

上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金 2013 半年度报告摘要

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

2013 半年度报告摘要

国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金》和《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的基金行业实务操作规范。

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金投资者均具有依法承担的义务。
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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益最低。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定
本基金2013年上半年度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日的财务状况及2013年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

2.1 基金基本情况
基金简称:上投摩根大盘蓝筹股票
基金代码:376510
基金运作方式:契约开放式
基金合同生效日:2010年12月20日

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明。

2.2 基金产品说明
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。
投资策略:本基金充分借鉴蓝筹资产管理团队全球行之有效的投资理念和技术,“自上而下”的精选个股,重点投资于在行业内具有领先地位、业绩良好且稳定增长、价值相对低估的大盘蓝筹上市公司。

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。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

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问题的通知》、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《关于股息红利有关个人所得税政策的通知》、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》及其他相关法规和实务操作,主要事项列示如下:

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
报告期末(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益 117,841,873.32
本期利润 149,164,308.85

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
6.4.7.2 本报告期与基金存在关联关系的各关联方
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

3.2 主要财务指标和基金净值表现
金额单位:人民币元
3.2.1 期间数据和指标
报告期末(2013年6月30日)
期末基金份额净值 1.0992
期末基金份额净值增长率 22.62%

6.4.8 本报告期内基金管理人履行受托管理职责的情况
6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.8.2 关联方报酬
6.4.8.2.1 基金管费用
单位:人民币元

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准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2013年6月30日)

6.4.8.2.2 基金托管费
单位:人民币元
项目 2013年1月1日至2013年6月30日 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费 832,460.48 905,269.62

4 管理人报告
4.1 基金管理人及其基金经理情况
4.1.1 基金管理人及其基金经理简介
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。

6.4.8.2.3 基金销售服务费
单位:人民币元
项目 2013年1月1日至2013年6月30日 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费 832,460.48 905,269.62

4.2 基金业绩
4.2.1 基金业绩
4.2.2 基金业绩
4.2.3 基金业绩

6.4.8.2.4 基金销售服务费
单位:人民币元
项目 2013年1月1日至2013年6月30日 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费 832,460.48 905,269.62

4.3 基金投资
4.3.1 基金投资
4.3.2 基金投资

6.4.8.2.5 基金销售服务费
单位:人民币元
项目 2013年1月1日至2013年6月30日 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费 832,460.48 905,269.62

4.4 基金风险管理
4.4.1 基金风险管理
4.4.2 基金风险管理

6.4.8.2.6 基金销售服务费
单位:人民币元
项目 2013年1月1日至2013年6月30日 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费 832,460.48 905,269.62

4.5 基金信息披露
4.5.1 基金信息披露
4.5.2 基金信息披露

6.4.8.2.7 基金销售服务费
单位:人民币元
项目 2013年1月1日至2013年6月30日 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费 832,460.48 905,269.62

4.6 基金持有人服务
4.6.1 基金持有人服务
4.6.2 基金持有人服务

6.4.8.2.8 基金销售服务费
单位:人民币元
项目 2013年1月1日至2013年6月30日 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费 832,460.48 905,269.62

4.7 基金募集
4.7.1 基金募集
4.7.2 基金募集

6.4.8.2.9 基金销售服务费
单位:人民币元
项目 2013年1月1日至2013年6月30日 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费 832,460.48 905,269.62

4.8 基金费用
4.8.1 基金费用
4.8.2 基金费用

6.4.8.2.10 基金销售服务费
单位:人民币元
项目 2013年1月1日至2013年6月30日 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费 832,460.48 905,269.62

4.9 基金收益分配
4.9.1 基金收益分配
4.9.2 基金收益分配

6.4.8.2.11 基金销售服务费
单位:人民币元
项目 2013年1月1日至2013年6月30日 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费 832,460.48 905,269.62

4.10 基金投资策略
4.10.1 基金投资策略
4.10.2 基金投资策略

6.4.8.2.12 基金销售服务费
单位:人民币元
项目 2013年1月1日至2013年6月30日 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费 832,460.48 905,269.62

4.11 基金风险管理
4.11.1 基金风险管理
4.11.2 基金风险管理

6.4.8.2.13 基金销售服务费
单位:人民币元
项目 2013年1月1日至2013年6月30日 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费 832,460.48 905,269.62

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:买入金额(含买入股票成本)、卖出金额(含卖出股票收入)均按买卖成交金额(成交价款)乘以成交数量填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超过期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:买入金额(含买入股票成本)、卖出金额(含卖出股票收入)均按买卖成交金额(成交价款)乘以成交数量填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入
单位:人民币元

注:买入金额(含买入股票成本)、卖出金额(含卖出股票收入)均按买卖成交金额(成交价款)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十名权证投资明细
本基金本报告期末持有权证。

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 投资组合报告附注

7.10.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出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。

7.10.3 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范围。

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
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
(因篇幅有限,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

Table with columns: 持有人户(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者, 个人投资者

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
金额单位:人民币元

Table with columns: 项目, 持有份额总户数(份), 占基金总份额比例

注:期末本公司高级管理人员、基金投资和研究人员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

Table with columns: 基金合同生效日(2010年12月20日), 基金份额总额

本报告期初基金份额总额 857,583,233.75
本报告期基金份额总额变动: 114,855,154.25
减:本报告期基金总赎回份额 358,605,760.73

本报告期基金份额总额变动: 613,832,627.27
本报告期末基金份额总额 613,832,627.27

10 重大事件提示
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《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,决定聘任陈瑞德先生为公司副总经理且陈瑞德先生不再担任公司督察长一职,聘任刘万芳先生为公司督察长。

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、基金资产、基金托管业务的诉讼
报告期内无涉及基金管理人、基金资产、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 为基金进行审计的会计师事务所情况
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

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易成交金额, 占当期股票成交总额的比例(%)

注:1. 上述佣金按市场佣金率计算,以上数据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) 符合中国证监会相关规定;
2) 财务状况良好,信誉良好;
3) 研究实力较强,有固定数量研究人员;
4) 能及时、全面地为基金提供宏观经济、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备选券商进行评估,确定选用交易单元券商;
2) 本基金管理人将与券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。

4. 2013年上半年本基金无新增交易单元。