

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	金额单位：人民币元
				占期初基金资产净值比例(%)
1	601788	光大证券	358,890,994.07	12.44
2	000568	泸州老窖	293,678,630.31	10.18
3	600519	贵州茅台	234,669,752.60	8.13
4	600028	中国石化	212,069,189.25	7.35
5	000028	国药一致	211,915,889.20	7.35
6	600276	恒瑞医药	207,202,309.24	7.25
7	000858	五粮液	204,653,045.59	7.09
8	600029	南方航空	194,860,195.46	6.75
9	601377	兴业证券	181,370,997.64	6.29
10	600079	人福医药	161,271,911.02	5.59
11	000800	一汽轿车	149,194,451.22	5.17
12	601111	中国国航	133,481,337.85	4.63
13	600115	东方航空	123,805,586.65	4.29
14	002179	中航光电	120,518,969.61	4.18
15	600036	招商银行	117,802,904.78	4.08
16	600705	中航投资	113,869,173.64	3.95
17	000063	中国联通	113,635,156.03	3.94
18	600809	山西汾酒	105,581,099.70	3.66
19	600596	新安股份	99,512,119.83	3.45
20	600837	海通证券	99,466,998.12	3.45
21	600351	亚宝药业	92,403,726.28	3.20
22	600511	国药股份	91,507,168.56	3.17
23	600030	中信证券	91,472,194.38	3.17
24	600221	南京航空	80,687,865.00	2.80
25	000792	顺鑫农业	73,163,571.72	2.54
26	000792	盐湖股份	68,183,054.66	2.36
27	600403	大有能源	65,387,436.02	2.27
28	000933	神火股份	64,783,775.60	2.25
29	000877	天山股份	61,281,395.22	2.12
30	600529	山东药玻	61,069,804.17	2.12
31	601095	中牧股份	59,483,843.58	2.06
32	600090	上海机场	59,421,979.57	2.06

以成交数量 填列, 不考虑相关交易费用。

7.3 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(买入总额)	6,014,735,241.33
卖出股票的收入(卖出总额)	6,929,339,918.81

注: 买入金额“买入股票成本”、卖出金额“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

上述关联交易均为正在正常业务范围内开展一般商业业务时订立。

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1月1日至2013年6月30 日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,921,052.18	25,560,169.75
其中：支付销售机构的客户维护费	1,822,431.16	2,040,376.49

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×1.5%÷当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,470,000.00	4.62
	其中：政策性金融债	99,470,000.00	4.62
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	99,470,000.00	4.62

				金额单位：人民币元	
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	120245	12国开45	1,000,000	99,470,000.00	4.62
7.1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 报告期末投资组合报告					
7.10.1 本基金投资于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					
告日起计至贵州茅台酒销售有限公司于2013年2月22日收到贵州茅台酒物售公司《处罚决定书》（黔处					
处罚字【2013】号）。该决定书认为：贵州茅台酒销售有限公司在全国经销商向第三人销售茅台酒的价格最低					
进行了违反《中华人民共和国反不正当竞争法》第二十七条的规定。因此，根据《中华人民共和国反不正当					
竞争法》第四十条、《中华人民共和国行政处罚法》第七十二条的规定给予处罚，贵州茅台酒销售有限公司					

对于上述股票投资决策流程的说明：本基金管理人在投资贵州茅台前严格执行了对于上市公司的调研、研究论证、撰写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，本基金管理人对于上市公司进行了进一步了解和分析，认为上述事项未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于该上市公司的投资判断。

其余九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、处罚情况。

7.10.2 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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

序号	资产名称	金额(元)
1	存出保证金	1,520,106.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	3,689,473.20
4	应收利息	2,014,242.25
5	应收申购款	321,946.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	3,545,768.27

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
109,775	9,660.00	138,575,457.51	13.07%	921,850,513.71	86.93%

8.2 期末本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	44,116.07	

注:截止本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究人员/负责人持有该只基金总份额的数区间为0,该只基金的基金经理持有该只基金总份额的数量区间为0。

9 开放式基金资产变动

基金合同生效日(2005年10月11日)基金份额总额	767,620,088.15
-报告期期初基金份额总额	1,383,215,798.63
-报告期基金份额申购总额	37,740,824.13
-本报告期基金份额赎回总额	360,530,651.54
-报告期基金份额拆变动份额	
报告期期末基金份额总额	1,060,425,971.22

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重大人事变动
- 基金管理人：

2013年2月8日基金管理人发布《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人董事会审议通过，决定聘任陈鼎樵先生为公司副总经理且陈鼎樵先生不再担任公募基金一职，聘任汪万先生为公司督察长。

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人董事会审议通过，决定聘任张军华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

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况					金额单位：人民币元
10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资和佣金支付情况					
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
中信证券	1	4,402,858,124.02	34.01%	3,950,642.14	33.75%
银华基金	1	2,745,832,597.57	21.21%	2,499,803.26	21.32%
中信建投	1	1,832,835,114.41	14.16%	1,668,611.13	14.25%
泰君安	1	1,612,588,802.29	12.46%	1,468,099.81	12.54%
大证券	1	1,710,635,623.28	9.04%	1,065,404.66	9.10%
广发证券	1	743,639,568.51	5.75%	665,122.33	5.68%
中信证券	1	436,055,300.06	3.37%	388,105.43	3.32%
华泰证券	1	-	-	-	-
鲁证证券	1	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-
城广证券	1	-	-	-	-

注：1、上述佣金市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费后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，并能本基金提供全面的信息服务。

3、交易单元的选择程序：
 1) 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、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

4、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价，确定选用交易单元的顺序号。

5、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。

6、以上半年度本基金新增“发生证券承销席位”个席位，无注销席位。

10.7.2 基金租用证券交易单元交易单元进行其他证券投资的情况

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
恒信证券	1,404,209.06	100.00%	-	-	-	-
国联南方	-	-	-	-	-	-
恒信建投	-	-	-	-	-	-
泰君安	-	-	-	-	-	-
大证券	-	-	-	-	-	-
发证券	-	-	-	-	-	-
信证券	-	-	-	-	-	-
泰证券	-	-	-	-	-	-
鲁证券	-	-	-	-	-	-
西证券	-	-	-	-	-	-
融证券	-	-	-	-	-	-