# 上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金

## 2014 第一季度 报告

2014年3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:二〇一四年四月十九日**

### §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2014年4月18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2014年1月1日起至3月31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 | 310,842,556.66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"约精选个股,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(2014年1月1日-2014年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 8,570,218.64 |
| 2.本期利润 | -36,897,917.66 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1142 |
| 4.期末基金资产净值 | 286,377,958.17 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.921 |

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 | -11.61% | 1.38% | -6.59% | 1.01% | -5.02% | 0.37% |

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

上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年12月20日至2014年3月31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2014年3月31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 | | |
| 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月起担任上投摩根红利回报混合型证券投资基金基金经理,自2014年1月起同时担任上投摩根阿尔法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的说明

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,严格防范对于风险并检查价格公允性;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;无。

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

2014年一季度国内经济继续回落,但投资主线较为混乱:市场对创业板、中小板的炒作仍以存量资金博弈、主题炒作为主,但实际获取收益相对较难,因此本基金一季度仍以盈利增长明确的成长股为核心仓位,策略上以防御为主:超配医药行业,增加食品类行业龙头的配置比例,同时在底部适当增持了部分低估值周期性品种,从投资结果看,由于本基金重仓持有的核心品种因多种因素在一季度出现较大幅度的调整,进而导致净值表现出现较大波动。

在一季度经济数据低于预期的背景下,二季度的投资主线会相对清晰:稳增长带来的政策拐点将使得相关主题投资机会持续,而前期回落的白马成长股也将出现较好的投资机会。另一方面,二季度市场仍将面临信用风险扩散、IPO 重启、流动性环境存在较大不确定性等因素影响,因此判断市场二季度行情仍以防御为主,在操作上,本基金仍将重点关注持续成长能力较强的医药、大众消费品、消费电子等行业,回避估值高企的创业板个股,在市场回调时重点关注行业内成长性突出、具有较强竞争优势的个股,优化组合结构。

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-11.61%,同期业绩比较基准收益率为-6.59%。

### §5投资组合报告

5.1报告期本基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 235,529,748.54 | 80.80 |
| | 其中:股票 | 235,529,748.54 | 80.80 |
| 2 | 固定收益投资 | 9,989,000.00 | 3.43 |
| | 其中:债券 | 9,989,000.00 | 3.43 |
| | 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 | 45,205,362.41 | 15.51 |
| 7 | 其他资产 | 780,461.24 | 0.27 |
| 8 | 合计 | 291,504,572.19 | 100.00 |

注:截至2014年3月31日,上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金资产净值为286,377,958.17元,基金份额净值为0.921元,累计基金份额净值为0.921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 | 11,319,517.03 | 3.95 |
| C | 制造业 | 174,185,013.09 | 60.82 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 1,343,100.00 | 0.47 |
| F | 批发和零售业 | 18,206,403.00 | 6.36 |
| 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 | 9,466,393.90 | 3.31 |
| J | 金融业 | 7,222,902.12 | 2.52 |
| K | 房地产业 | 4,116,974.40 | 1.44 |
| L | 租赁和商务服务业 | 240,397.50 | 0.08 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 9,429,047.50 | 3.29 |
| 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 | 235,529,748.54 | 82.24 |

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 | 002353 | 杰瑞股份 | 398,500 | 23,989,700.00 | 8.38 |
| 2 | 002236 | 大华股份 | 772,546 | 22,087,090.14 | 7.71 |
| 3 | 000661 | 长春高新 | 184,904 | 17,806,255.20 | 6.22 |
| 4 | 002038 | 双鹭药业 | 400,704 | 15,587,385.60 | 5.44 |
| 5 | 002191 | 劲嘉股份 | 849,610 | 13,151,962.80 | 4.59 |
| 6 | 600518 | 康美药业 | 757,200 | 12,266,640.00 | 4.28 |
| 7 | 600028 | 中国石化 | 2,250,401 | 11,319,517.03 | 3.95 |
| 8 | 600998 | 九州通 | 618,120 | 9,889,920.00 | 3.45 |
| 9 | 002241 | 歌尔声学 | 340,806 | 8,724,633.60 | 3.05 |
| 10 | 000516 | 开元投资 | 1,159,900 | 8,316,483.00 | 2.90 |

