

上投摩根安全战略股票型证券投资基金
2017 年半年度报告摘要
2017 年 6 月 30 日

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十八日

1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

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

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	上投摩根安全战略股票
基金主代码	001009
交易代码	001009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 26 日
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,070,868,103.60 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过系统和深入的基本面研究，重点投资于与安全战略相关行业的上市公司，分享中国经济增长模式转变带来的投资机会，在控制风险的前提下力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	<p>本基金将通过系统和深入的基本面研究，重点投资于与国家安全战略相关行业的上市公司，分享中国经济增长模式转变带来的投资机会。本基金将不低于 80% 的非现金基金资产投资于国家安全战略相关行业。</p> <p>在行业配置层面，本基金将从行业生命周期、行业景气度、行业竞争格局等多角度，综合评估各个行业的投资价值，对基金资产在行业间分配进行安排。</p> <p>在个股选择层面，本基金将主要采用“自下而上”的方法，在备选行业内部通过定量与定性相结合的分析方法，综合分析上市公司的业绩质量、成长性和估值水平等各方面信息，精选具有良好成长性、估值合理的个股。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*85%+中债总指数收益率*15%
风险收益特征	本基金属于股票型基金产品，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，属于较高风险收益水平的基金产品。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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡迪
	联系电话	021-38794888
	电子邮箱	services@cifm.com
客户服务电话	400-889-4888	95566
传真	021-20628400	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cifm.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	27,720,059.30
本期利润	100,188,069.47
加权平均基金份额本期利润	0.0897
本期基金份额净值增长率	10.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2023
期末基金资产净值	1,038,649,685.65
期末基金份额净值	0.970

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

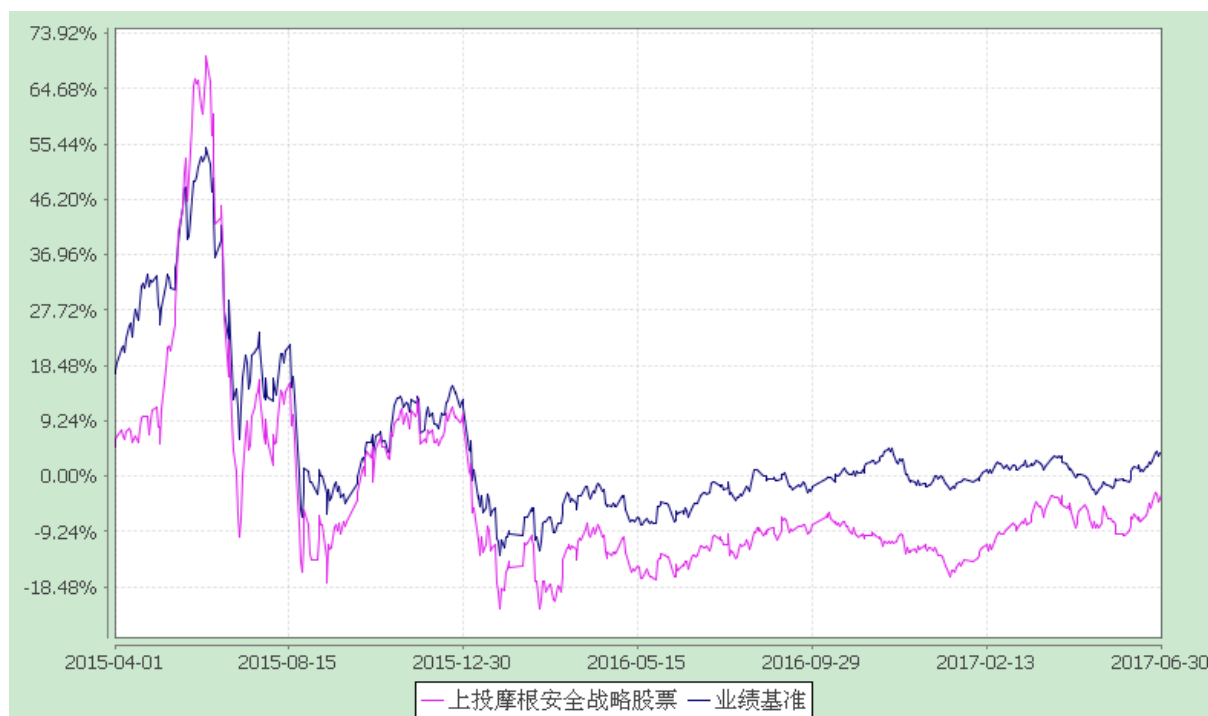
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	7.18%	0.85%	4.46%	0.54%	2.72%	0.31%
过去三个月	2.65%	1.04%	2.46%	0.56%	0.19%	0.48%
过去六个月	10.23%	0.91%	5.53%	0.52%	4.70%	0.39%
过去一年	12.01%	0.89%	9.10%	0.59%	2.91%	0.30%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-3.00%	2.13%	3.99%	1.59%	-6.99%	0.54%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×85%+中债总指数收益率×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

