

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金

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

1.1 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。

本报告财务资料未经审计。
本报告自2013年7月1日起至9月30日止。

1.2 基金产品概况

基金名称	上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金
基金代码	379023
交易代码	379023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月28日
跟踪标的名称	中证消费服务领先指数
投资目标	本基金投资于标的指数成份股，通过严谨的投资流程和风险控制手段管理风险，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.30%，年跟踪误差不超过4%，以实现对中证消费服务领先指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用完全复制策略，按照标的指数的构成及其权重构建投资组合，并跟踪标的指数的表现。本基金将根据标的指数的成份股及其权重构建投资组合，并跟踪标的指数的表现。本基金将根据标的指数的成份股及其权重构建投资组合，并跟踪标的指数的表现。
业绩比较基准	95%×中证消费服务领先指数收益率+5%×银行同期活期存款利率
风险收益特征	本基金为股票型基金，长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币型基金，为高风险、中高收益产品。
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

序号	代码	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资		66,371,081.28	90.63
2	固定收益投资		66,371,081.28	90.63
3	其中:债券		-	-
4	其中:股票		-	-
5	货币资金		-	-
6	其中:买入返售金融资产		-	-
7	其中:应收利息		8,044,119.18	8.61
8	其他资产		807,179.30	0.96
9	合计		95,692,552.16	100.00

注:截至2013年9月30日,上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金资产净值为91,431,949.51元,基金份额净值为1.136元,累计基金份额净值为1.216元。

1.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.3.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

1.3.2 指数投资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	医药、生物制品	-	-
B	制造业	-	-
C	建筑业	31,583,819.92	34.55
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,647,286.37	13.88
G	房地产业	-	-
H	信息技术业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,824,068.78	12.97
J	金融业	15,904,643.81	17.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,479,196.42	3.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,483,576.76	7.09
O	交通运输、仓储和邮政业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,080,839.30	4.50
S	其他	-	-
T	合计	66,371,081.28	90.63

1.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

1.4.1 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	002024	苏宁电器	397,895	5,112,488.15	5.59
2	600897	伊利股份	64,431	2,508,284.34	2.75
3	600527	华海药业	67,718	2,027,672.38	2.23
4	600519	贵州茅台	16,935	2,574,120.50	2.83
5	30027	华谊兄弟	32,015	2,493,392.20	2.75
6	600166	长城铝业	244,511	2,334,613.56	2.55
7	600538	圣龙股份	18,790	2,195,098.34	2.40
8	600016	民生银行	119,621	2,099,610.40	2.30
9	600016	民生银行	178,621	1,956,414.60	2.15
10	300070	碧水源	47,631	1,508,541.70	1.63

1.5 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

本基金本报告期末未持有积极投资债券。

1.6 报告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。

1.7 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。

1.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

1.9 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。

1.10 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。

1.11 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的贵州茅台酒股份有限公司(下称:贵州茅台,股票代码:600519)于2013年2月23日公告其控股子公司贵州茅台销售有限公司于2013年2月22日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》(黔价处罚[2013]5),该决定书认为:贵州茅台销售有限公司对全国经销商向第三人销售茅台酒最低价格进行限制,违反了《中华人民共和国反垄断法》第十四条的规定。为此,根据《中华人民共和国反垄断法》第四十九条、《中华人民共和国行政处罚法》第二十七条的规定给予处罚:限贵州茅台销售有限公司自收到该决定书之日起十五日内将罚款二万四千元汇入人民币上划国库。

对上述事项投资决策程序的说明:本基金是一只被动式指数基金,投资目标是通过对指数的跟踪和数量化风险管理策略,以实现中证消费服务领先指数的有效跟踪。本基金采用完全复制策略,按照标的指数成份股及其权重构建股票资产组合。贵州茅台是“中证消费服务领先指数”的成份股,本基金对贵州茅台的投资按照其所占中证消费服务领先指数的权重来买入;在本报告期内,本基金对贵州茅台的投资未违反上述限制。

本基金本报告期末投资的前五名股票中不存在流通受限的情况。

本基金本报告期末持有的公允价值在九元以上的证券发行主体本期未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 报告期末本基金投资的前十名股票中没有超出基金合同规定的备选股票范围。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,661.53
2	应收股利	-
3	应收利息	8,044,119.18
4	其他应收款	1,677.11
5	预付账款	8,045,058.50
6	其他流动资产	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	807,179.30

1.12 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。

1.13 期末按指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

1.14 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。

1.15 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。

1.16 投资组合报告附注

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。

1.17 期末按指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

1.18 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。

1.19 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。

1.20 投资组合报告附注

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。

1.21 期末按指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

1.22 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。

1.23 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。

1.24 投资组合报告附注

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。

1.25 期末按指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

1.26 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。

1.27 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。

1.28 投资组合报告附注

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。

1.29 期末按指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

1.30 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。

1.31 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。

1.32 投资组合报告附注

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。

1.33 期末按指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

1.34 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。

1.35 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。

1.36 投资组合报告附注

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。

1.37 期末按指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

1.38 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。

1.39 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。

1.40 投资组合报告附注

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。

1.41 期末按指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

1.42 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。

1.43 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。

1.44 投资组合报告附注

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。

1.45 期末按指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

1.46 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。

1.47 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。

1.48 投资组合报告附注

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。

1.49 期末按指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

1.50 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。

1.51 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。

1.52 投资组合报告附注

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。

1.53 期末按指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

1.54 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。

1.55 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。

1.56 投资组合报告附注

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。

1.57 期末按指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

1.58 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。

1.59 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。

1.60 投资组合报告附注

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。

1.61 期末按指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

1.62 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。

1.63 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。

1.64 投资组合报告附注

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。

1.65 期末按指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限的情况。

1.66 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。

1.67 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。

1.68 投资组合报告附注

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。