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 | 9,989,000.00 | 3.49 |
| | 其中:政策性金融债 | 9,989,000.00 | 3.49 |
| 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 | 9,989,000.00 | 3.49 |

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(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 130236 | 13国开36 | 100,000 | 9,989,000.00 | 3.49 |

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8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。

5.9 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。

5.10 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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1

1.本基金投资的长春高新技术产业(集团)股份有限公司(下称:长春高新,股票代码:000661)于2013年9月24日收到深圳证券交易所《关于对长春高新技术产业(集团)股份有限公司及相关当事人给予处分的决定》(下称:《决定》),《决定》指出:1、长春高新间接控股股东长春高新技术产业发展公司的关联人及其子公司长期非经营性资金占用,且长春高新对此未予披露.2、长春高新间接控股股东长春高新技术产业发展总公司的关联人及其子公司长期非经营性占用长春高新资金2974.62万元。上述款项均已收回。鉴于上述违规事实,依据有关规定,决定对长春高新及其董事、独立董事、时任董事、监事、财务总监予以通报批评的处分,并记入上市公司诚信档案,并抄报有关部门。

对上述股票投资决策程序的说明:本基金管理人在投资长春高新前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库,由研究员跟踪并分析。上述事件发生后,本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

2.本基金投资的中国石油化工股份有限公司(下称:中国石化,股票代码:600028)于2013年11月24日发布公告:2013年11月22日凌晨,中国石化位于青岛经济技术开发区的原油管道发生泄漏,导致原油泄漏,部分原油漏入市政排水暗渠,流入海岸。当日上午10点30分左右,市政排水暗渠发生爆燃,导致周边行人、抢险人员伤亡的重大事故。关于此次事故发生的原因以及有关事宜,中国政府已派出事故调查组进行全面调查。中国石化于2014年1月12日就前述事件再次发布公告:国务院对山东省青岛市"11?22"中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告作出批复,同意国务院事故调查组的调查处理结果,认定是一起特别重大责任事故;同意对事故有关责任单位和责任人的处理建议,对中国石化及当地政府的48名责任人分别给予纪律处分,对涉嫌犯罪的15名责任人移送司法机关依法追究法律责任。

对上述股票投资决策程序的说明:本基金管理人在投资中国石化前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库,由研究员跟踪并分析。上述事件发生后,本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

除上述股票外,本基金投资的其余前八名证券的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。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 259,865.90 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 270,838.27 |
| 5 | 应收申购款 | 249,757.07 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 780,461.24 |

5.11.4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。

5.11.5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 | 000661 | 长春高新 | 17,806,255.20 | 6.22 | 公告重大事项 |
| 2 | 002236 | 大华股份 | 10,435,350.00 | 3.64 | 非公开发行流通受限 |
| 3 | 600998 | 九州通 | 9,889,920.00 | 3.45 | 筹划股权激励事宜 |

5.11.6 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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 343,009,465.95 |
| 报告期基金总申购份额 | 9,268,528.31 |
| 减:报告期基金总赎回份额 | 41,435,437.60 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 310,842,556.66 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

### §8影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

### §9 备查文件目录

9.1备查文件目录

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;
2.《上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金基金合同》;
3.《上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金托管协议》;
4.《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照;
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3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**
**二〇一四年四月十九日**

# 上投摩根分红添利债券型证券投资基金

## 2014 第一季度 报告

2014年3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:中国银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一四年四月十九日**

