

上投摩根智慧互联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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	上投摩根智慧互联股票
基金主代码	001313
交易代码	001313
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 9 日
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,420,070,530.61 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	采用定量及定性研究方法，自下而上优选互联网主题上市公司，通过严格的风险控制，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金将专注于互联网主题投资，对其相关行业的发展进行密切跟踪，充分把握互联网概念企业的投资机会。</p> <p>在资产配置层面，本基金将根据各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例，动态优化投资组合。</p> <p>在个股选择层面，本基金主要采取“自下而上”的选股策略，基于对互联网主题相关的上市公司盈利水平、成长性和估值水平的综合考量，使用定性与定量相结合的方法精选股票进行投资。</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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡迪	郭明
	联系电话	021-38794888	010-66105799
	电子邮箱	services@cifm.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-4888	95588
传真		021-20628400	010-66105798

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 6 月 9 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	11,019,956.99	-382,194,240.48	-685,794,542.36
本期利润	250,647,520.12	-701,162,837.06	-435,317,642.83
加权平均基金份额本期利润	0.0970	-0.2400	-0.1371
本期基金份额净值增长率	14.50%	-26.90%	-10.40%
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	-0.3205	-0.3454	-0.1994
期末基金资产净值	1,815,818,665.59	1,799,536,279.58	2,659,134,824.86
期末基金份额净值	0.750	0.655	0.896

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	-10.18%	1.38%	1.59%	0.65%	-11.77%	0.73%
过去六个月	5.63%	1.47%	6.25%	0.59%	-0.62%	0.88%
过去一年	14.50%	1.30%	12.25%	0.55%	2.25%	0.75%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-25.00%	1.93%	-26.38%	1.44%	1.38%	0.49%

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

上投摩根智慧互联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

(2015 年 6 月 9 日至 2017 年 12 月 31 日)



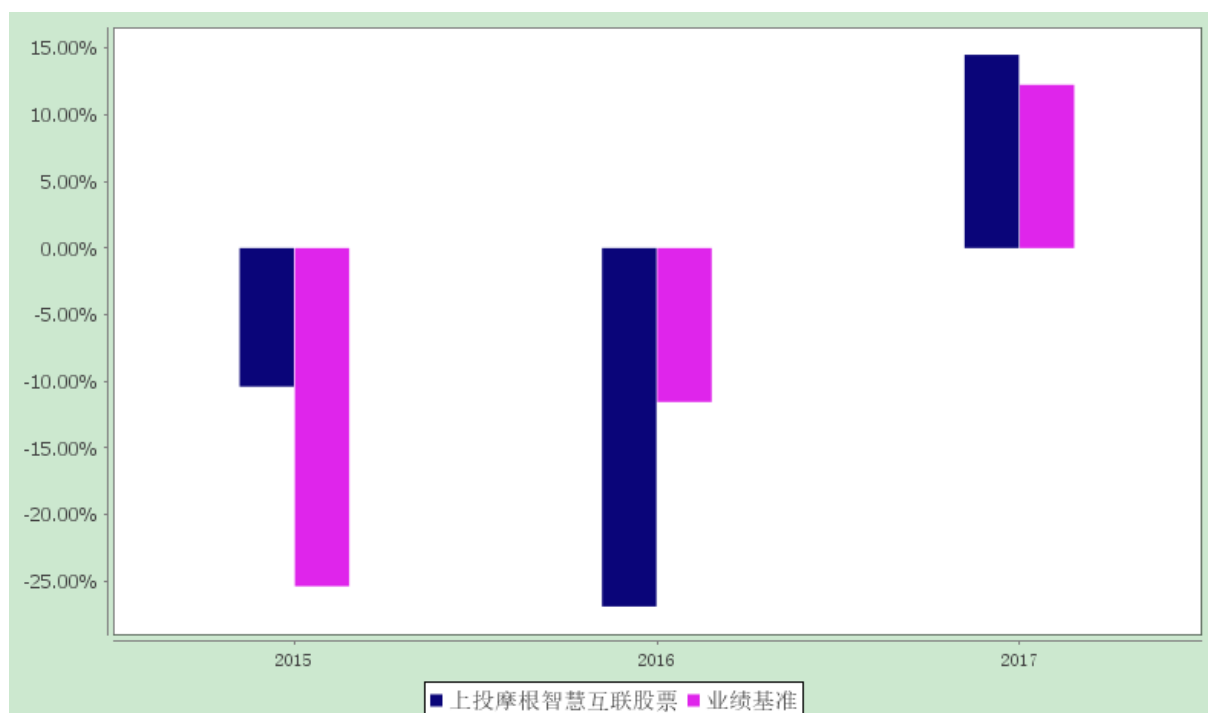
注：本基金合同生效日为 2015 年 6 月 9 日，图示时间段为 2015 年 6 月 9 日至 2017 年 12 月 31 日。

