

上投摩根中小盘混合型证券投资基金
2018 年年度报告摘要
2018 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：二〇一九年三月二十七日

§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 2019 年 3 月 26 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 2018 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	269,760,442.73 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于中国 A 股市场上的中小盘股票，通过缜密的资产配置原则和严格的行业个股选择，分享中国经济高速增长给优势中小市值上市公司带来的机遇，并积极运用战略和战术资产配置策略，动态优化投资组合，力求实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金充分借鉴摩根资产管理集团全球行之有效的投资理念和技术，运用“自下而上”精选个股与“自上而下”资产配置相结合的投资策略，重点投资于具有行业优势、公司优势和估值优势的中小市值上市公司股票。同时结合市场研判，对相关资产类别的预期收益进行监控，动态调整股票、债券等大类资产配置。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为： $40\% \times \text{天相中盘指数收益率} + 40\% \times \text{天相小盘指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$
风险收益特征	本基金是混合型基金，预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。 本基金风险收益特征会定期评估并在公司网站发布，请投资者关注。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上投摩根基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡迪	田青
	联系电话	021-38794888	010-67595096
	电子邮箱	services@cifm.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-4888	010-67595096
传真		021-20628400	010-66275853

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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-110,583,710.51	2,488,096.99	-73,673,722.90
本期利润	-176,771,953.63	62,532,793.76	-150,562,837.71
加权平均基金份额本期利润	-0.6959	0.2823	-0.5988
本期基金份额净值增长率	-32.33%	16.43%	-25.52%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3391	1.0039	0.7832
期末基金资产净值	361,248,717.26	449,650,524.60	404,760,946.87
期末基金份额净值	1.339	2.076	1.783

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

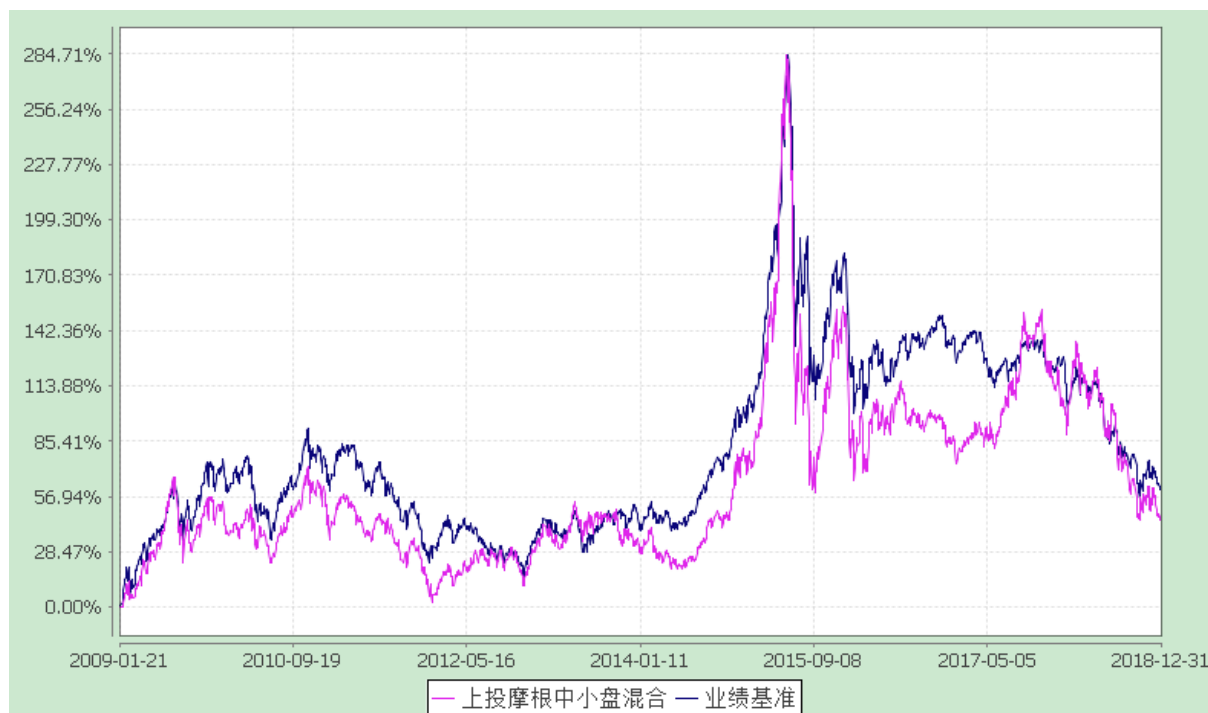
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-12.08%	1.96%	-9.11%	1.39%	-2.97%	0.57%
过去六个月	-26.06%	1.82%	-14.35%	1.22%	-11.71%	0.60%
过去一年	-32.33%	1.85%	-24.21%	1.13%	-8.12%	0.72%
过去三年	-41.32%	1.77%	-31.26%	1.11%	-10.06%	0.66%
过去五年	7.57%	2.05%	12.43%	1.34%	-4.86%	0.71%
自基金合同生效起至今	44.71%	1.80%	61.04%	1.32%	-16.33%	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2018年12月31日)



