475	立讯精密	22,291,227.76	13.95
31	601628	中国人寿	22,223,200.30	13.91

32	600804	鹏博士	21,920,207.73	13.72
33	002635	安洁科技	21,048,227.43	13.18
34	002008	大族激光	20,816,318.03	13.03
35	600104	上汽集团	19,693,540.35	12.33
36	600019	宝钢股份	18,489,196.63	11.57
37	600030	中信证券	18,487,678.06	11.57
38	601009	南京银行	18,111,328.50	11.34
39	000728	国元证券	17,646,878.21	11.05
40	002497	雅化集团	17,159,760.91	10.74
41	601336	新华保险	15,869,497.45	9.93
42	002050	三花智控	15,799,914.60	9.89
43	603589	口子窖	15,552,262.94	9.74
44	300450	先导智能	15,001,821.00	9.39
45	600068	葛洲坝	14,893,800.87	9.32
46	600050	中国联通	12,825,425.00	8.03
47	600110	诺德股份	12,824,392.00	8.03
48	601601	中国太保	12,411,528.00	7.77
49	000001	平安银行	12,291,940.00	7.69
50	300296	利亚德	11,564,747.92	7.24
51	600779	水井坊	11,313,080.60	7.08
52	002310	东方园林	10,451,844.97	6.54
53	000049	德赛电池	10,226,418.00	6.40
54	603626	科森科技	9,776,598.30	6.12
55	601800	中国交建	9,651,035.55	6.04
56	002332	仙琚制药	9,566,510.36	5.99
57	002640	跨境通	9,342,894.09	5.85
58	603833	欧派家居	8,871,727.44	5.55
59	601888	中国国旅	8,832,493.66	5.53
60	002709	天赐材料	8,713,080.10	5.45
61	600276	恒瑞医药	8,551,582.21	5.35
62	000538	云南白药	8,519,079.00	5.33
63	601988	中国银行	8,465,062.00	5.30
64	002589	瑞康医药	8,441,635.87	5.28
65	300059	东方财富	8,335,053.04	5.22
66	002292	奥飞娱乐	8,283,006.22	5.18
67	000776	广发证券	7,938,196.00	4.97
68	002341	新纶科技	7,696,878.00	4.82
69	002138	顺络电子	7,624,952.10	4.77
70	600038	中直股份	7,506,720.40	4.70
71	000898	鞍钢股份	7,125,954.87	4.46
72	600196	复星医药	6,908,722.06	4.32
73	300340	科恒股份	6,877,602.00	4.31
74	002384	东山精密	6,774,604.00	4.24
75	300319	麦捷科技	6,597,767.00	4.13

76	601169	北京银行	6,569,153.00	4.11
77	002396	星网锐捷	6,419,458.65	4.02
78	600056	中国医药	5,940,199.34	3.72
79	600340	华夏幸福	5,862,369.00	3.67
80	600188	兖州煤业	5,583,476.20	3.50
81	000998	隆平高科	5,475,390.72	3.43
82	002450	康得新	5,108,878.18	3.20
83	002045	国光电器	5,103,629.01	3.19
84	002407	多氟多	5,013,061.00	3.14
85	000709	河钢股份	4,867,325.00	3.05
86	600183	生益科技	4,763,362.79	2.98
87	600562	国睿科技	4,636,069.20	2.90
88	002583	海能达	4,214,291.44	2.64
89	002517	恺英网络	4,004,208.00	2.51
90	600809	山西汾酒	3,944,291.00	2.47
91	002436	兴森科技	3,298,349.68	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。