本基金建仓期自 2015 年 6 月 9 日至 2015 年 12 月 8 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 自基金合同生效以来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

上投摩根智慧互联股票型证券投资基金

自基金合同生效以来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 2015 年 6 月 9 日正式成立，图示的时间段为 2015 年 6 月 9 日至 2017 年 12 月 31 日。

合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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		
郭晨	本基金基金经理	2015-06-09	-	11 年	郭晨先生, 自 2007 年 5 月至 2008 年 4 月在平安资产管理有限公司担任分析师; 2008 年 4 月至 2009 年 11 月在东吴基金管理有限公司担任研究员; 2009 年 11 月至 2014 年 10 月在华富基金管理有限公司

					先后担任基金经理助理、基金经理，自 2014 年 10 月起加入上投摩根基金管理有限公司，自 2015 年 1 月起担任上投摩根中小盘混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 6 月起同时担任上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金经理，自 2015 年 8 月起同时担任上投摩根新兴服务股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.郭晨先生为本基金首任基金经理，其任职日期指本基金基金合同生效之日。

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、《上投摩根智慧互联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 年上半年市场一直处于窄幅震荡之中，成交量低迷，活跃度不高，存量资金博弈，市场的风险偏好很低，绩优白马股保持强势，漂亮 50 是市场的热点，资金不断追逐绝对估值低，增长确定的个股和行业，市场热点集中在家电、白酒、消费电子等行业。一季度市场曾对经济复苏抱有较高

的预期，配合上游原材料的涨价，周期股有过阶段性的表现。上半年 IPO 的速度很快，对中小市值股票冲击很大，流动性差，市场关注度不高。上半年国内和美国宏观经济表现都不错，人民币表现稳健，季末的流动性较宽松，债券市场和股票市场都没有受到流动性的冲击。房地产调控继续严格执行，房地产后周期行业和基建相关的行业景气度继续保持，家电、白酒、工程机械、化工等行业持续受益。下半年市场逐渐走强，三季度蓝筹股稳步走高，创业板在七月初恐慌性下跌之后，也步入上升通道，成交量逐步放大，热点也很多，新能源汽车是市场的龙头，以煤炭钢铁为代表的周期品种、以家电白酒为代表的消费品种都有不错的表现。市场始终围绕着公司业绩和景气度来表现，价值投资体现的淋漓尽致。三季度 IPO 的速度平稳，并购、再融资有所放松。国内和美国宏观经济表现稳健，人民币十分强势，市场流动性平稳。四季度国内外经济走势平稳，汇率稳定，市场维持震荡，十九大的召开是本季度最引人注目的大事，年底市场的避险情绪较浓，资金面偏紧。大盘蓝筹股强于小盘成长股，白酒、家电、银行、地产板块受到市场青睐，表现较好，其他热点不多，前期表现较好的新能源汽车、消费电子有所调整。

本基金以配置智慧互联相关行业为主，偏好成长风格，不断寻找与主题相关最有前景、估值合理的优质行业和公司，2017 年与本基金主题相关行业大多表现较差，本基金选择了产业趋势明确的消费电子、新能源智能汽车等行业进行投资，在 2017 年表现亮眼，为本基金带来了很大的收益。

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 14.50%，同期业绩比较基准收益率为 12.25%。。

