

上投摩根核心优选股票型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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:二〇一四年七月二十一日

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。

1.2 基金产品概况
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
基金运作方式:契约型开放式

1.3 主要财务指标和基金净值表现
截至2014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802,170,086.15元,基金份额净值为1.427元。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, etc.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, etc.

3.2 基金净值表现
本基金采用国际通用的基金业绩比较基准:沪深300指数收益率\*85%+上证国债指数收益率\*15%。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率(%)。Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 自基金合同生效以来。

3.2.2 基金合同生效以来基金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
上投摩根核心优选股票型证券投资基金
自2012年11月28日基金合同生效日至2014年6月30日



4.1 基金投资组合报告
4.1.1 报告期末基金资产组合情况
4.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)。Rows include 1.权益投资, 2.固定收益投资, etc.

Table with 2 columns: 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(%)。Rows include 1. 002241 聚兴科学, 2. 002253 英派股份, etc.

4.1.3 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债券投资明细

Table with 2 columns: 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(%)。Rows include 1. 110825 国债08, 2. 110826 国债08, etc.

4.1.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 资产支持证券代码, 资产支持证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)。Rows include 1. 110825 国债08, 2. 110826 国债08, etc.

4.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

Table with 2 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)。Rows include 1. 110825 国债08, 2. 110826 国债08, etc.

4.1.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

4.1.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

4.1.8 投资组合报告附注

4.2 衍生品投资情况

4.3 资产支持证券投资情况

4.4 其他资产

4.5 基金投资组合报告附注

4.6 基金业绩比较基准

4.7 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.8 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.9 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.10 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.11 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.12 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.13 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.14 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.15 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.16 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

上投摩根智选30股票型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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:二〇一四年七月二十一日

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。

1.2 基金产品概况
基金名称:上投摩根智选30股票型证券投资基金
基金代码:370027
基金运作方式:契约型开放式

1.3 主要财务指标和基金净值表现
截至2014年6月30日,上投摩根智选30股票型证券投资基金资产净值为1,160,811,662.39元,基金份额净值为1.024元,累计基金份额净值为1.024元。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, etc.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, etc.

3.2 基金净值表现
本基金采用国际通用的基金业绩比较基准:沪深300指数收益率\*80%+上证国债指数收益率\*20%。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率(%)。Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 自基金合同生效以来。

3.2.2 基金合同生效以来基金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
上投摩根智选30股票型证券投资基金
自2013年3月6日基金合同生效日至2014年6月30日



4.1 基金投资组合报告
4.1.1 报告期末基金资产组合情况
4.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)。Rows include 1.权益投资, 2.固定收益投资, etc.

Table with 2 columns: 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(%)。Rows include 1. 002241 聚兴科学, 2. 002253 英派股份, etc.

4.1.3 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债券投资明细

Table with 2 columns: 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(%)。Rows include 1. 110825 国债08, 2. 110826 国债08, etc.

4.1.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 资产支持证券代码, 资产支持证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)。Rows include 1. 110825 国债08, 2. 110826 国债08, etc.

4.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

Table with 2 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)。Rows include 1. 110825 国债08, 2. 110826 国债08, etc.

4.1.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

4.1.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

4.1.8 投资组合报告附注

4.2 衍生品投资情况

4.3 资产支持证券投资情况

4.4 其他资产

4.5 基金投资组合报告附注

4.6 基金业绩比较基准

4.7 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.8 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.9 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.10 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.11 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.12 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.13 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.14 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.15 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.16 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

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:二〇一四年七月二十一日

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。

1.2 基金产品概况
基金名称:上投摩根智选30股票型证券投资基金
基金代码:370027
基金运作方式:契约型开放式

1.3 主要财务指标和基金净值表现
截至2014年6月30日,上投摩根智选30股票型证券投资基金资产净值为1,160,811,662.39元,基金份额净值为1.024元,累计基金份额净值为1.024元。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, etc.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, etc.

3.2 基金净值表现
本基金采用国际通用的基金业绩比较基准:沪深300指数收益率\*80%+上证国债指数收益率\*20%。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率(%)。Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 自基金合同生效以来。

3.2.2 基金合同生效以来基金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
上投摩根智选30股票型证券投资基金
自2013年3月6日基金合同生效日至2014年6月30日



4.1 基金投资组合报告
4.1.1 报告期末基金资产组合情况
4.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)。Rows include 1.权益投资, 2.固定收益投资, etc.

Table with 2 columns: 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(%)。Rows include 1. 002241 聚兴科学, 2. 002253 英派股份, etc.

4.1.3 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债券投资明细

Table with 2 columns: 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(%)。Rows include 1. 110825 国债08, 2. 110826 国债08, etc.

4.1.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 资产支持证券代码, 资产支持证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)。Rows include 1. 110825 国债08, 2. 110826 国债08, etc.

4.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

Table with 2 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)。Rows include 1. 110825 国债08, 2. 110826 国债08, etc.

4.1.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

4.1.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

4.1.8 投资组合报告附注

4.2 衍生品投资情况

4.3 资产支持证券投资情况

4.4 其他资产

4.5 基金投资组合报告附注

4.6 基金业绩比较基准

4.7 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.8 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.9 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.10 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.11 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.12 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.13 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.14 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.15 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

4.16 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况