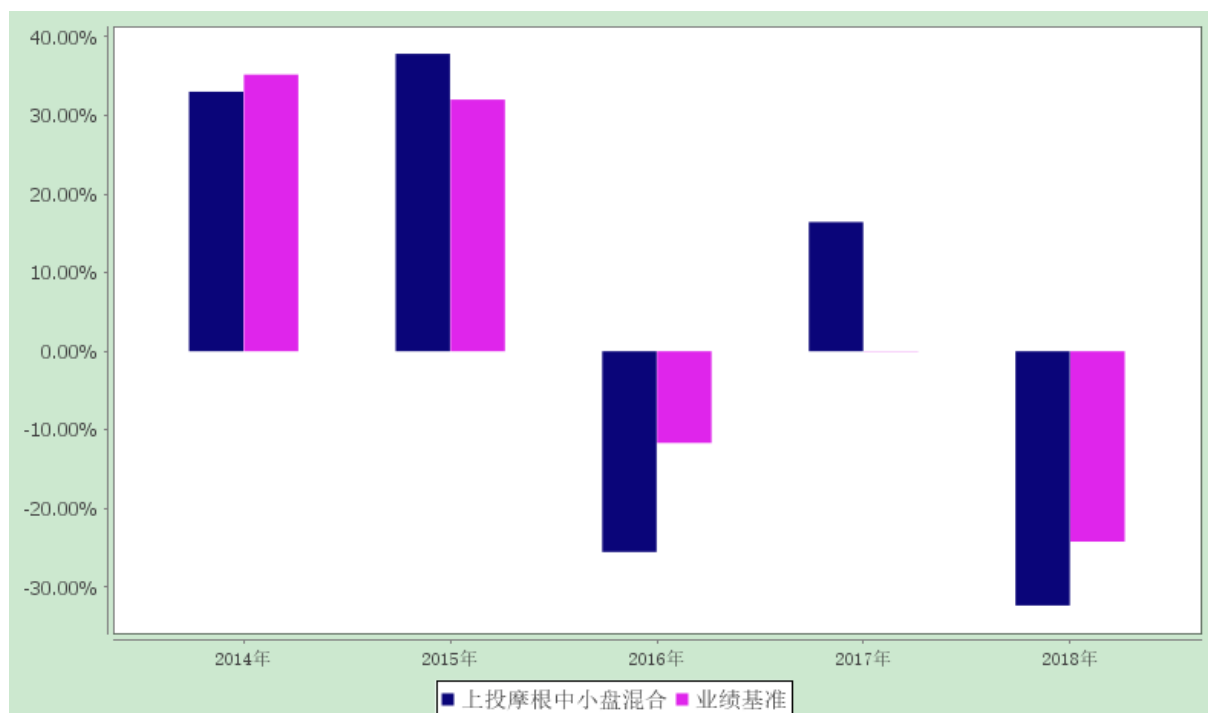
注：本基金合同生效日为 2009 年 1 月 21 日，图示时间段为 2009 年 1 月 21 日至 2018 年 12 月 31 日。