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 2018 年宏观经济，十九大的胜利召开有利于市场的稳定，国内的经济形势向好，国内 GDP 增速预计和 2017 年差距不大，总体增速仍维持较高水平。投资分项看，预计 2018 年地产投资增速略低于 2017 年，基建和制造业增速平稳，2018 年固定资产投资增速略低于 2017 年。当前工业企业库存水平已经明显回升，继续大幅补库存动力减弱，库存水平大概率震荡回落。由于经济增速偏高，稳增长诉求下降，金融监管有序推进。当前国内经济韧性较强，息差较大，全球经济环境稳中向好。预计美联储 2018 年仍有 2-3 次加息。美国经济复苏进入中后期，就业和消费数据平稳改善。欧洲和日本经济仍有进一步复苏动力，新兴市场也会受到拉动。由于海外市场强劲，即便美联储加息，美元也难以持续走强，配置资金可能会流向新兴市场。

在这个背景之下，市场出现大幅波动的概率不大，预计整个市场仍将以结构性行情为主，大盘蓝筹和优质成长均有机会，从板块来看，继续重视估值较低的大金融、预期改善的房地产，业绩确定的大消费，成长板块尤其是传媒、计算机行业已经连续两年排名倒数，许多个股的估值都已经跌

到了低位，非常值得关注，消费电子和新能源智能汽车行业将继续高速增长，本基金也继续看好。由于本基金主题相关行业已经连续两年表现较差，我们认为 2018 年大概率会比前两年要好，我们将继续精选行业和个股，综合考虑业绩增速和估值，在本主题中寻找机会。

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，本基金托管人在对上投摩根智慧互联股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，上投摩根智慧互联股票型证券投资基金的管理人——上投摩根基金管理有限公司在上投摩根智慧互联股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作

严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对上投摩根基金管理有限公司编制和披露的上投摩根智慧互联股票型证券投资基金本报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

上投摩根智慧互联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有限公司审计、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 21921 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：上投摩根智慧互联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	162,819,739.83	211,981,828.20
结算备付金		1,858,196.21	12,100,908.93
存出保证金		571,525.02	992,114.34
交易性金融资产	7.4.7.2	1,670,574,844.98	1,613,875,394.75
其中：股票投资		1,667,508,444.98	1,613,875,394.75
基金投资		-	-
债券投资		3,066,400.00	-
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		261,670.19	12,746,815.77
应收利息	7.4.7.5	31,025.54	49,783.92
应收股利		-	-
应收申购款		499,373.74	101,645.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,836,616,375.51	1,851,848,491.70
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		14,066,707.26	43,005,401.31
应付赎回款		2,447,855.17	1,321,735.12
应付管理人报酬		2,384,188.55	2,357,719.15
应付托管费		397,364.77	392,953.19
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,097,503.23	4,830,735.27
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	404,090.94	403,668.08
负债合计		20,797,709.92	52,312,212.12
所有者权益：		-	-

实收基金	7.4.7.9	2,420,070,530.61	2,749,018,339.74
未分配利润	7.4.7.10	-604,251,865.02	-949,482,060.16
所有者权益合计		1,815,818,665.59	1,799,536,279.58
负债和所有者权益总计		1,836,616,375.51	1,851,848,491.70

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.750 元，基金份额总额 2,420,070,530.61 份。

7.2 利润表

会计主体：上投摩根智慧互联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		300,232,703.57	-628,921,592.71
1.利息收入		1,257,842.33	2,457,553.63
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,257,290.66	1,926,366.07
债券利息收入		551.67	449,345.78
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	81,841.78
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		58,072,645.73	-313,199,911.10
其中：股票投资收益	7.4.7.12	50,268,297.92	-316,837,743.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	145,612.60	-642,181.50
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	7,658,735.21	4,280,013.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	239,627,563.13	-318,968,596.58

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	1,274,652.38	789,361.34
减：二、费用		49,585,183.45	72,241,244.35
1. 管理人报酬		28,313,425.26	31,003,337.40
2. 托管费		4,718,904.12	5,167,222.87
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	16,117,267.74	35,654,355.40
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	435,586.33	416,328.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		250,647,520.12	-701,162,837.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		250,647,520.12	-701,162,837.06

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根智慧互联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）	2,749,018,339.74	-949,482,060.16	1,799,536,279.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	250,647,520.12	250,647,520.12
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	-328,947,809.13	94,582,675.02	-234,365,134.11