### §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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

### §2基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 上投摩根分红添利债券 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2012年6月25日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 81,938,248.23份 | |
| 投资目标 | 在有效控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极主动的投资管理,力争为投资者创造稳定的当期收益和长期回报。 | |
| 投资策略 | 本基金采取自上而下的方法确定组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。通过对固定收益资产的投资,获取稳定的投资收益;在此基础上,适当参与新股发行申购及增发新股申购,在严格控制基金资产运作风险的基础上,实现基金资产的长期增值。 | |
| 业绩比较基准 | 中信标普全债指数。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 上投摩根基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 上投摩根分红添利债券A类 | 上投摩根分红添利债券B类 |
| 下属两级基金的交易代码 | 370021 | 370022 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 67,979,342.32份 | 13,958,905.91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(2014年1月1日-2014年3月31日) | |
|---|---|---|
| | 上投摩根分红添利债券A类 | 上投摩根分红添利债券B类 |
| 1.本期已实现收益 | -1,449,790.49 | -1,730,855.98 |
| 2.本期利润 | 627,665.70 | -992,338.67 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0082 | -0.0302 |
| 4.期末基金资产净值 | 67,065,833.97 | 13,736,021.96 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.987 | 0.984 |

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

上投摩根分红添利债券A类:

| 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 | 1.02% | 0.21% | 1.42% | 0.05% | -0.40% | 0.16% |

上投摩根分红添利债券B类:

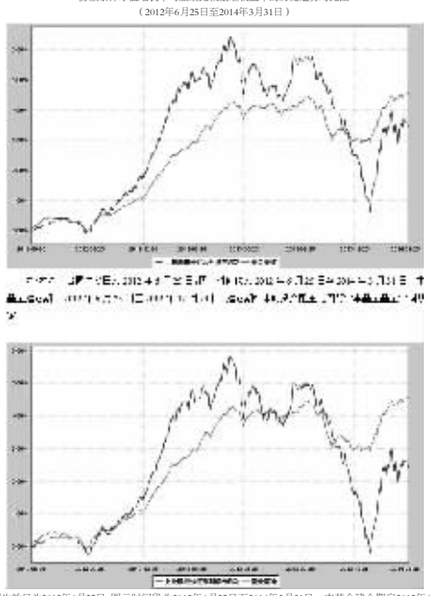
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.92% | 0.21% | 1.42% | 0.05% | -0.50% | 0.16% |

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

上投摩根分红添利债券型证券投资基金

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

(2012年6月25日至2014年3月31日)



注:本基金合同生效日为2012年6月25日,图示时间段为2012年6月25日至2014年3月31日。本基金建仓期自2012年6月25日至2012年12月24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 | | |
| 赵峰 | 本基金基金经理 | 2012-6-25 | - | 11年 | 上海财经大学金融学硕士。2003年4月至2006年5月在申银万国证券研究所担任研究员负责债券研究方面的工作;2006年6月至2011年3月在富国基金管理有限公司担任投资经理负责债券投资方面的工作;2011年4月加入上投摩根基金管理有限公司,2011年9月起任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理,2012年6月起任上投摩根分红添利债券型证券投资基金基金经理,2013年7月起任上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金经理,2013年8月起同时担任上投摩根罗罗赢定期开放债券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.赵峰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。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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,《上投摩根分红添利债券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,本公司通过对于库控制和交易室询价机制,严格防范对于风险并检查价格公允性;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;无。

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

2014年一季度经济继续处于下行状态,市场流动性仍处于相对紧张状态。在此背景下,市场选择放弃相对大市值的股票,转向偏主题的小市值股票,市场风险偏好不断拔高,风险也随之积累。主板市场逐步下跌,创业板也呈现冲高回落。在此过程中,一批中长期成长逻辑并未发生变化的中大市值股票下跌幅度较大,受此影响本基金在一季度表现不佳。

2014年中国经济进入到比较关键的时期,转型过程中需要面临的困难可能出现,经济增长失速也不排除发生的可能,政府在目前状况下,一方面需要把握经济结构调整的大方向,另一方面又需要稳定经济避免出现不可控的局面,政策的难度确实较大,证券市场对此也将做出相应的反应,中长期有成长前景的公司在挤掉泡沫后仍会有很大机会,另外,受益于经济刺激政策的低估值传统行业监筹也存在修复性的投资机会。