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 2018 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	-
2017年	-	-	-	-	-
2016年	-	-	-	-	-
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 2018 年 12 月底，公司旗下运作的基金共有六十三只，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、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。

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	证券从业	说明
----	----	-----------	------	----

		(助理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
郭晨	本基金基金经理	2015-01-30	-	12 年	郭晨先生，自 2007 年 7 月至 2008 年 4 月在平安资产管理有限公司担任分析师；2008 年 4 月至 2009 年 11 月在东吴基金管理有限公司担任研究员；2009 年 11 月至 2014 年 10 月在华富基金管理有限公司先后担任基金经理助理、基金经理，自 2014 年 10 月起加入上投摩根基金管理有限公司，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.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。除以下情况外，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：本基金曾出现个别由于市场原因引起的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形，但已在规定时间内调整完毕。

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：无。

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

2018 是典型的熊市，上证综指跌幅 24.59%，创业板指数跌幅 28.65%，整个市场普跌，一季度国内外政治经济大事不断，两会的召开是本季度国内最引人注目的大事，两会之后国内的经济工作重点逐步从供给侧改革向新旧动能转换迁移。针对新科技、新兴产业的鼓励措施也不断出台，A 股市场也经历了一次明显的风格切换，一月份周期和消费板块表现优秀，随后行情迅速切换到中小盘成长股。特朗普针对中国的贸易战开打，为市场带来了更多的不确定性。

二季度市场跌幅较大，中美贸易战是本季度的焦点，形势发展超出市场的预期。国内方面，棚改政策的变化也颇为引人注目，对三四线城市的固定资产投资会产生影响，房地产产业链以及相关的消费板块也都有所反应。二季度市场是普跌的状态，只有白酒、医药等个别行业表现较为强势，市场有恐慌的情绪。由于市场的下跌，各种质押风险显现，很多大股东的股权质押处于预警状态，二级市场进一步去杠杆。

三季度市场继续下跌，上证综指下跌 0.92%，创业板指数下跌 12.16%，消费股和大盘蓝筹股相对抗跌，成长股、中小盘股下跌幅度较大。中美贸易战继续发酵，国内经济开始逐渐走弱，房地产降温，消费数据不佳。美国把贸易战的矛头指向中国的高科技行业，市场的风险偏好下降，导致科技股，成长股疲弱，资金更青睐稳定的消费品种。国内去杠杆仍在继续，流动性没有改善的迹象，市场对民营企业的担忧很大，债券市场也不断出现违约事件。从政策的角度，三季度后期逐渐转暖，减费降税的呼声逐渐提高，财政和货币政策有松动的迹象。美国市场完全没有受到贸易战的影响，不断创出新高，随着美国利率水平的走高，香港市场开始见顶回落。

四季度市场继续下跌，上证综指下跌 11.61%，创业板指数下跌 11.39%，大盘和中小盘股普跌，前期表现较好的医药行业受带量采购的影响跌幅较大。中美贸易战本季度出现转机，中美领导人在阿根廷会面，开启了谈判的进程。全球经济的不确定性开始加大，美国经济有见顶迹象，美联储加息进程接近尾声，美股结束了十年的牛市出现大跌，以原油为代表的大宗商品暴跌。国内经济数据继续下行，房地产降温，消费数据不佳，进出口数据走弱，贸易战对中美经济的影响开始显现。政策开始逐渐转暖，减费降税逐渐落实，财政和货币政策有松动的迹象，但是对经济和市场的影响还不明显，针对上市公司大股东的质押问题，也出台了许多的政策，有利于缓解被动抛售的问题。科创板试点注册制开始筹备，19 年推出的概率很大，注册制的实行是对中国证券市场具有深远影响的标志性事件。