列)			
其中：1.基金申购款	393,062,662.31	-72,631,779.75	320,430,882.56
2.基金赎回款	-722,010,471.44	167,214,454.77	-554,796,016.67
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）	2,420,070,530.61	-604,251,865.02	1,815,818,665.59
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）	2,966,820,145.22	-307,685,320.36	2,659,134,824.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-701,162,837.06	-701,162,837.06
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）	-217,801,805.48	59,366,097.26	-158,435,708.22
其中：1.基金申购款	270,177,911.99	-80,810,046.73	189,367,865.26
2.基金赎回款	-487,979,717.47	140,176,143.99	-347,803,573.48
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）	2,749,018,339.74	-949,482,060.16	1,799,536,279.58

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

上投摩根智慧互联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 792 号《关于准予上投摩根智慧互联股票型证券投资基金注册的批复》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《上投摩根智慧互联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 3,458,029,156.04 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 647 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,458,449,901.70 份基金份额，其中认购资金利息折合 420,745.66 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根智慧互联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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含中期票据、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债等)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、股票期权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%，不低于 80%的非现金基金资产投资于与智慧互联主题相关的股票；每个交易日日终在扣除股指期货及股票期权保证金后，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 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》、《上投摩根智慧互联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。该估值技术变更使本基金 2017 年 12 月 31 日的基金资产净值及 2017 年度净损益减少,相关影响非重大。

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。该估值技术变更使本基金 2017 年 12 月 31 日的基金资产净值及 2017 年度净损益减少，相关影响非重大。

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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	28,313,425.26	31,003,337.40
其中：支付销售机构的客户维护费	12,901,459.51	14,127,990.33

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：

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年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托管费	4,718,904.12	5,167,222.87

注：支付基金托管人中国工商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：

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

7.4.8.3 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

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
工商银行股份有限公	162,819,739.83	1,170,287.15	211,981,828.20	1,724,777.38

司				
---	--	--	--	--

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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
002892	科力尔	2017-08-10	2018-08-17	限售股	17.56	32.16	11,000.00	193,160.00	353,760.00	-
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	-
300713	英可瑞	2017-12-23	2018-01-01	限售股	40.29	74.87	7,008.00	282,352.32	524,688.96	-
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	-
002466	天齐锂业	2017-12-26	2018-01-03	新股未上市	11.06	53.21	329,341.00	3,642,511.46	17,524,234.61	-
002859	洁美科技	2017-03-24	2018-04-07	限售股	29.82	33.80	6,666.00	198,780.12	225,310.80	-

002859	洁美科技	2017-03-24	2018-04-07	限售股	-	33.80	9,999.00	-	337,966.20	-
7.4.9.1.2 受限证券类别：债券										
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
128028	赣锋转债	2017-12-21	2018-01-19	新债未上市	100.00	100.00	30,664.00	3,066,400.00	3,066,400.00	-

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 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	-
601600	中国铝业	2017-09-12	重大资产重组	6.67	2018-02-26	7.28	486,000.00	4,003,017.00	3,241,620.00	-

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 1,645,152,356.21 元，属于第二层次的余额为 25,422,488.77 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 1,540,186,069.27 元，第二层次 73,689,325.48 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	1,667,508,444.98	90.79
	其中：股票	1,667,508,444.98	90.79
2	固定收益投资	3,066,400.00	0.17
	其中：债券	3,066,400.00	0.17
	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	164,677,936.04	8.97
7	其他各项资产	1,363,594.49	0.07
8	合计	1,836,616,375.51	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	51,579,993.96	2.84
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,502,594,397.68	82.75
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	70,380,657.78	3.88
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	5,431,252.55	0.30
J	金融业	-	-
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	299,300.73	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	37,188,756.32	2.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,667,508,444.98	91.83

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	002460	赣锋锂业	2,408,628.00	172,819,059.00	9.52
2	002456	欧菲科技	8,290,177.00	170,694,744.43	9.40
3	002236	大华股份	7,061,775.00	163,056,384.75	8.98
4	300136	信维通信	3,181,067.00	161,280,096.90	8.88

5	603799	华友钴业	1,895,500.00	152,075,965.00	8.38
6	002466	天齐锂业	2,524,946.00	134,352,376.66	7.40
7	300450	先导智能	2,149,157.00	122,437,474.29	6.74
8	300115	长盈精密	6,033,609.00	121,094,532.63	6.67
9	002411	必康股份	3,079,471.00	82,129,491.57	4.52
10	002768	国恩股份	2,718,959.00	77,408,762.73	4.26

