

上投摩根智选 30 股票型证券投资基金

2013 年半年度报告摘要

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：二〇一三年八月二十七日

1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 3 月 6 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------|
| 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 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,130,169,334.89份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 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。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| | | |
|----|-------|-------|
| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|----|-------|-------|

| | | | |
|---------|--------------|--------------------------|----------------------|
| 名称 | 上投摩根基金管理有限公司 | | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 胥洪擎 | 田青 |
| | 联系电话 | 021-38794888 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | services@jpmf-sitico.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | 400-889-4888 | | 010-67595096 |
| 传真 | 021-68881170 | | 010-66275853 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.51fund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人的办公场所 |

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2013年3月6日（基金合同生效日）至2013年6月30日） |
|---------------|------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 17,182,961.42 |
| 本期利润 | 157,601,705.20 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0924 |
| 本期基金份额净值增长率 | 13.90% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2013年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0119 |
| 期末基金资产净值 | 2,426,393,589.84 |
| 期末基金份额净值 | 1.139 |

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本期公允价值变动收益。对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

2. 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. 本基金合同生效日为 2013 年 3 月 6 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -5.48% | 2.28% | -12.39% | 1.49% | 6.91% | 0.79% |
| 过去三个月 | 11.01% | 1.74% | -9.27% | 1.16% | 20.28% | 0.58% |
| 过去六个月 | - | - | - | - | - | - |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 13.90% | 1.52% | -12.67% | 1.13% | 26.57% | 0.39% |

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

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

上投摩根智选 30 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

(2013 年 3 月 6 日至 2013 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为 2013 年 3 月 6 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。根据基金合同的规定，本基金建仓期自基金合同生效之日起六个月。本基金在本报告期尚处在建仓期内。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准,于 2004 年 5 月 12 日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司(2007 年 10 月 8 日更名为“上海国际信托有限公司”)与摩根资产管理(英国)有限公司合资设立,注册资本为 2.5 亿元人民币,注册地上海。截至 2013 年 6 月底,公司管理的基金共有二十三只,均为开放式基金,分别是:上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根阿尔法股票型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋股票型证券投资基金、上投摩根内需动力股票型证券投资基金、上投摩根亚太优势股票型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘股票型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质股票型证券投资基金、上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金、上投摩根分红添利债券型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选股票型证券投资基金、上投摩根轮动添利债券型证券投资基金、上投摩根智选 30 股票型证券投资基金和上投摩根成长动力股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|---------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 杜猛 | 本基金基金经理 | 2013-3-6 | - | 10年 | 南京大学经济学硕士,先后任职于天同证券、中原证券、国信证券和中银国际证券,任研究员。2007年10月起加入上投摩根基金管理有限公司,历任行业专家、上投摩根中国优势 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>证券投资基金基金经理助理。 自2011年7月起担任上投摩根新兴动力股票型证券投资基金基金经理，自2013年3月起担任上投摩根智选30股票型证券投资基金基金经理，自2013年5月起同时担任上投摩根成长动力混合型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

- 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. 杜猛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合规守信情况的说明

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。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根智选 30 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，监察稽核部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、交易方向等的抽样分析，监察稽核部未发现存在异常交易行为。

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 管理人对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

2013 年上半年，中国经济依然呈现弱势运行状态，复苏力度低于年初预期。但政府对经济增速下降的容忍度不断提高，更多的是从长远经济发展的角度来制定相关政策。上半年证券市场市场指数呈现下跌走势，板块运行分化严重，周期类行业跌幅巨大，而医药、电子等新兴产业大幅上涨。本基金 3 月份成立，立足研究，精选个股，重点投资了 TMT、节能环保、能源机械、医药等行业的优质企业。

上半年证券市场下跌是多重原因造成的结果，但究其根本，我们认为深层次原因在于中国当前面临经济转型的重要时期，传统经济增长模式从中长期看已经无法再继续刺激和强化，而这类型行业的公司在 A 股市场占比非常高，投资者对其增长前景很难再有乐观情绪，市值占比下降是一个中长期趋势。

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 13.90%，同期业绩比较基准收益率为-12.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经济转型的背景下，我们认为符合经济发展规律和方向的新兴产业和消费行业在 GDP 中的比重将不断提高，反映到证券市场上也会是相同的趋势。关于成长和价值的争论并不会对投资形成太大的指导意义，关键在于认清经济结构调整的方向，把握产业升级和变迁的趋势，并从中寻找到能够创造社会价值的优秀企业。我们将不断的在这个方