2018 年几乎没有贯穿全年的机会，只有为数不多的板块有波段性机会，本基金今年加强了仓位上的变动，增加了板块的波段操作，上半年重点加仓了医药板块，医药同时具有消费和成长的属

性，上半年表现良好，同时配置了国家支持鼓励的高科技、先进制造为代表的成长板块。三季度基金适度降低了仓位，减持了医药行业，主要是考虑到带量采购和疫苗事件的负面影响。对计算机板块进行了波段操作，该板块在贸易战中受益于自主可控的支持，但是估值较高，取得了不错的相对收益。本基金重仓的电子、新能源汽车等板块三季度跌幅较大，给基金净值带来了较大的影响，本基金进行了波段操作，规避了一定的损失，加仓了银行、保险等蓝筹股，主要是弱勢市场防御的需要。四季度开始逐渐为 2019 年进行布局，减持银行、保险、医药、电子行业，增加了成长股的配置，行业集中在光伏、新能源汽车中下游、5G、券商等，取得了不错的相对收益。本基金 2019 年战略性看好国家支持的高科技、先进制造为代表的成长板块，相关个股已经跌幅很大，从 PEG 的角度看进入了长期的买点，比如半导体、新能源汽车、5G、光伏等行业，坚定投资高成长，低估值，低 PEG 的优秀公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期上投摩根中小盘混合份额净值增长率为:-32.33%，同期业绩比较基准收益率为:-24.21%。

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 2019 年，全球经济不容乐观，美国开始见顶回落，美股继续震荡下行的概率较大，国内上半年的经济数据依然会表现不佳，消费、外贸较 2018 年更差一些，基建投资有加码的可能，市场很难迅速反转。也有一些积极的因素正在酝酿，中美贸易战有望达成协议，但不能期望中美关系重回蜜月期，国内为了应对经济下滑和中美贸易战，政策开始转暖，鼓励民营企业发展，减费降税的政策逐渐落地。目前 A 股市场的估值处于历史底部区间，大多数利空市场也都有所预期，向下空间不大，市场需要一段时间来铸就底部。

2019 年本基金战略看好成长板块，在经济数据不佳的情况下，周期股很难有大的起色，消费受后周期的影响在 2019 年数据也会出现回落，中小盘成长股经历了两三年的调整之后，很多个股估值逐步跌入合理水平，机构投资者仓位较低，外资有望继续增加 A 股配置，国家从战略层面上也会出台更多的政策来鼓励高科技行业的发展，宏观经济回落的背景有利于成长板块的启动。合理的估值，业绩增速，成长的确信是本基金最看重的，行业上我们认为 2019 年增长最为确定的几个行业是新能源汽车、5G、光伏等行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，

制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员，参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金实际运作情况，本基金以 2018 年 06 月 20 日为收益分配基准日，于 2018 年 7 月 4 日实施收益分配，每 10 份基金份额派发红利 0.88 元，合计发放红利 24,003,761.59 元。

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，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金实施利润分配共 24,003,761.59 元。

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

上投摩根中小盘混合型证券投资基金 2018 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(2019)第 20735 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：上投摩根中小盘混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	89,740,843.58	75,217,413.05
结算备付金		1,255,668.44	892,993.71
存出保证金		273,243.23	138,110.88
交易性金融资产	7.4.7.2	273,574,838.38	393,327,444.12
其中：股票投资		273,574,838.38	392,566,944.12
基金投资		-	-
债券投资		-	760,500.00
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	18,094.51	12,466.68
应收股利		-	-
应收申购款		173,312.16	293,373.58

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		365,036,000.30	469,881,802.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 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		2,149,379.66	18,169,805.31
应付赎回款		165,115.89	673,537.00
应付管理人报酬		480,963.85	589,727.02
应付托管费		80,160.63	98,287.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	691,323.08	478,410.78
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	220,339.93	221,509.51
负债合计		3,787,283.04	20,231,277.42
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.9	269,760,442.73	216,568,601.87
未分配利润	7.4.7.10	91,488,274.53	233,081,922.73
所有者权益合计		361,248,717.26	449,650,524.60
负债和所有者权益总计		365,036,000.30	469,881,802.02

