上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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：二〇一三年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	490,765,416.36份
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	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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	50,879,830.18
2.本期利润	57,774,612.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.1053
4.期末基金资产净值	535,083,783.36
5.期末基金份额净值	1.090

注：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。

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 本报告期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

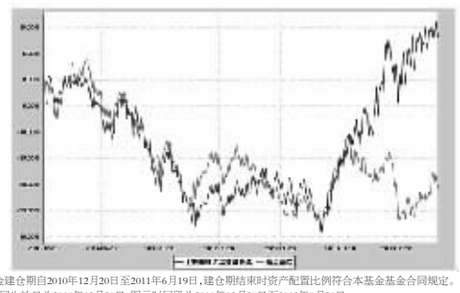
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.88%	1.40%	8.11%	1.22%	1.77%	0.18%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

累计份额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2013年9月30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2013年9月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗建辉	本基金基金经理	2010-12-20	2013-8-21	14年	南京大学管理学硕士，1999年7月至2002年9月在东方证券有限责任公司资产管理部从事投资研究工作；2002年10月至2005年5月在金鹰基金管理有限公司从事投资研究工作；2005年5月至2009年7月在平安资产管理有限责任公司从事成长股票组合的管理工作；2009年7月加入上投摩根基金管理有限公司，主要从事股票市场及上市公司营运及相关产业投资研究的工作。2009年10月起任上投摩根双核平衡混合型证券投资基金基金经理，2010年12月至2013年8月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6月起同时担任上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金经理。
征茂平	本基金基金经理	2013-7-22	-	12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。

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.罗建辉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遵规守信情况的说明

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。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 公平交易专项说明

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抽检价格公允性；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、交易方向等的分析，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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%的情形共计发生1次，为指数基金在建仓期被动跟踪标的指数和其他投资组合发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度国内经济数据好转主要基于政府上半年稳增长背景下的投资回升及企业去库存带来的短期盈利好转，其持续性仍有待观察。三季度本基金仍以成长股为核心仓位，鉴于上半年成长股和传媒等新兴产业的涨幅巨大，本基金在三季度适当减持了信息消费、传媒等行业的持股比例，而增加了金融等低估值行业的配置，以增加组合的防御性。从投资结果看，本基金三季度的配置和市场板块出现一定偏差；基于经济反弹的持续性较差，三季度市场主题投资盛行，同时传媒、信息消费等行业受到市场热烈追捧，而周期股继续在低位震荡；加之基本没有参与其他主题性投资，因此本基金三季度净值表现一般。

考虑到四季度全球流动性环境的预期改变和国内货币政策趋于审慎，加之国内经济将再次面临一定的下行压力，因此对四季度的行情总体趋于谨慎，总体认为四季度可能是全年投资最艰难阶段；前期涨幅巨大的成长股以及主题投资板块面临巨大的获利回吐压力，而周期股套利空间也越来越收窄。在操作上，本基金将重点关注持续成长能力较强的医药、大众消费品、电子消费等行业；在市场回调时关注行业内成长性突出、具有较强竞争优势的个股，同时重点关注部分低估值的大盘蓝筹股，以增强组合的防御性。

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9.88%，同期业绩比较基准收益率为8.11%。

§5 投资组合报告

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	454,807,976.12	84.31
	其中：股票	454,807,976.12	84.31
2	固定收益投资	29,925,000.00	5.55
	其中：债券	29,925,000.00	5.55
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	53,457,426.45	9.91
6	其他各项资产	1,273,271.87	0.24
7	合计	539,463,674.44	100.00

注：截至2013年9月30日，上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金资产净值为535,083,783.36元，基金份额净值为1.090元，累计基金份额净值为1.090元。

5.2 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	301,039,360.54	56.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,625,302.04	1.61
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	41,657,399.71	7.79
J	金融业	77,814,377.73	14.54
K	房地产业	6,826,500.00	1.28
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	18,845,036.10	3.52
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	454,807,976.12	85.00

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	002236	大华股份	1,088,749	46,752,629.42	8.74
2	002241	歌尔声学	915,550	38,709,454.00	7.23
3	002353	杰瑞股份	398,855	27,951,758.40	5.22
4	002038	双鹭药业	494,077	27,594,200.45	5.16
5	600406	国电南瑞	1,726,449	24,947,188.05	4.66
6	002415	海康威视	782,228	20,650,819.20	3.86
7	601633	长城汽车	379,494	19,384,553.52	3.62
8	300070	碧水源	463,023	18,845,036.10	3.52
9	000800	一汽轿车	1,246,600	16,542,382.00	3.09
10	601318	中国平安	431,000	15,386,700.00	2.88