上投摩根安全战略股票型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2015年2月26日至2017年6月30日)



注：本基金合同生效日为2015年2月26日，图示时间段为2015年2月26日至2017年6月30日。

本基金建仓期自2015年2月26日至2015年8月25日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

场基金、上投摩根阿尔法混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋混合型证券投资基金、上投摩根内需动力混合型证券投资基金、上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘混合型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金、上投摩根分红添利债券型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选混合型证券投资基金、上投摩根轮动添利债券型证券投资基金、上投摩根智选30混合型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金、上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金、上投摩根红利回报混合型证券投资基金、上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根优信增利债券型证券投资基金、上投摩根现金管理货币市场基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添盈货币市场基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根纯债添利债券型证券投资基金、上投摩根稳进回报混合型证券投资基金、上投摩根安全战略股票型证券投资基金、上投摩根卓越制造股票型证券投资基金、上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置证券投资基金、上投摩根智慧互联股票型证券投资基金、上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根新兴服务股票型证券投资基金、上投摩根医疗健康股票型证券投资基金、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根策略精选灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金、上投摩根岁岁丰定期开放债券型证券投资基金、上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、上投摩根全球多元配置证券投资基金(QDII)、上投摩根安丰回报混合型证券投资基金、上投摩根安泽回报混合型证券投资基金、上投摩根安瑞回报混合型证券投资基金、上投摩根岁岁金定期开放债券型证券投资基金、上投摩根安通回报混合型证券投资基金。4.1.2

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈思郁	本基金基金经理	2016-10-21	-	9年	陈思郁女士自2008年5月至2009年8月在国泰君安研究所担任研究员，自2009年9月起加入上投摩根基金管理有限公司，历任行业

					专家、基金经理助理，现任国内权益投资一部基金经理，自 2015 年 8 月起担任上投摩根双核平衡混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 10 月起同时担任上投摩根安全战略股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：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。

3.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、《上投摩根安全战略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 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，未发现存在异常交易行为。所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形：报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超

过该证券当日成交量的 5% 的次数为两次，均发生在量化投资组合与主动管理投资组合之间。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

尽管本轮经济如我们之前预期的韧性较强，并没有出现超预期回调，但在流动性明显收紧，市场情绪较差的情况下，二季度市场经历了一轮较为明显的下跌，本基金在 4、5 月也出现了盈利回吐的情况。进入六月，市场情绪好转，央行加大了流动性管理，市场情绪恢复，主板估值稳步回升，中小创业板估值已经回到 12 年初的水平，我们认为自下而上选择高景气行业的龙头公司，仍会有不错盈利。