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.339 元,基金份额总额 269,760,442.73 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 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
		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-163,908,137.32	75,231,590.93
1.利息收入		404,385.50	368,844.60
其中：存款利息收入	7.4.7.11	404,293.32	368,571.55
债券利息收入		92.18	273.05
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）		-98,256,797.15	14,676,038.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-100,250,486.20	12,854,854.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	13,660.78	45,422.82
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	1,980,028.27	1,775,760.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-66,188,243.12	60,044,696.77
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	132,517.45	142,011.40
减：二、费用		12,863,816.31	12,698,797.17
1. 管理人报酬		6,737,473.33	6,695,752.73
2. 托管费		1,122,912.23	1,115,958.83

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	4,755,820.00	4,638,776.27
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.34	-
7. 其他费用	7.4.7.19	247,610.41	248,309.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-176,771,953.63	62,532,793.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-176,771,953.63	62,532,793.76

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	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、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-24,003,761.59	-24,003,761.59
五、期末所有者权益（基金净值）	269,760,442.73	91,488,274.53	361,248,717.26
项目	上年度可比期间		
	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）	226,987,604.17	177,773,342.70	404,760,946.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	62,532,793.76	62,532,793.76
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）	-10,419,002.30	-7,224,213.73	-17,643,216.03
其中：1.基金申购款	73,359,008.41	86,944,774.81	160,303,783.22
2.基金赎回款	-83,778,010.71	-94,168,988.54	-177,946,999.25
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）	216,568,601.87	233,081,922.73	449,650,524.60

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：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2019年3月26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 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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

本基金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。

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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》

及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 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 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,737,473.33	6,695,752.73
其中：支付销售机构的客户维护费	935,287.05	939,159.40

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 2018年1月1日至2018年	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年
----	-----------------------	----------------------------

	12月31日	12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,122,912.23	1,115,958.83

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：

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

7.4.8.3 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	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017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	89,740,843.58	377,174.14	75,217,413.05	344,734.16

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 其他关联交易事项的说明

7.4.8.6.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2018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	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本	期末估值	备注

				限类 型				总额	总额	
60186 0	紫金 银行	2018- 12-20	2019- 01-03	新股 未上 市	3.14	3.14	15,970 .00	50,145 .80	50,145 .80	-

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
60003 0	中信证 券	2018- 12-25	重要事 项未公 告	16.01	2019- 01-10	17.15	247,593.00	4,256,091.26	3,963,963.93-	

注：本基金截至 2018 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 2018 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 269,560,728.65 元，属于第二层次的余额为 4,014,109.73 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 385,956,201.17 元，第二层次 7,371,242.95 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 2018 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(2017 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)其他

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	273,574,838.38	74.94
	其中：股票	273,574,838.38	74.94
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	90,996,512.02	24.93
8	其他各项资产	464,649.90	0.13
9	合计	365,036,000.30	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	7,355,742.24	2.04
B	采矿业	-	-
C	制造业	211,440,537.51	58.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	33,653,579.54	9.32
J	金融业	19,082,913.59	5.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,963,533.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	78,532.50	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	273,574,838.38	75.73

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	002594	比亚迪	417,140	21,274,140.00	5.89
2	601012	隆基股份	1,209,676	21,096,749.44	5.84
3	600438	通威股份	2,332,041	19,309,299.48	5.35
4	300136	信维通信	792,290	17,121,386.90	4.74
5	300073	当升科技	470,100	13,017,069.00	3.60
6	000063	中兴通讯	663,125	12,990,618.75	3.60
7	002821	凯莱英	154,234	10,464,776.90	2.90
8	300059	东方财富	854,013	10,333,557.30	2.86
9	600570	恒生电子	192,042	9,982,343.16	2.76
10	300037	新宙邦	390,602	9,393,978.10	2.60

