

券型证券投资基金摘要

年度报告摘要

有关本基金的投资范围和投资策略, 已在本基金的投资目标和基金合同中列明。本基金投资于股票、债券、货币市场工具、权证以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融品种。本基金投资于债券资产占固定收益类资产的的投资比例不低于基金资产的80%, 权证、股指期货等权益类金融资产投资比例不超过基金资产的20%, 持有的全部权证市值不得超过基金资产净值的3%, 并保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日不超过一年的政府债券。本基金业绩比较基准为: 中债综合全价指数。

本基金财务报表由本基金的基金管理人上海股票基金管理有限公司于2018年3月26日批准披露。

6.2 财务报表的编制基础

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”)、中国证监会公告[2016]58号《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》、上海股票基金管理有限公司证券型证券投资基金会计核算业务指引及财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关会计及公允价值计量的业务操作编制。

6.3 遵循企业会计准则及其他有关规定声明

本基金2018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2018年6月30日的财务状况及2018年上半年度经营成果和基金净值变动有关信息。

6.4 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保持一致

6.4.1 会计政策与会计估计变更及差错更正的说明

6.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末无发生会计政策变更。

6.4.1.2 会计估计变更的说明

6.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据国务院、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[2004]78号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2008]3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》及其他相关税法规定和实务操作, 主要税项列示如下:

1) 以发行基金方式筹集基金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。

2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

3) 对基金管理人持有的债券利息收入, 以及以债券的公允价值在资产负债表日计提时代扣代缴20%的印花税, 暂不征收企业所得税。2013年1月1日起, 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司向基金派发股息、红利时预扣减50%计入个人应纳税所得额, 依照现行税法规定扣缴20%代扣代缴的个人所得税, 暂不征收企业所得税。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, 持股期限在一个月以内(含一个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在一个月以上1年以内(含1年)的, 暂按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 暂按20%计入应纳税所得额。

4) 基金买卖股票按照2.1%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系方变更的情况

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
上海股票基金管理有限公司	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、基金销售机构

注: 下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款予以立。

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

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	526,919.52	932,254.24	
其中：支付销售机构的客户维护费	112,307.37	546,424.99	

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0.7%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 0.7%÷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托管费	150,548.41	266,358.36	

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0.2%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X 0.2%÷当年天数。

6.4.8.2.3销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	注
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
上投摩根银债A类 债券A类	上投摩根银债A类 债券B类	合计
上投摩根基金管理有限公司	~ 9,761.71	9,761.71
中国建设银行	~ 73,652.47	73,652.47
合计	~ 83,414.18	83,414.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	注
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
上投摩根银债A类 债券A类	上投摩根银债A类 债券B类	合计
上投摩根基金管理有限公司	~ 27,128.48	27,128.48
中国建设银行	~ 220,378.82	220,378.82
合计	~ 247,507.30	247,507.30

1. 基金销售服务费仅对B类基金份额收取。

2. 支付基金销售机构的销售服务费前一日B类基金份额净值0.4%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给上投摩根基金管理有限公司，再由上投摩根基金管理有限公司进行支付并符合基金合同约定。其计算公式为：
日销售服务费=前一日B类基金份额净值X 0.4%÷当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行同业业务市场的 债券回购/交易

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		上年度可比期间	
	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,195,784.04	34,202.37	8,608,302.29	94,522.06

注：1.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 本基金在承销期间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

无

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

序号	股票代码	股票简称	停牌日期	停牌原因	期末 估值市 价	复牌日期	复牌 开盘价	数量 (股)	期末 成本 总额	期末 估值总额	备注
1	000998	隆平高科	2013-5-3	筹划重大资产重组	20.73	2013-7-8	20.50	30,000	627,349.82	621,900.00	
2	300020	京臣股份	2013-6-3	筹划重大资产重组	22.67	-	-	20,000	445,256.00	453,400.00	

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公司股票，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作为抵押的债券

无

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止，本基金从事证券交易所得债券正回购交易形成的卖出回购证券余额9,999,995.50元，于2013年7月1日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定比例折算为标准券后，不低于债券回购的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

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	13,770,510.00	6.95
	其中：股票	13,770,510.00	6.95

§ 7 投资组合报告

2	固定收益投资	150,761,777.90	76.12
	其中：债券	150,761,777.90	76.12
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	20,000,000.00	10.10
	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	3,564,701.70	1.80
7	其他各项资产	9,955,625.04	5.03
	合计	198,052,614.54	100.00

注：截至2013年6月30日，上投摩根强化回报债券型证券投资基金资产净值为187,785,948.66元；本基金A类份额净值为1.060元，累计基金份额净值为1.100元；本基金B类份额净值为1.051元，累计基金份额净值为1.091元。

7.2 报告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	621,900.00	0.33
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,238,160.00	4.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	753,500.00	0.40
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	信息技术传输、软件和信息技术服务业	453,400.00	0.24
J	金融业	750,400.00	0.40
K	房地产业	711,000.00	0.38
L	租赁和商务服务业	1,242,150.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	13,770,510.00	7.33