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 10.23%，同期业绩比较基准收益率为 5.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济增速下行，金融去杠杆坚定进行，流动性中性偏紧，是我们对于未来的判断，经济层面我们依然认为韧性会超出市场预期，会逐季温和向下；国际或者人民币汇率方面，随着美国加息进入后半段，对于加息预期的钝化，以及今年到目前为止，我们实际利率的抬升情况来看，我们认为未来半年这些因素都不会对市场带来负面影响；尽管六月的流动性出现回暖，但我们认为去杠杆的政策依然会坚定进行，稳健中性的货币政策应该是未来的主基调，因此我们认为未来是震荡市，结构性行情可以期待。我们会沿着估值、增速的角度，选择高性价比、高景气度的行业龙头进行投资，同时我们认为未来经济相对稳定，金融去杠杆的大背景下，龙头的规模、资金优势都会更加明显。电子行业增速较快，估值处于较低水平，中长期依然是较好的投资方向，苹果 8 有望给消费电子产业链公司带来明显的业绩增量；同时随着消费对于 GDP 贡献的逐步加强，国民经济和收入均达到一定水平，我们依然会重点挖掘消费行业里面的投资机会；新能源汽车也会是未来一个非常值得跟踪、研究并投资的领域，政策退出后真实需求浮出水面，车企不断推出更多新能源新款车型，尤其是特斯拉的 M3，有可能带动全球新能源乘用车的需求增长，国内的新能源汽车产业链逐步完善，龙头公司具备在这个细分高景气赛道快速增长的能力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了

估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员，参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在安全战略股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上投摩根安全战略股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	79,184,467.79	161,079,378.29
结算备付金		20,411,831.85	12,417,546.37
存出保证金		300,869.16	185,514.27
交易性金融资产	6.4.7.2	862,823,408.81	843,675,755.28
其中：股票投资		862,528,705.31	843,675,755.28
基金投资		-	-
债券投资		294,703.50	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	90,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	-10,423.84	40,212.50
应收股利		-	-
应收申购款		21,124.72	341,127.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,052,731,278.49	1,017,739,534.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		9,727,056.65	-
应付赎回款		1,242,437.65	747,025.85
应付管理人报酬		1,246,401.78	1,302,760.41
应付托管费		207,733.60	217,126.73
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,477,100.98	1,080,755.84
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	180,862.18	421,952.06
负债合计		14,081,592.84	3,769,620.89
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,070,868,103.60	1,152,429,866.52
未分配利润	6.4.7.10	-32,218,417.95	-138,459,952.81
所有者权益合计		1,038,649,685.65	1,013,969,913.71
负债和所有者权益总计		1,052,731,278.49	1,017,739,534.60

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.970 元，基金份额总额 1,070,868,103.60 份。

6.2 利润表

会计主体：上投摩根安全战略股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		114,065,493.70	-271,662,927.69
1.利息收入		1,017,505.17	901,177.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	593,520.57	560,953.13
债券利息收入		81.04	340,224.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		423,903.56	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		40,483,937.82	-155,284,945.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	36,589,075.26	-157,496,922.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-1,187,197.05
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	3,894,862.56	3,399,173.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	72,468,010.17	-117,477,631.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	96,040.54	198,471.96
减：二、费用		13,877,424.23	12,366,240.52
1. 管理人报酬		7,581,881.43	8,299,064.79
2. 托管费		1,263,646.85	1,383,177.50

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	4,832,888.10	2,462,321.80
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	199,007.85	221,676.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		100,188,069.47	-284,029,168.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		100,188,069.47	-284,029,168.21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根安全战略股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	一、期初所有者权益（基金净值）	1,152,429,866.52	-138,459,952.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	100,188,069.47	100,188,069.47
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）	-81,561,762.92	6,053,465.39	-75,508,297.53
其中：1.基金申购款	17,499,158.46	-1,404,995.07	16,094,163.39
2.基金赎回款	-99,060,921.38	7,458,460.46	-91,602,460.92
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）	1,070,868,103.60	-32,218,417.95	1,038,649,685.65
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	一、期初所有者权益（基金净值）	1,271,574,583.00	114,651,594.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-284,029,168.21	-284,029,168.21
三、本期基金份额交易产	-8,803,739.25	792,464.74	-8,011,274.51

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	82,815,762.02	-10,207,940.71	72,607,821.31
2.基金赎回款	-91,619,501.27	11,000,405.45	-80,619,095.82
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）	1,262,770,843.75	-168,585,108.60	1,094,185,735.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：章硕麟，主管会计工作负责人：胡志强，会计机构负责人：张璐

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上投摩根安全战略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[2015]第 3 号《关于核准上投摩根安全战略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《上投摩根安全战略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 3,419,857,678.96 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 154 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根安全战略股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,420,650,236.61 份基金份额，其中认购资金利息折合 792,557.65 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《上投摩根安全战略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、股指期货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(须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%-95%，投资于安全战略相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；其余资产投资于债券、货币市场工具、权证、资产支持证券等金融工具；权证占基金资产净值的 0-3%；每个交易