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	300003	乐普医疗	49,061,108.77	10.91
2	600438	通威股份	44,557,537.92	9.91
3	603799	华友钴业	42,877,488.12	9.54
4	300618	寒锐钴业	42,385,214.85	9.43
5	300136	信维通信	37,025,684.61	8.23
6	002456	欧菲科技	35,440,453.84	7.88
7	002466	天齐锂业	33,937,368.55	7.55
8	601012	隆基股份	30,989,769.39	6.89
9	000063	中兴通讯	27,754,143.80	6.17
10	300073	当升科技	27,403,185.51	6.09
11	300601	康泰生物	23,685,684.22	5.27
12	002594	比亚迪	23,440,986.14	5.21
13	300036	超图软件	22,260,851.22	4.95
14	002821	凯莱英	21,478,686.30	4.78
15	002635	安洁科技	21,434,929.38	4.77
16	002371	北方华创	20,381,385.07	4.53
17	300348	长亮科技	19,818,409.72	4.41
18	002384	东山精密	18,651,215.78	4.15
19	002460	赣锋锂业	18,430,939.54	4.10
20	600867	通化东宝	18,368,881.78	4.09
21	600588	用友网络	18,300,182.22	4.07
22	603019	中科曙光	18,274,566.00	4.06
23	300377	赢时胜	18,158,082.00	4.04
24	600570	恒生电子	18,001,797.78	4.00
25	601336	新华保险	17,449,111.82	3.88
26	300059	东方财富	17,387,179.00	3.87
27	300037	新宙邦	16,833,860.78	3.74
28	000661	长春高新	16,395,887.88	3.65
29	002410	广联达	15,970,510.59	3.55
30	600271	航天信息	15,573,673.00	3.46
31	002475	立讯精密	15,521,195.49	3.45
32	600884	杉杉股份	15,351,859.00	3.41
33	002044	美年健康	14,731,281.68	3.28
34	000651	格力电器	13,785,891.67	3.07
35	603008	喜临门	13,576,525.07	3.02

36	300450	先导智能	13,369,204.96	2.97
37	000977	浪潮信息	13,329,213.36	2.96
38	603986	兆易创新	12,630,817.80	2.81
39	603387	基蛋生物	12,378,566.45	2.75
40	601318	中国平安	12,207,891.00	2.71
41	002236	大华股份	12,151,282.00	2.70
42	601601	中国太保	11,968,668.00	2.66
43	002050	三花智控	11,923,463.82	2.65
44	601766	中国中车	11,895,552.00	2.65
45	603589	口子窖	11,706,685.27	2.60
46	603707	健友股份	11,697,494.06	2.60
47	600872	中炬高新	11,539,662.54	2.57
48	002341	新纶科技	11,530,994.58	2.56
49	000783	长江证券	11,475,189.16	2.55
50	300433	蓝思科技	11,454,284.00	2.55
51	601688	华泰证券	11,394,148.00	2.53
52	002142	宁波银行	11,287,033.98	2.51
53	002497	雅化集团	11,061,206.00	2.46
54	002035	华帝股份	10,922,472.85	2.43
55	600406	国电南瑞	10,908,121.82	2.43
56	600519	贵州茅台	10,367,741.78	2.31
57	600298	安琪酵母	9,749,843.17	2.17
58	002709	天赐材料	9,609,628.34	2.14
59	002024	苏宁易购	9,215,057.00	2.05
60	300226	上海钢联	9,135,243.76	2.03
61	603367	辰欣药业	9,121,827.40	2.03
62	000681	视觉中国	9,058,945.94	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 (%)
1	603799	华友钴业	77,415,514.30	17.22
2	002460	赣锋锂业	57,123,833.57	12.70
3	002466	天齐锂业	51,312,713.65	11.41
4	002456	欧菲科技	48,302,698.11	10.74
5	300618	寒锐钴业	48,265,497.35	10.73