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	002038	双鹭药业	57,600	3,375,360.00	1.80

2	000800	一汽轿车	200,000	2,460,000.00	1.81
3	002236	大康股份	40,000	1,529,200.00	0.31
4	600657	通江动力	100,000	1,480,000.00	0.70
5	002344	海广生物	65,000	1,242,150.00	0.66
6	002663	普阳钢铁	50,000	753,500.00	0.36
7	600837	海通证券	80,000	750,400.00	0.40
8	000671	阳光城	60,000	711,000.00	0.38
9	000998	隆平高科	30,000	621,900.00	0.33
10	300020	银江股份	20,000	453,400.00	0.24

投资者看了《基金投资定期期末基金投资的》所有股票明细，应阅读载于《基金管理人网站 www.5ifund.com》的定期报告全文。

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初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2,740,980.85

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。

7.3 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	149,198,252.20
卖出股票的收入（成交）总额	152,541,719.57

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

金额单位：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	35,013,820.00	18.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,968,000.00	5.31
3	其中：政策性金融债	9,968,000.00	5.31
4	企业债券	95,834,957.90	51.03
5	企业短期融资券	9,945,000.00	5.30
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	150,761,777.90	80.28

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

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	010107	21国债(7)	190,000	19,957,600.00	10.63
2	1280426	12央行票	100,000	10,217,000.00	5.44
3	120314	12进出14	100,000	9,968,000.00	5.31
4	041158036	13农发科技CP001	100,000	9,945,000.00	5.30
5	010303	03国债(3)	100,000	9,812,000.00	5.23

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持仓。

7.10 报告期末衍生品投资

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过被监管部门立案调查，或在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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	85,838.82
2	应收证券清算款	6,397,613.81
3	应收股利	-
4	应收利息	3,416,177.32
5	应收申购款	55,995.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

合计

9,955,625.04

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无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

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	000998	隆平高科	621,900.00	0.33	筹划重大资产重组
2	300020	银江股份	453,400.00	0.24	筹划重大资产重组

7.10.6 报告期内，投资报告中附注的其他文字描述内容

因四舍五入原因，投资报告合报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

份额类别	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
A类	1,338	103,986.18	100,152,513.40	71.98%	38,980,991.14	28.02%
B类	983	39,030.63	1,043,825.45	2.72%	37,323,305.07	97.28%
合计	2,321	76,475.93	101,196,338.85	57.01%	76,304,296.21	42.99%

8.2 期末基金基金经理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额类别	持有份额总份数(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	A	4,970.58	0.0036%
	B	20,001.60	0.0521%
	合计	24,972.18	0.0141%

注：期末本公司高级管理人员、基金投资和研究人员/负责人员持有该只基金份额总量的区间为0%至100%不等。

该只基金的基金经理持有该只基金份额的期间为70至100%不等。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	上投摩根强化回报债券A类	上投摩根强化回报债券B类
基金合同生效日（2011年8月10日）基金份额总额	174,399,071.48	1,498,328,628.23
报告期期初基金份额总额	70,303,033.41	50,367,018.78
报告期末基金总申购份额	113,868,982.83	14,710,210.26
减：报告期末基金总赎回份额	45,038,511.70	26,710,098.52
报告期末基金拆分变动份额	-	-
报告期末基金份额总额	139,133,504.54	38,367,130.52

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金补选持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的有关“基金托管部门”的重大人事变动情况：
2013年2月8日基金管理人发布《让投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经摩根基金基金管理人董事会审议通过，决定聘任陈陆基先生为公司副总经理（原陈陆基先生不再担任公司督察长一职，聘任刘万先生为公司督察长）。

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

基金托管人：
10.1 基金托管人：中国工商银行
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 报告期内改聘会计师事务所情况
本报告期内，本基金管理人发生改聘为中审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监管部门稽查或处罚的情况
报告期内，管理人、托管人及其高级管理人员，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚的情况。

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用于报告股票及佣金支付情况

券商名称	交易单元数量	股票交易		金额单位：人民币元	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总额的比例
国泰君安	1	150,296,928.89	50.65%	281,519.88	65.66%
华泰证券	1	146,426,094.02	49.35%	147,222.40	34.34%
华泰证券	1	-	-	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证监会指定结算有限责任公司收取的证管费、经手费（适用期间）由券商承担的证券结算风险基金后的净额列报；

2、交易单元的选择标准：
1) 资本雄厚，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，并具备基金管理人所需的信息系统；
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、行业、市场、个股、个股的研究报告和及时的信息服务。

3、交易单元的选择程序：
1) 本基金基金定期召开评议会议，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，并采用打分制选择交易单元；
2) 本基金基金与券商签订交易单元租约协议，并通知基金托管人。
4、2013上半年度本基金无新增协议，无到期协议。

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
国泰君安	750,122,328.75	89.43%	1,114,500,000.00	99.55%	-	-
招商证券	88,632,238.36	10.57%	5,000,000.00	0.45%	-	-
华证券	-	-	-	-	-	-

二〇一三年八月二十七日