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 (%)
1	600036	招商银行	66,287,936.12	41.49
2	601398	工商银行	66,234,313.87	41.46
3	000651	格力电器	62,261,928.17	38.97
4	000333	美的集团	56,665,654.43	35.47
5	000858	五粮液	53,285,517.49	33.36
6	601688	华泰证券	49,361,704.20	30.90
7	600519	贵州茅台	47,400,103.43	29.67
8	300115	长盈精密	44,624,249.89	27.93
9	601318	中国平安	44,621,456.97	27.93
10	002241	歌尔股份	44,484,839.50	27.85
11	601288	农业银行	43,173,762.00	27.03
12	000568	泸州老窖	42,051,304.23	26.32
13	002142	宁波银行	41,124,092.98	25.74
14	600703	三安光电	37,925,841.56	23.74
15	300145	中金环境	35,572,348.07	22.27
16	601933	永辉超市	35,484,448.18	22.21

17	002236	大华股份	35,352,069.52	22.13
18	002466	天齐锂业	33,378,032.46	20.89
19	601668	中国建筑	32,476,838.42	20.33
20	002035	华帝股份	31,878,570.75	19.96
21	600406	国电南瑞	31,579,243.98	19.77
22	603799	华友钴业	31,385,678.52	19.65
23	002475	立讯精密	29,077,422.59	18.20
24	002508	老板电器	26,964,482.37	16.88
25	002008	大族激光	26,353,918.46	16.50
26	000069	华侨城 A	25,159,779.16	15.75
27	300136	信维通信	24,683,565.08	15.45
28	002460	赣锋锂业	24,652,126.58	15.43
29	002635	安洁科技	24,182,082.55	15.14
30	002572	索菲亚	23,434,609.02	14.67
31	600804	鹏博士	22,084,167.21	13.82
32	601628	中国人寿	21,274,614.00	13.32
33	300296	利亚德	20,464,702.21	12.81
34	600104	上汽集团	20,253,088.38	12.68
35	002589	瑞康医药	20,110,272.91	12.59
36	600019	宝钢股份	19,107,908.24	11.96
37	600030	中信证券	18,773,069.66	11.75
38	000728	国元证券	17,576,470.06	11.00
39	601009	南京银行	17,065,913.59	10.68
40	600276	恒瑞医药	16,513,416.17	10.34
41	002497	雅化集团	16,238,239.41	10.16
42	603589	口子窖	15,112,267.29	9.46
43	600068	葛洲坝	14,751,719.03	9.23
44	300450	先导智能	14,351,740.68	8.98
45	600110	诺德股份	13,142,986.00	8.23
46	600050	中国联通	12,944,850.00	8.10
47	002456	欧菲科技	12,572,863.54	7.87
48	600779	水井坊	11,966,599.28	7.49
49	002050	三花智控	11,903,952.60	7.45
50	002332	仙琚制药	10,962,437.88	6.86
51	002640	跨境通	10,762,206.36	6.74
52	601888	中国国旅	10,245,205.63	6.41
53	000049	德赛电池	10,015,574.00	6.27
54	603626	科森科技	9,770,170.79	6.12
55	002310	东方园林	9,566,372.63	5.99
56	601800	中国交建	9,389,656.28	5.88
57	600038	中直股份	9,086,696.89	5.69
58	603833	欧派家居	8,892,345.44	5.57
59	300319	麦捷科技	8,832,910.94	5.53
60	601166	兴业银行	8,610,089.86	5.39