6	300003	乐普医疗	45,795,115.22	10.18
7	002236	大华股份	44,219,078.80	9.83
8	300450	先导智能	40,971,942.13	9.11
9	300136	信维通信	29,556,424.34	6.57
10	300036	超图软件	21,445,381.04	4.77
11	002050	三花智控	20,288,152.21	4.51
12	300377	赢时胜	18,063,663.81	4.02
13	601933	永辉超市	17,750,200.78	3.95
14	002635	安洁科技	17,331,948.84	3.85
15	601336	新华保险	17,322,649.79	3.85
16	600438	通威股份	17,223,568.68	3.83
17	300601	康泰生物	17,101,532.32	3.80
18	000063	中兴通讯	16,973,024.59	3.77
19	600588	用友网络	16,553,505.63	3.68
20	300348	长亮科技	16,011,715.68	3.56
21	002475	立讯精密	15,554,562.76	3.46
22	002371	北方华创	15,547,886.11	3.46
23	603019	中科曙光	15,542,600.78	3.46
24	600271	航天信息	15,429,410.59	3.43
25	000998	隆平高科	15,428,142.95	3.43
26	002384	东山精密	15,407,661.17	3.43
27	002044	美年健康	15,228,938.37	3.39
28	600867	通化东宝	15,110,370.75	3.36
29	002410	广联达	15,107,131.33	3.36
30	000661	长春高新	14,030,057.16	3.12
31	300115	长盈精密	13,998,506.16	3.11
32	000977	浪潮信息	13,444,516.95	2.99
33	601318	中国平安	12,550,074.96	2.79
34	603387	基蛋生物	12,217,864.91	2.72
35	002045	国光电器	12,194,972.14	2.71
36	300073	当升科技	11,971,385.23	2.66
37	000651	格力电器	11,839,074.46	2.63
38	601766	中国中车	11,743,151.31	2.61
39	002142	宁波银行	11,623,047.13	2.58
40	601601	中国太保	11,432,188.90	2.54
41	600406	国电南瑞	11,123,227.80	2.47
42	002768	国恩股份	10,997,916.92	2.45
43	603589	口子窖	10,960,848.98	2.44
44	603707	健友股份	10,790,438.01	2.40
45	600519	贵州茅台	10,509,908.15	2.34
46	600884	杉杉股份	10,248,191.06	2.28
47	002497	雅化集团	10,217,478.69	2.27
48	600887	伊利股份	9,945,250.64	2.21
49	600872	中炬高新	9,921,515.10	2.21

50	603986	兆易创新	9,917,669.98	2.21
51	300340	科恒股份	9,774,080.67	2.17
52	603008	喜临门	9,625,748.41	2.14
53	601166	兴业银行	9,262,014.49	2.06
54	002640	跨境通	9,251,474.73	2.06
55	000938	紫光股份	9,233,957.09	2.05
56	603367	辰欣药业	9,073,593.76	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	1,597,331,479.03
卖出股票的收入（成交）总额	1,549,884,855.45

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	273,243.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	18,094.51
5	应收申购款	173,312.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	464,649.90

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 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
21,154	12,752.22	50,578,158.36	18.75%	219,182,284.37	81.25%

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	2,039.45	0.0008%

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(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	216,568,601.87
本报告期基金总申购份额	129,792,269.93
减：本报告期基金总赎回份额	76,600,429.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	269,760,442.73

§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：无。

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 60,000 元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 10 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	
川财证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	1,945,628,589.72	61.90%	1,811,963.66	61.90%	-
华泰证券	1	767,067,450.93	24.41%	714,367.00	24.41%	-
国信证券	1	386,556,338.39	12.30%	360,001.64	12.30%	-
平安证券	1	43,724,777.48	1.39%	40,720.79	1.39%	-

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 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
川财证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	774,310.80	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

上投摩根基金管理有限公司

二〇一九年三月二十七日