向努力研究和挖掘，希望能持续稳定的为基金持有人创造投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员，参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未实施利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上投摩根智选 30 股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2013 年 6 月 30 日 |
|----------|---------|------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 244,715,323.44 |
| 结算备付金 | | 7,121,776.63 |
| 存出保证金 | | 548,581.97 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,182,315,810.32 |
| 其中：股票投资 | | 2,182,315,810.32 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | - |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - |
| 应收证券清算款 | | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 53,332.49 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 33,762,635.13 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 2,468,517,459.98 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2013 年 6 月 30 日 |
| 负债： | | |
| 短期借款 | | - |

| | | |
|---------------|----------|------------------|
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付证券清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | 36,309,800.94 |
| 应付管理人报酬 | | 2,989,197.43 |
| 应付托管费 | | 498,199.56 |
| 应付销售服务费 | | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 2,057,666.97 |
| 应交税费 | | - |
| 应付利息 | | - |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 269,005.24 |
| 负债合计 | | 42,123,870.14 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 2,130,169,334.89 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 296,224,254.95 |
| 所有者权益合计 | | 2,426,393,589.84 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,468,517,459.98 |

注：

1. 报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.139 元，基金份额总额 2,130,169,334.89 份。
2. 本财务报表的实际编制期间为 2013 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日，所有会计报表均无上年度可比会计期间。

6.2 利润表

会计主体：上投摩根智选 30 股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2013 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日 |
|-------------|----------|---|
| 一、收入 | | 171,731,243.95 |
| 1.利息收入 | | 2,045,762.37 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 1,256,348.75 |
| 债券利息收入 | | 225.07 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 789,188.55 |
| 其他利息收入 | | - |

| | | |
|---------------------------------|----------|-----------------------|
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 26,520,609.30 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 18,241,683.38 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 51,119.93 |
| 资产支持证券投资收 益 | | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 8,227,805.99 |
| 3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列） | 6.4.7.16 | 140,418,743.78 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号 填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填 列） | 6.4.7.17 | 2,746,128.50 |
| 减：二、费用 | | 14,129,538.75 |
| 1. 管理人报酬 | | 8,943,532.83 |
| 2. 托管费 | | 1,490,588.77 |
| 3. 销售服务费 | | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 3,562,485.29 |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.19 | 132,931.86 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列） | | 157,601,705.20 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-” 号填列） | | 157,601,705.20 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根智选 30 股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日 | | |
|----------------------------------|--|----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基 金净值） | 1,576,890,025.32 | - | 1,576,890,025.32 |
| 二、本期经营活动产生的 基金净值变动数（本期利 润） | - | 157,601,705.20 | 157,601,705.20 |

| | | | |
|--|-------------------|-----------------|-------------------|
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 553,279,309.57 | 138,622,549.75 | 691,901,859.32 |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,487,991,133.04 | 375,569,880.21 | 2,863,561,013.25 |
| 2. 基金赎回款 | -1,934,711,823.47 | -236,947,330.46 | -2,171,659,153.93 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 2,130,169,334.89 | 296,224,254.95 | 2,426,393,589.84 |

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：章硕麟，主管会计工作负责人：胡志强，会计机构负责人：张璐

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上投摩根智选 30 股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1757 号《关于核准上投摩根智选 30 股票型证券投资基金募集的批复》核准，由上投摩根基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根智选 30 股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2013 年 1 月 28 日至 2013 年 3 月 1 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,576,537,060.63 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 066 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根智选 30 股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 3 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,576,890,025.32 份基金份额，其中认购资金利息折合 352,964.69 份基金份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根智选 30 股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的 60%-95%，其中投资于基金持仓比例最高的前 30 只股票的资产不低于股票资产的 85%；其余资产投资于债券、货币市场工具、权证、资产支持证券等金融工具；权证投资占基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于 2013 年 8 月 26 日批准

报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根智选 30 股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2013 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内

确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以

决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴

20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|---------------------|
| 上投摩根基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 基金托管人、基金代销机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年3月6日(基金合同生效日)至2013年6月30日 |
|-----------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 8,943,532.83 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,478,099.78 |

注：支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|-------------------------------|
| | 2013年3月6日（基金合同生效日）至2013年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,490,588.77 |

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

无。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | |
|--------|-------------------------------|--------------|
| | 2013年3月6日（基金合同生效日）至2013年6月30日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 244,715,323.44 | 1,187,023.94 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|------------|-----------|-------|--------|--------------|---------------|---------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 002236 | 大华股份 | 2013-05-29 | 2014-06-02 | 非公开发行流通受限 | 33.60 | 33.98 | 665,000 | 22,344,000.00 | 22,596,700.00 | - |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。