61	600056	中国医药	8,588,238.52	5.38
62	002709	天赐材料	8,447,991.45	5.29
63	002341	新纶科技	8,337,914.60	5.22
64	002292	奥飞娱乐	8,315,718.76	5.21
65	300059	东方财富	8,209,090.92	5.14
66	600340	华夏幸福	8,137,332.94	5.09
67	002462	嘉事堂	7,993,403.11	5.00
68	000776	广发证券	7,894,696.98	4.94
69	002384	东山精密	7,420,874.52	4.65
70	002138	顺络电子	7,416,116.94	4.64
71	000898	鞍钢股份	7,146,956.00	4.47
72	002396	星网锐捷	6,808,076.22	4.26
73	600196	复星医药	6,731,341.20	4.21
74	300340	科恒股份	6,465,991.17	4.05
75	601169	北京银行	6,400,709.12	4.01
76	600188	兖州煤业	5,564,243.18	3.48
77	000998	隆平高科	5,400,871.04	3.38
78	002450	康得新	5,021,311.42	3.14
79	000709	河钢股份	4,951,793.00	3.10
80	002045	国光电器	4,942,574.00	3.09
81	002407	多氟多	4,878,333.74	3.05
82	600562	国睿科技	4,712,656.93	2.95
83	600183	生益科技	4,676,032.88	2.93
84	002517	恺英网络	4,335,091.83	2.71
85	600643	爱建集团	4,178,087.36	2.62
86	002583	海能达	4,138,407.00	2.59
87	601336	新华保险	3,985,237.50	2.49
88	000980	众泰汽车	3,893,336.71	2.44
89	600809	山西汾酒	3,836,527.00	2.40
90	601377	兴业证券	3,414,447.12	2.14
91	600497	驰宏锌锗	3,232,660.00	2.02

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

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	2,044,437,868.57
卖出股票的收入（成交）总额	1,897,481,540.86

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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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	246,576.98
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	11,912.65
5	应收申购款	3,094,227.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,352,717.42

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

因四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

§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 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
17,563	13,027.67	25,617,935.15	11.20%	203,186,961.75	88.80%

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	280,128.85	0.1224%

本基金		
-----	--	--

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 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(2010年12月20日)基金份额总额	1,190,330,307.52
本报告期期初基金份额总额	123,722,789.57
本报告期基金总申购份额	331,173,633.35
减：本报告期基金总赎回份额	226,091,526.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	228,804,896.90

§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：

- 1、 本公司于 2017 年 7 月 15 日发布公告：因个人原因，穆矢先生自 2017 年 7 月 13 日起不再担任本公司董事长。
- 2、 本公司于 2017 年 7 月 29 日发布公告：章硕麟先生自 2017 年 7 月 28 日起代任本公司董事长。
- 3、 本公司于 2017 年 9 月 23 日发布公告：因个人原因，刘万方先生自 2017 年 9 月 21 日起不再担任本公司督察长；邹树波先生自 2017 年 9 月 21 日起担任本公司督察长。
- 4、 本公司于 2017 年 11 月 11 日发布公告：自 2017 年 11 月 9 日起，陈兵先生担任本公司董事长，章硕麟先生不再代任本公司董事长。

基金托管人:2017 年 9 月 1 日,中国建设银行发布公告,聘任纪伟为中国建设银行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 7 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	
广发证券	1	787,595,585.98	20.00%	733,491.77	20.00%	-
海通证券	1	426,791,179.28	10.84%	397,470.60	10.84%	-
华创证券	1	307,710,321.45	7.82%	286,569.10	7.82%	-
华泰证券	1	41,154,880.34	1.05%	38,327.76	1.05%	-
平安证券	2	-	0.00%	0.00	0.00%	-
上海证券	1	70,768,623.87	1.80%	65,906.59	1.80%	-
天风证券	1	1,591,464,976.41	40.42%	1,482,132.38	40.42%	-
招商证券	1	151,722,708.86	3.85%	141,299.10	3.85%	-
中泰证券	2	560,181,011.79	14.23%	521,696.73	14.23%	-

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. 2017年度本基金新增平安证券2个席位、中泰证券1个席位,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 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
广发证券	0.00	-	0.00	-	0.00	0.00%
海通证券	0.00	-	0.00	-	0.00	0.00%
华创证券	0.00	-	0.00	-	0.00	0.00%
华泰证券	0.00	-	0.00	-	0.00	0.00%
平安证券	0.00	-	0.00	-	0.00	0.00%
上海证券	0.00	-	0.00	-	0.00	0.00%
天风证券	0.00	-	0.00	-	0.00	0.00%
招商证券	0.00	-	0.00	-	0.00	0.00%
中泰证券	0.00	-	0.00	-	0.00	0.00%

上投摩根基金管理有限公司

二〇一八年三月二十九日