日日终在扣除股指期货保证金后, 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: 中证 800 指数收益率×85%+中债总指数收益率×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 2017 年 8 月 25 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政

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

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

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

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

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

6.4.7 关联方关系

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

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

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易**

无。

6.4.8.2 关联方报酬**6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,581,881.43	8,299,064.79
其中：支付销售机构的客户维护费	3,261,822.22	3,713,071.84

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,263,646.85	1,383,177.50

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	79,184,467.79	525,285.84	167,555,217.05	510,646.63

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	网下中签	18.02	18.02	1,313.00	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	网下中签	6.20	6.20	2,966.00	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	网下中签	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	网下中签	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	-

603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	网下中签	11.26	11.26	1,351.00	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	9.63	9.63	999.00	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	网下中签	8.93	8.93	832.00	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	网下中签	20.20	20.20	857.00	17,311.40	17,311.40	-

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

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300145	中金环境	2017-06-28	重大事项	16.92	-	-	1,669,526.00	20,482,321.83	28,248,379.92	-
600277	亿利洁能	2017-03-06	重大事项	7.15	-	-	2,070,335.00	12,350,119.99	14,802,895.25	-

注：本基金截至 2017 年 06 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开

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

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

(2) 除增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	862,528,705.31	81.93
	其中：股票	862,528,705.31	81.93
2	固定收益投资	294,703.50	0.03
	其中：债券	294,703.50	0.03
	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	90,000,000.00	8.55
	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	99,596,299.64	9.46
7	其他各项资产	311,570.04	0.03
8	合计	1,052,731,278.49	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	726,036,512.63	69.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,895,756.24	1.15
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	61,156,721.87	5.89
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	7,639.62	0.00
J	金融业	10,053,840.00	0.97
K	房地产业	5,062,588.02	0.49
L	租赁和商务服务业	31,198,830.85	3.00
M	科学研究和技术服务业	8,379,744.00	0.81
N	水利、环境和公共设施管理业	8,737,072.08	0.84
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	862,528,705.31	83.04

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300115	长盈精密	2,228,278	65,021,152.04	6.26

2	002450	康得新	1,954,500	44,015,340.00	4.24
3	002241	歌尔股份	2,197,756	42,372,735.68	4.08
4	002456	欧菲光	2,135,195	38,796,493.15	3.74
5	002635	安洁科技	1,000,800	36,248,976.00	3.49
6	002008	大族激光	1,044,300	36,174,552.00	3.48
7	002475	立讯精密	1,127,951	32,981,287.24	3.18
8	600519	贵州茅台	66,208	31,240,244.80	3.01
9	000858	五粮液	547,152	30,454,480.32	2.93
10	600566	济川药业	785,947	29,889,564.41	2.88

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603799	华友钴业	50,064,891.47	4.94
2	300450	先导智能	48,350,160.35	4.77
3	600110	诺德股份	43,300,622.27	4.27
4	002450	康得新	38,371,998.84	3.78
5	002466	天齐锂业	37,481,459.18	3.70
6	600703	三安光电	36,563,166.14	3.61
7	600089	特变电工	34,460,446.90	3.40
8	600884	杉杉股份	34,266,937.13	3.38
9	002241	歌尔股份	33,362,745.16	3.29
10	002460	赣锋锂业	32,626,408.92	3.22
11	002008	大族激光	31,409,003.74	3.10
12	600436	片仔癀	30,235,378.91	2.98
13	002475	立讯精密	29,904,785.28	2.95
14	300072	三聚环保	29,303,099.46	2.89
15	002635	安洁科技	28,645,170.25	2.83
16	600031	三一重工	28,577,164.28	2.82
17	600519	贵州茅台	27,816,203.14	2.74
18	000568	泸州老窖	27,348,710.72	2.70
19	600566	济川药业	26,995,920.74	2.66
20	600583	海油工程	26,924,864.00	2.66
21	000858	五粮液	25,267,058.46	2.49
22	000039	中集集团	24,179,375.93	2.38
23	002310	东方园林	24,040,069.99	2.37
24	002497	雅化集团	23,689,484.87	2.34
25	601933	永辉超市	22,535,782.68	2.22

