

## 上投摩根核心优选股票型证券投资基金

### 2013 第二季度 报告

2013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：中国建设银行股份有限公司**  
报告送出日期：二〇一三年七月十七日**1.1 重要提示**  
基金管理人的董事会及董事承诺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责任。  
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2013年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容，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预示其未来表现，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。  
本报告期中财务资料未经审计。  
本报告自2013年4月1日起至6月30日止。

基金名称	上投摩根核心优选股票型证券投资基金
基金代码	370024
基金简称	核心优选
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
报告截止日期	2013年6月30日
基金净值	191,364,466.69

基金净值	191,364,466.69
基金份额	191,364,466.69
基金净值增长率	1.30%

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公允价值变动收益。  
2. 上投摩根核心优选股票型证券投资基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×85%+上证综指收益率×15%。

3.2.1 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	9.21%	1.76%	-9.91%	1.23%	19.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：本基金合同生效日为2012年11月28日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。本基金合同自2012年11月28日至2013年5月27日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。图示时段为2012年11月28日至2013年6月30日。

姓名	职务	任本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
孙宇	基金经理	2012-11-28	10年	华东师范大学经济学硕士，2003年7月至2006年12月担任上海证券有限责任公司研究员，2006年12月加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任研究员、基金经理助理、基金经理等职务。2012年11月28日起担任上投摩根核心优选股票型证券投资基金基金经理。

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

注：1. 任职日期和离任日期指根据基金合同约定确定的任职日期和解聘日期。  
2. 孙宇女士为本基金前任基金经理，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 基金经理（或基金经理小组）简介

本报告期末基金份额净值增长率为9.21%，同期业绩比较基准收益率为-9.91%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	232,806,352.28	89.03
2	固定收益	232,806,352.28	89.03
3	应收股利	5,614,340.00	2.13
4	其他资产	5,614,340.00	2.13
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他	-	-
9	合计	263,741,084.56	100.00

注：截至2013年6月30日，上投摩根核心优选股票型证券投资基金资产净值为249,605,697.70元，基金份额净值为1.304元，累计基金份额净值为1.304元。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	56,641.66	0.22
C	制造业	158,948,621.85	62.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,446,431.00	0.98
E	建筑业	2,572,739.55	1.01
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	信息技术业	23,459,081.78	9.40
J	金融业	6,080,169.24	2.42
K	房地产业	13,574,627.42	5.33
L	租赁和商务服务业	2,133,896.20	0.84
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,208,244.64	4.89
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公事业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	11,371,563.00	4.56
S	其他	-	-
合计		232,806,352.28	93.28

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002533	捷成股份	286,196	19,825,520.00	7.97
2	002241	启明星辰	410,465	14,979,748.55	5.97
3	600406	国电南瑞	910,880	13,599,438.40	5.43
4	300070	碧水源	323,998	12,288,264.64	4.89
5	002236	大普药业	316,112	12,048,961.76	4.81
6	002038	双环新能源	175,259	10,270,177.40	4.11
7	300014	亿纬锂能	338,914	7,998,370.40	3.20
8	000661	长春高新	80,609	7,802,421.19	3.16
9	002635	赛迪科技	171,263	7,178,825.41	3.09
10	300027	华谊兄弟	287,700	7,187,335.00	2.95

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,614,340.00	2.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	企业债券	-	-
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,614,340.00	2.25

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010308	03国债08	50,000	4,995,000.00	2.00
2	019219	12国债19	6,000	599,400.00	0.24
3	019035	10国债35	200	19,840.00	0.01

5.6 报告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。

5.7 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10 投资组合报告附注

5.11 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.12 报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	109,858.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	7.60
4	应收利息	3,231,629.85
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	待转资产	-
8	其他	-
9	合计	2,477,962.71

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.9.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.9.7 开放式基金份额变动

单位:份	项目	数量
	本报告期基金份额总额	93,917,563.31
	本报告期基金总申购份额	219,180,691.38
	本报告期基金总赎回份额	121,733,610.48
	本报告期基金净申购份额	197,346,462.2

5.9.8 报告期末本基金资产组合情况

5.9.9 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.9.10 报告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

5.9.11 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.9.12 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债券投资明细

5.9.13 报告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

5.9.14 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权证投资明细

5.9.15 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.16 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.17 投资组合报告附注

5.9.18 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.9.19 报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.9.20 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	238,499.41
2	应收证券清算款	39,999,924.70
3	应收股利	-
4	应收利息	110,210,843.44
5	其他应收款	10,658,115.19
6	其他	-
7	待转资产	-
8	其他	-
9	合计	160,506,382.74

5.9.21 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.9.22 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.9.23 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.9.24 开放式基金份额变动

单位:份	项目	数量
	本报告期基金份额总额	3,668,327,960.08
	本报告期基金总申购份额	225,226,468.02
	本报告期基金总赎回份额	495,218,627.63
	本报告期基金净申购份额	2,798,335,430.47

## 浙商沪深300指数分级证券投资基金

### 2013 第二季度 报告

2013年6月30日

**基金管理人：浙商基金管理有限公司**  
**基金托管人：华夏银行股份有限公司**  
报告送出日期：2013年07月17日**1.1 重要提示**  
基金管理人的董事会及董事承诺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责任。  
基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年7月15日复核了本报告中的财务数据、净值表现和投资组合等内容的真实性和准确性。  
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预示其未来表现，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。  
本报告自2013年4月1日起至6月30日止。

基金名称	浙商沪深300指数分级证券投资基金
基金代码	166002
基金简称	沪深300分级
基金管理人	浙商基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告截止日期	2013年6月30日
基金净值	118,442,634.05

注：截至2013年6月30日，浙商沪深300指数分级证券投资基金资产净值为118,442,634.05元，基金份额净值为1.184元，累计基金份额净值为1.184元。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	92,953,437.75	92.96
2	固定收益	92,953,437.75	92.96
3	应收股利	-	-
4	其他资产	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他	-	-
9	合计	99,966,724.63	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	588,022.41	0.56
B	采矿业	6,886,501.27	6.97
C	制造业	33,282,262.44	33.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,588,865.35	2.62
E	建筑业	3,510,406.34	3.53
F			