在一季报后市场将按照业绩对公司进行甄别,一批真正优质的公司也许将脱颖而出,本基金将认真进行优化选择,为持有人挑选出那些真正能够创造价值的公司。

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-13.16%,同期业绩比较基准收益率为-6.16%。

### §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 | 1,033,707,204.63 | 88.65 |
| | 其中:股票 | 1,033,707,204.63 | 88.65 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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 | 130,849,935.38 | 11.22 |
| 7 | 其他资产 | 1,462,230.29 | 0.13 |
| 8 | 合计 | 1,166,019,370.30 | 100.00 |

注:截至2014年3月31日,上投摩根分红添利债券型证券投资基金资产净值为80,801,855.93元,上投摩根分红添利基金A类份额净值为0.987元,累计基金份额净值为1.035元;上投摩根分红添利基金B类份额净值为0.984元,累计基金份额净值为1.025元。

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 | 13,222,721.60 | 16.36 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 10,000,000.00 | 12.38 |
| | 其中:政策性金融债 | 10,000,000.00 | 12.38 |
| 4 | 企业债券 | 85,871,701.00 | 106.27 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 9,645,750.86 | 11.94 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 118,740,173.46 | 146.95 |

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(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 130218 | 13国开18 | 100,000 | 10,000,000.00 | 12.38 |
| 2 | 010107 | 21国债(7) | 70,400 | 7,012,544.00 | 8.68 |
| 3 | 122020 | 09冀地债 | 50,000 | 5,035,000.00 | 6.23 |
| 4 | 019322 | 13国债22 | 50,000 | 5,025,000.00 | 6.22 |
| 5 | 122831 | 11邕通债 | 44,990 | 4,534,992.00 | 5.61 |

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8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。

5.9 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。

5.10 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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 61,364.71 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,925,644.55 |
| 5 | 应收申购款 | 3,284.84 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,990,294.10 |

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 110015 | 石化转债 | 2,047,400.00 | 2.53 |
| 2 | 125887 | 中鼎转债 | 1,539,525.00 | 1.91 |
| 3 | 128001 | 泰尔转债 | 1,497,407.12 | 1.85 |
| 4 | 110024 | 隧道转债 | 827,280.00 | 1.02 |
| 5 | 126729 | 燕京转债 | 717,030.18 | 0.89 |
| 6 | 128003 | 华天转债 | 137,748.48 | 0.17 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6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

| | 上投摩根分红添利债券A类 | 上投摩根分红添利债券B类 |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 89,891,920.39 | 113,216,401.52 |
| 报告期基金总申购份额 | 1,076,270.74 | 949,644.74 |
| 减:报告期基金总赎回份额 | 22,988,848.81 | 100,207,140.35 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 67,979,342.32 | 13,958,905.91 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

### §8 备查文件目录

8.1备查文件目录

1. 中国证监会批准上投摩根分红添利债券型证券投资基金设立的文件;
2.《上投摩根分红添利债券型证券投资基金基金合同》;
3.《上投摩根分红添利债券型证券投资基金托管协议》;
4.《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照;
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**
**二〇一四年四月十九日**

# 上投摩根智选30股票型证券投资基金

## 2014 第一季度 报告

2014年3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:二〇一四年四月十九日**

### §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2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

### §2基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 上投摩根智选30股票 |
| 基金主代码 | 370027 |
| 交易代码 | 370027 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年3月6日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,156,823,566.80份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于受益于国家经济转型,具有较高增长潜力的上市公司股票,在有效控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。 |
| 投资策略 | 从长期来看,盈利的增长是推动公司股价上涨的重要因素,本基金将集中投资于具有良好业绩支撑和确定性成长的公司,以分享其股价上涨带来的收益。从具体操作上,本基金将通过严格的个股精选,筛选出具有较高竞争优势和成长能力的上市公司,并从中挑选出基金管理人认定的最具投资价值的30只左右的股票构建投资组合,以实现对优质股票的集中持股。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金是一只主动投资的股票型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于较高风险、较高预期收益的基金产品。 |
| 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(2014年1月1日-2014年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 36,890,147.97 |
| 2.本期利润 | -179,367,522.60 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1360 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,160,791,748.23 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.003 |

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