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,925,000.00	5.59
	其中：政策性金融债	29,925,000.00	5.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	29,925,000.00	5.59

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国开01	300,000	29,925,000.00	5.59

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 报告期内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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	421,512.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	731,473.08
5	应收申购款	120,286.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,273,271.87

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002236	大华股份	13,764,150.00	2.57	非公开发行流通受限

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	613,832,627.27
本报告期基金总申购份额	24,035,504.12
减：本报告期基金总赎回份额	147,102,715.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	490,765,416.36

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1. 中国证监会批准上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金设立的文件；

8.1.2. 《上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金基金合同》；

8.1.3. 《上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金托管协议》；

8.1.4. 《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

8.1.5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；

8.1.6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一三年十月二十五日

上投摩根成长先锋股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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：二〇一三年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根成长先锋股票
基金主代码	378010
交易代码	378010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月20日
报告期末基金份额总额	2,701,995,973.39份
投资目标	本基金主要投资于国内市场上展现最佳成长特质的股票，积极捕捉高成长性上市公司所带来的投资机会，努力实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	(1)股票投资策略 本基金采取定量分析与定性分析相结合方式，挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司，主动出击、积极管理将是本基金运作的重要特色。(2)固定收益类投资策略 本基金以股票投资为主，一般市场情况下，基金管理人不会积极追求大类资产配置，但为进一步控制投资风险，优化组合流动性管理，本基金将适度防御性资产配置，进行债券、货币市场工具等品种投资。 在券种选择上，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。
业绩比较基准	富时中国A600成长指数×80%+同业存款利率×20%
风险收益特征	本基金是主动型股票基金，属于证券投资基金的高风险品种，预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	157,285,523.06
2.本期利润	389,230,528.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.1378
4.期末基金资产净值	3,979,386,905.58
5.期末基金份额净值	1.4728

注：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。

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 本报告期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

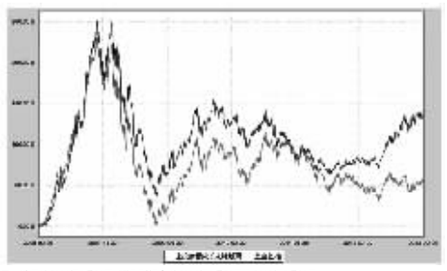
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.12%	1.36%	8.77%	1.09%	1.35%	0.27%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

上投摩根成长先锋股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2006年9月20日至2013年9月30日）



注：本基金合同生效日为2006年9月20日，图示时间段为2006年9月20日至2013年9月30日。

本基金建仓期自2006年9月20日至2007年3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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
唐倩	本基金基金经理	2011-4-28	2013-7-8	13年	华东师范大学金融学硕士，2000年至2004年在申银万国证券研究所任分析师；2004年至2006年在中银国际有限公司任分析师；2006年至2007年在香港雷曼兄弟证券公司任研究员；2007年加入上投摩根基金管理有限公司，先后任行业专家、研究部副总监、总监，负责研究及部门管理工作。自2011年4月起担任上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金经理。
罗建辉	本基金基金经理	2013-6-20	-	14年	南京大学管理学硕士，1999年7月至2002年9月在东方证券有限责任公司资产管理部从事投资研究工作；2002年10月至2005年5月在金鹰基金管理有限公司从事投资研究工作；2005年5月至2009年7月在平安资产管理有限责任公司从事成长股票组合的管理工作；2009年7月加入上投摩根基金管理有限公司，主要从事股票市场及上市公司营运及相关产业投资研究的工作。2009年10月起任上投摩根双核平衡混合型证券投资基金基金经理，2010年12月至2013年8月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6月起同时担任上投摩根成长先锋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遵规守信情况的说明

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。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根成长先锋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 公平交易专项说明

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抽检价格公允性；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、交易方向等的分析，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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%的情形共计发生1次，为指数基金在建仓期被动跟踪标的指数和其他投资组合发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

7月底，为遏制经济下滑的趋势，政府及时将经济工作重心转向稳增长，并出台了一系列政策措施，经济数据拐头上行。本基金在报告期内集中于成长股投资，重点布局了电子、传媒、计算机、信息设备、食品制造等行业，基金业绩稳步上升。

从目前已公布的经济数据看，全年7.5%的增长目标已实现无忧，稳增长的政策前提不复存在，投资力度在四季度可能会减弱。另一方面，受QE退出影响，海外经济形势可能出现动荡，出口前景不明朗。经过三季度的复苏后，经济在四季度可能将逐渐走弱，经过前期大幅上涨后，成长股的估值已偏高，市场的结构性机会较三季度将有所减少，四季度的市场动荡将会加剧。我们的组合将继续重点关注高景气度的行业，同时积极关注有估值优势、有主题催化的行业。四季度相对看好电子、信息设备、计算机、商业、服装、光伏等行业的投资机会。