其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行

结束之日起 12 个月内不得转让。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末 估值 单价 | 复牌 日期 | 复牌开 盘单价 | 数量(股) | 期末 成本总额 | 期末 估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|----------|----------------|------------|------------|-----------|---------------|---------------|----|
| 300020 | 银江股份 | 2013-06-03 | 筹划重大资产重组 | 22.67 | - | - | 1,314,099 | 28,387,961.32 | 29,790,624.33 | - |
| 300133 | 华策影视 | 2013-05-28 | 筹划重大资产重组 | 23.88 | 2013-07-30 | 26.87 | 881,026 | 15,372,793.04 | 21,038,900.88 | - |
| 600292 | 中电远达 | 2013-06-05 | 筹划重大资产重组 | 19.37 | 2013-07-01 | 17.50 | 745,050 | 13,315,079.30 | 14,431,618.50 | - |

注：本基金截至 2013 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 2,182,315,810.32 | 88.41 |
| | 其中：股票 | 2,182,315,810.32 | 88.41 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 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 | 251,837,100.07 | 10.20 |
| 7 | 其他各项资产 | 34,364,549.59 | 1.39 |
| 8 | 合计 | 2,468,517,459.98 | 100.00 |

注：截至 2013 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 2,426,393,589.84 元，基金份额净值为 1.139 元，累计基金份额净值为 1.139 元。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|------------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,578,062,221.03 | 65.04 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 59,076,820.78 | 2.43 |
| E | 建筑业 | 61,328,193.60 | 2.53 |
| 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 | 201,442,387.69 | 8.30 |
| J | 金融业 | 33,943,920.00 | 1.40 |
| K | 房地产业 | 49,804,139.85 | 2.05 |
| 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 | 65,800,190.97 | 2.71 |
| 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 | 21,038,900.88 | 0.87 |
| S | 综合 | 111,819,035.52 | 4.61 |
| | 合计 | 2,182,315,810.32 | 89.94 |

7.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量 (股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|-----------|----------------|---------------|
| 1 | 002236 | 大华股份 | 4,975,443 | 187,384,935.89 | 7.72 |
| 2 | 002241 | 歌尔声学 | 4,302,278 | 156,129,668.62 | 6.43 |
| 3 | 600406 | 国电南瑞 | 9,398,093 | 140,313,528.49 | 5.78 |
| 4 | 002353 | 杰瑞股份 | 1,876,303 | 129,464,907.00 | 5.34 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|----------------|------|
| 5 | 600518 | 康美药业 | 6,457,899 | 124,185,397.77 | 5.12 |
| 6 | 002038 | 双鹭药业 | 1,974,051 | 115,679,388.60 | 4.77 |
| 7 | 600256 | 广汇能源 | 8,628,012 | 111,819,035.52 | 4.61 |
| 8 | 000661 | 长春高新 | 1,115,864 | 109,254,244.24 | 4.50 |
| 9 | 601633 | 长城汽车 | 3,078,079 | 109,025,558.18 | 4.49 |
| 10 | 002653 | 海思科 | 2,464,592 | 70,240,872.00 | 2.89 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（www.51fund.com）的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|-----------------|
| 1 | 002236 | 大华股份 | 170,694,976.44 | 7.03 |
| 2 | 002241 | 歌尔声学 | 121,906,728.60 | 5.02 |
| 3 | 600406 | 国电南瑞 | 119,186,504.30 | 4.91 |
| 4 | 600518 | 康美药业 | 117,669,250.86 | 4.85 |
| 5 | 600256 | 广汇能源 | 117,290,970.54 | 4.83 |
| 6 | 601633 | 长城汽车 | 108,870,324.57 | 4.49 |
| 7 | 002353 | 杰瑞股份 | 105,550,534.24 | 4.35 |
| 8 | 000661 | 长春高新 | 101,202,765.91 | 4.17 |
| 9 | 002038 | 双鹭药业 | 97,458,764.60 | 4.02 |
| 10 | 600886 | 国投电力 | 74,533,862.01 | 3.07 |
| 11 | 002415 | 海康威视 | 67,749,779.11 | 2.79 |
| 12 | 002653 | 海思科 | 64,521,692.88 | 2.66 |
| 13 | 300115 | 长盈精密 | 59,906,214.22 | 2.47 |
| 14 | 300055 | 万邦达 | 57,412,610.36 | 2.37 |
| 15 | 002008 | 大族激光 | 56,513,046.15 | 2.33 |
| 16 | 600703 | 三安光电 | 54,715,478.26 | 2.26 |
| 17 | 002635 | 安洁科技 | 54,484,426.80 | 2.25 |
| 18 | 300128 | 锦富新材 | 50,933,244.43 | 2.10 |
| 19 | 300228 | 富瑞特装 | 50,398,727.44 | 2.08 |
| 20 | 002106 | 莱宝高科 | 49,167,463.41 | 2.03 |