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	300115	长盈精密	238,789,932.41	13.27
2	002466	天齐锂业	193,521,306.78	10.75
3	002460	赣锋锂业	188,641,016.40	10.48
4	002236	大华股份	179,617,196.46	9.98
5	603799	华友钴业	172,202,727.45	9.57
6	300450	先导智能	146,308,152.98	8.13
7	300136	信维通信	126,770,991.61	7.04
8	600406	国电南瑞	109,551,089.05	6.09
9	600703	三安光电	101,004,213.15	5.61
10	002456	欧菲科技	92,821,022.97	5.16
11	002497	雅化集团	92,339,543.91	5.13
12	002709	天赐材料	87,255,343.71	4.85
13	300073	当升科技	72,239,704.65	4.01
14	002768	国恩股份	70,212,712.80	3.90
15	002045	国光电器	66,669,349.28	3.70
16	002384	东山精密	65,848,409.50	3.66
17	300457	赢合科技	63,205,131.72	3.51
18	603993	洛阳钼业	62,579,794.00	3.48
19	002241	歌尔股份	60,129,454.40	3.34
20	002008	大族激光	58,579,769.61	3.26
21	601933	永辉超市	57,233,648.59	3.18
22	603626	科森科技	55,469,410.63	3.08
23	000998	隆平高科	53,800,551.76	2.99
24	600884	杉杉股份	53,625,737.88	2.98
25	601800	中国交建	51,839,948.78	2.88
26	000065	北方国际	51,134,540.20	2.84

27	002475	立讯精密	50,288,122.54	2.79
28	600438	通威股份	49,990,390.65	2.78
29	600068	葛洲坝	49,409,117.96	2.75
30	300340	科恒股份	48,472,702.79	2.69
31	000820	神雾节能	47,774,342.29	2.65
32	002589	瑞康医药	47,360,582.12	2.63
33	000568	泸州老窖	45,900,260.72	2.55
34	603589	口子窖	45,105,864.56	2.51
35	300618	寒锐钴业	42,551,601.00	2.36
36	000921	海信科龙	42,007,476.62	2.33
37	002407	多氟多	41,990,662.80	2.33
38	601336	新华保险	41,546,979.99	2.31
39	002094	青岛金王	39,845,967.92	2.21
40	300098	高新兴	39,730,311.53	2.21
41	300059	东方财富	39,006,701.98	2.17
42	600887	伊利股份	38,544,648.71	2.14
43	601117	中国化学	37,155,282.21	2.06
44	601919	中远海控	36,662,933.81	2.04

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	002460	赣锋锂业	132,155,716.43	7.34
2	002497	雅化集团	110,620,506.58	6.15
3	600406	国电南瑞	110,178,438.25	6.12
4	002466	天齐锂业	109,042,794.26	6.06
5	600703	三安光电	86,888,614.02	4.83
6	002709	天赐材料	82,155,158.85	4.57
7	603108	润达医疗	79,745,572.51	4.43
8	300073	当升科技	79,717,047.63	4.43
9	300340	科恒股份	76,251,273.36	4.24
10	002456	欧菲科技	74,585,987.79	4.14
11	002343	慈文传媒	73,410,144.45	4.08
12	603799	华友钴业	73,034,530.45	4.06
13	603377	东方时尚	72,094,665.90	4.01
14	600884	杉杉股份	69,819,174.87	3.88