26	000049	德赛电池	22,324,039.96	2.20
27	002640	跨境通	22,187,626.19	2.19
28	002384	东山精密	21,557,035.44	2.13
29	000425	徐工机械	21,332,261.00	2.10
30	300136	信维通信	21,253,562.50	2.10
31	000528	柳工	21,190,140.90	2.09
32	300197	铁汉生态	20,642,112.87	2.04
33	000671	阳光城	20,632,881.06	2.03

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002450	康得新	63,178,217.18	6.23
2	603799	华友钴业	55,910,374.46	5.51
3	300070	碧水源	43,286,946.43	4.27
4	002236	大华股份	40,842,344.69	4.03
5	002053	云南能投	39,541,929.23	3.90
6	000018	神州长城	36,186,359.40	3.57
7	000998	隆平高科	35,517,651.46	3.50
8	600089	特变电工	35,342,222.19	3.49
9	000400	许继电气	32,982,075.52	3.25
10	002353	杰瑞股份	31,380,735.57	3.09
11	002466	天齐锂业	30,825,975.47	3.04
12	600031	三一重工	30,327,593.11	2.99
13	000639	西王食品	29,051,773.55	2.87
14	002570	贝因美	28,771,719.69	2.84
15	600884	杉杉股份	28,346,352.39	2.80
16	300072	三聚环保	27,700,704.49	2.73
17	300197	铁汉生态	27,677,338.65	2.73
18	002332	仙琚制药	26,458,087.80	2.61
19	002497	雅化集团	26,022,673.96	2.57
20	300450	先导智能	25,752,129.43	2.54
21	600583	海油工程	25,293,197.55	2.49
22	000039	中集集团	23,914,875.36	2.36
23	300136	信维通信	22,981,753.47	2.27
24	002310	东方园林	22,170,370.99	2.19
25	000528	柳工	22,064,315.42	2.18
26	600110	诺德股份	22,014,575.65	2.17

27	000425	徐工机械	21,741,912.79	2.14
28	300203	聚光科技	20,939,702.40	2.07
29	000671	阳光城	20,421,121.73	2.01
30	000928	中钢国际	20,298,611.49	2.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,531,363,117.43
卖出股票的收入（成交）总额	1,621,527,549.33

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	294,703.50	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	294,703.50	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127004	模塑转债	2,550	294,703.50	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	300,869.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-10,423.84
5	应收申购款	21,124.72
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	311,570.04

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票无流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
31,715	33,765.35	3,078,442.90	0.29%	1,067,789,660.70	99.71%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	13,841.39	0.0013%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年2月26日）基金份额总额	3,420,650,236.61
本报告期期初基金份额总额	1,152,429,866.52
本报告期基金总申购份额	17,499,158.46
减：本报告期基金总赎回份额	99,060,921.38
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,070,868,103.60

10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

无。基金托管人：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	1	1,014,551,812.58	32.23%	944,853.53	32.23%	-
中泰证券	1	587,097,793.93	18.65%	546,763.96	18.65%	-
华泰证券	1	444,296,632.76	14.11%	413,774.00	14.11%	-
国元证券	1	423,771,057.45	13.46%	394,658.32	13.46%	-
东方证券	1	338,361,186.95	10.75%	315,119.30	10.75%	-
东吴证券	1	190,894,893.88	6.06%	177,776.93	6.06%	-
上海证券	1	104,461,446.92	3.32%	97,282.72	3.32%	-
高华证券	1	44,898,724.91	1.43%	41,814.24	1.43%	-

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. 本基金本报告期新增席位 1 个，无注销席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	回购交易	权证交易

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
方正证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	250,000,000.00	7.95%	-	-
东方证券	-	-	210,000,000.00	6.68%	-	-
东吴证券	-	-	1,630,000,000.00	51.83%	-	-
上海证券	-	-	1,055,000,000.00	33.55%	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

上投摩根基金管理有限公司

二〇一七年八月二十八日