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期末基金资产 |
|----|------|------|----------|---------|
|----|------|------|----------|---------|

| | | | | 产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1 | 600886 | 国投电力 | 39,383,243.30 | 1.62 |
| 2 | 002415 | 海康威视 | 32,115,530.58 | 1.32 |
| 3 | 000800 | 一汽轿车 | 30,229,178.46 | 1.25 |
| 4 | 601231 | 环旭电子 | 28,039,050.49 | 1.16 |
| 5 | 600837 | 海通证券 | 25,002,984.52 | 1.03 |
| 6 | 002570 | 贝因美 | 24,339,712.28 | 1.00 |
| 7 | 000423 | 东阿阿胶 | 18,789,572.64 | 0.77 |
| 8 | 600315 | 上海家化 | 16,256,597.44 | 0.67 |
| 9 | 300014 | 亿纬锂能 | 15,999,784.00 | 0.66 |
| 10 | 600519 | 贵州茅台 | 15,843,309.06 | 0.65 |
| 11 | 002106 | 莱宝高科 | 15,504,867.88 | 0.64 |
| 12 | 000540 | 中天城投 | 15,056,996.70 | 0.62 |
| 13 | 002450 | 康得新 | 14,383,323.86 | 0.59 |
| 14 | 601998 | 中信银行 | 14,226,115.68 | 0.59 |
| 15 | 002322 | 理工监测 | 14,009,373.71 | 0.58 |
| 16 | 002431 | 棕榈园林 | 13,867,384.77 | 0.57 |
| 17 | 000525 | 红太阳 | 12,852,046.62 | 0.53 |
| 18 | 002008 | 大族激光 | 12,373,687.38 | 0.51 |
| 19 | 300228 | 富瑞特装 | 12,373,092.28 | 0.51 |
| 20 | 000581 | 威孚高科 | 11,990,615.32 | 0.49 |

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

| | |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 2,521,625,248.60 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 497,969,865.44 |

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 548,581.97 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 53,332.49 |
| 5 | 应收申购款 | 33,762,635.13 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 34,364,549.59 |

7.10.4 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。

7.10.5 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 | 22,596,700.00 | 0.93 | 非公开发行流通受限 |
|---|--------|------|---------------|------|-----------|

7.10.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|-----------|----------------|--------|------------------|--------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 23,864 | 89,262.88 | 707,403,021.85 | 33.21% | 1,422,766,313.04 | 66.79% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 97,159.12 | 0.0046% |

注：期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0，该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2013年3月6日)基金份额总额 | 1,576,890,025.32 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 2,487,991,133.04 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 1,934,711,823.47 |

| | |
|------------------------|------------------|
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,130,169,334.89 |

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2013 年 2 月 8 日基金管理人发布《上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经上投摩根基金管理有限公司董事会审议通过，决定聘任陈星德先生为公司副总经理且陈星德先生不再担任公司督察长一职、聘任刘万方先生为公司督察长。

2013 年 4 月 19 日基金管理人发布《上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经上投摩根基金管理有限公司董事会审议通过，决定聘任张军先生为公司副总经理。

基金托管人：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所有限公司本年度第一次为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人、托管人未受稽查或处罚，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 招商证券 | 1 | 2,022,907,307.72 | 67.49% | 1,832,950.69 | 67.39% | - |
| 海通证券 | 1 | 974,343,806.32 | 32.51% | 887,042.74 | 32.61% | - |

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 交易单元的选择标准：

- 1) 资本金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范。
- 3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需
要，并能为本基金提供全面的信息服
- 5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供
宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 交易单元的选择程序：

- 1) 本基金管理人定期召开会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券
商进行评估，确定选用交易单元的券商。
- 2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。
4. 本基金于 2013 年 3 月 6 日正式成立，以上均为本期新增席位，无注销席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|------|--------------|--------------|------------------|--------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1,192,345.00 | 100.00% | 2,200,000,000.00 | 100.00% | - | - |

上投摩根基金管理有限公司
二〇一三年八月二十七日