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10.12%，同期业绩比较基准收益率为8.77%。

§5 投资组合报告

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	3,420,453,779.63	83.32
	其中：股票	3,420,453,779.63	83.32
2	固定收益投资	250,220,682.09	6.10
	其中：债券	250,220,682.09	6.10
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	413,712,017.01	10.08
6	其他各项资产	20,580,976.15	0.50
7	合计	4,104,967,454.88	100.00

注：截至2013年9月30日，上投摩根成长先锋股票型证券投资基金资产净值为3,979,386,905.58元，基金份额净值为1.4728元，累计基金份额净值为2.3418元。

5.2 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	7,586,425.49	0.19
C	制造业	2,307,057,690.45	57.98
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	94,844,825.88	2.38
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	415,638,233.91	10.44
J	金融业	175,393,182.40	4.41
K	房地产业	52,796,831.28	1.33
L	租赁和商务服务业	55,124,835.50	1.39
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	92,209,812.80	2.32
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	180,603,852.32	4.54
S	综合	39,198,089.60	0.99
	合计	3,420,453,779.63	85.95

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

代码	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	002236	大华股份	5,595,000	236,171,450.00	5.93
2	002241	歌尔声学	5,000,000	211,400,000.00	5.31
3	002450	康得新	7,712,400	184,943,352.00	4.65
4	600597	光明乳业	6,700,000	158,053,000.00	3.97
5	002353	杰瑞股份	2,116,860	148,349,548.80	3.73
6	000538	云南白药	1,056,897	123,720,362.82	3.11
7	600887	伊利股份	2,632,661	117,627,293.48	2.96
8	601633	长城汽车	2,067,987	105,632,775.96	2.65
9	002038	双鹭药业	1,800,000	100,530,000.00	2.53
10	600867	通化东宝	5,274,297	92,985,856.11	2.34

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	249,350,000.00	6.27
	其中：政策性金融债	249,350,000.00	6.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	870,682.09	0.02
8	其他	-	-
9	合计	250,220,682.09	6.29

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120245	12国开45	2,000,000	199,720,000.00	5.02
2	130308	13进出08	500,000	49,630,000.00	1.25
3	128003	华天转债	7,094	870,682.09	0.02

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 报告期内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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,368,821.74
2	应收证券清算款	12,550,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	6,244,845.16
5	应收申购款	417,309.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,580,976.15

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002236	大华股份	90,315,450.00	2.27	非公开发行流通受限

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	2,977,489,639.12
本报告期基金总申购份额	60,022,840.73
减：本报告期基金总赎回份额	335,516,506.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,701,995,973.39

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1. 中国证监会批准上投摩根成长先锋股票型证券投资基金设立的文件；

8.1.2. 《上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金合同》；

8.1.3. 《上投摩根成长先锋股票型证券投资基金托管协议》；

8.1.4. 《上投摩根开放式基金业务规则》；

8.1.5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；

8.1.6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一三年十月二十五日

上投摩根纯债债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2013年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根纯债债券
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月24日
报告期末基金份额总额	68,743,542.36份
投资目标	本基金将根据对利率趋势的预判，适时规划与调整组合目标久期，结合主动性资产配置，在严格控制组合投资风险的同时，提高基金资产流动性与收益性水平，以追求超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	目标久期管理将优化固定收益投资的安全性、收益性与流动性。本基金严格遵循投资流程，对宏观经济、财政货币政策、市场利率水平及债券发行主体的信用情况等因素进行深入研究，通过审慎把握利率期限结构的变动趋势，适时制定目标久期管理计划，通过合理的资产配置及组合目标久期管理，控制投资风险，追求可持续的、超出业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中国债券总指数。
风险收益特征	本基金是债券型基金，在证券投资基金中属于较低风险品种，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于货币市场基金。
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
下属两级基金的基金简称	上投摩根纯债债券A　上投摩根纯债债券B
下属两级基金的交易代码	371020　371120
报告期末下属两级基金的份额总额	30,473,329.38份　38,270,212.98份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)	
	上投摩根纯债债券A	上投摩根纯债债券B
1.本期已实现收益	-968.51	-53,275.62
2.本期利润	269,831.89	258,241.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0075	0.006
4.期末基金资产净值	33,586,942.09	41,414,967.86
5.期末基金份额净值	1.102	1.082

注：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。

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.