15	002241	歌尔股份	67,076,466.87	3.73
16	002384	东山精密	67,023,699.91	3.72
17	300457	赢合科技	65,504,225.87	3.64
18	002008	大族激光	65,094,315.18	3.62
19	603993	洛阳钼业	64,718,173.57	3.60
20	300115	长盈精密	63,308,143.97	3.52
21	002411	必康股份	63,048,634.40	3.50
22	002475	立讯精密	61,292,845.60	3.41
23	603626	科森科技	59,403,611.85	3.30
24	000980	众泰汽车	57,136,066.68	3.18
25	601233	桐昆股份	56,019,904.30	3.11
26	002094	青岛金王	55,806,556.46	3.10
27	300377	赢时胜	53,400,098.29	2.97
28	002768	国恩股份	53,257,793.19	2.96
29	600068	葛洲坝	53,199,460.38	2.96
30	002407	多氟多	52,946,911.99	2.94
31	000568	泸州老窖	51,375,496.57	2.85
32	601800	中国交建	49,592,801.93	2.76
33	300296	利亚德	49,443,862.63	2.75
34	000065	北方国际	47,903,394.51	2.66
35	603589	口子窖	46,892,245.49	2.61
36	600497	驰宏锌锗	46,858,544.43	2.60
37	002236	大华股份	46,244,772.87	2.57
38	002195	二三四五	45,969,292.98	2.55
39	002589	瑞康医药	44,898,989.10	2.50
40	300065	海兰信	43,207,882.32	2.40
41	002045	国光电器	42,938,519.37	2.39
42	002310	东方园林	42,430,943.99	2.36
43	601336	新华保险	41,824,205.67	2.32
44	600438	通威股份	41,626,031.99	2.31
45	000820	神雾节能	41,418,523.60	2.30
46	600362	江西铜业	40,765,025.06	2.27
47	000921	海信科龙	39,398,187.97	2.19
48	300059	东方财富	38,724,194.98	2.15
49	000060	中金岭南	38,721,873.00	2.15
50	000878	云南铜业	37,285,314.52	2.07
51	002341	新纶科技	37,042,908.36	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。

8.4.3 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	5,148,834,412.77
卖出股票的收入（成交）总额	5,385,097,223.59

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

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）	3,066,400.00	0.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,066,400.00	0.17

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

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	128028	赣锋转债	30,664	3,066,400.00	0.17

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

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

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	571,525.02
2	应收证券清算款	261,670.19
3	应收股利	-
4	应收利息	31,025.54
5	应收申购款	499,373.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,363,594.49

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002466	天齐锂业	17,524,234.61	0.97	限售股

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
71,793	33,709.00	5,999,600.00	0.25%	2,414,070,930.61	99.75%

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本基金	138.81	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(2015年6月9日)基金份额总额	3,458,449,901.70
--------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	2,749,018,339.74
本报告期基金总申购份额	393,062,662.31
减：本报告期基金总赎回份额	722,010,471.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,420,070,530.61

§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：

无。

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 100,000 元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 3 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	
安信证券	1	239,410,596.32	2.28%	222,963.30	2.28%	-
东北证券	1	479,379,523.87	4.56%	446,449.06	4.56%	-
东方证券	1	388,815,096.32	3.70%	362,103.61	3.70%	-
国金证券	1	369,465,166.16	3.51%	344,084.70	3.51%	-
国信证券	1	209,294,364.54	1.99%	194,915.99	1.99%	-
海通证券	1	1,405,760,829.24	13.36%	1,309,191.62	13.36%	-
华泰证券	1	981,230,243.08	9.33%	913,825.01	9.33%	-
民生证券	1	216,342,088.55	2.06%	201,480.48	2.06%	-
瑞银证券	2	2,378,369,195.85	22.60%	2,214,982.46	22.60%	-
上海证券	2	352,259,243.27	3.35%	328,057.52	3.35%	-
申港证券	2	6,134,138.00	0.06%	5,712.72	0.06%	-
申银万国	1	165,090,695.70	1.57%	153,756.04	1.57%	-
西南证券	1	339,791,968.38	3.23%	316,444.93	3.23%	-
长江证券	1	1,793,656,341.70	17.05%	1,670,438.89	17.05%	-
中金公司	2	1,102,196,131.10	10.48%	1,026,479.92	10.48%	-
中信证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
中银国际	2	94,345,106.21	0.90%	87,864.20	0.90%	-
申港证券	2	6,134,138.00	0.06%	5,712.72	0.06%	-

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. 本年度本基金新增4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
安信证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
东北证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
东方证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国金证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国信证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
海通证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
华泰证券	535,866.70	44.74%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
民生证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
瑞银证券	275,634.64	23.01%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
上海证券	386,166.36	32.24%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
申港证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
申银万国	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
西南证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
长江证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中金公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中信证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中银国际	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
申港证券	-	-	-	-	-	-

上投摩根基金管理有限公司

二〇一八年三月二十九日