

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

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、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约定,于2013年8月26日复核了本报告中的财务报表、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,保证复核报告不存在虚假记载、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。

本半年度报告摘要简要披露半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告期自2013年1月1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	上投摩根中小盘股票型证券投资基金
基金主代码	379010
交易代码	379010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年1月21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
报告期基金总资产	617,514,739.41
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

本基金重点投资于中国股票市场上的中小股票,通过紧密的资产配置和资产组合管理,分享中国经济高速增长带来的优势,中小市值上市公司的长期机遇,并积极运用战略和战术资产配置策略,动态优化投资组合,力求实现基金资产长期稳健增值。

本基金系分层管理的资产管理体系全球化运作的有效投资理念和技术,运用“自下而上”精选个股与“自上而下”资产配置相结合的投资策略,重仓投资于具有行业优势、公司优势和估值优势的中小市值上市公司股票,同时结合市场研判,对相关资产类别的预期收益进行把控,动态调整股票配置等大类资产配置。

本基金的业绩比较基准为:“40%×中证大盘指数收益率+40%×中证小盘指数收益率+20%×上证国债指数收益率”。

本基金是股票型基金,在证券投资基金中属于较高风险品种,其预期收益水平和风险高于债券型基金和货币型基金。

本基金合同存续期

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况说明

本报告期内,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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,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、基金收益分配方案等进行了认真的复核,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 托管人对本基金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报告中财务指标、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,保证复核报告不存在虚假记载、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:上投摩根中小盘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

2013年6月30日

上年度末

2012年12月31日

货币

6.4.7.1

114,260,725.07

99,701,448.92

银行存款

6.4.7.2

3,090,121.71

1,836,427.26

结算备付金

6.4.7.3

577,788.36

662,488.16

存出保证金

6.4.7.4

721,862,507.83

872,683,187.07

交易性金融资产

6.4.7.5

721,862,507.83

872,683,187.07

其中:股票投资

6.4.7.6

—

基金投资

6.4.7.7

—

债券投资

6.4.7.8

—

货币市场基金

6.4.7.9

—

应收票据

6.4.7.10

—

应收账款

6.4.7.11

—

预付款项

6.4.7.12

—

应收股利

6.4.7.13

—

应收利息

6.4.7.14

—

应付职工薪酬

6.4.7.15

—

应付股利

6.4.7.16

—

应付利息

6.4.7.17

—

应付股利

6.4.7.18

—

应付股利

6.4.7.19

—

应付股利

6.4.7.20

—

应付股利

6.4.7.21

—

应付股利

6.4.7.22

—

应付股利

6.4.7.23

—

应付股利

6.4.7.24

—

应付股利

6.4.7.25

—

应付股利

6.4.7.26

—

应付股利

6.4.7.27

—

应付股利

6.4.7.28

—

应付股利

6.4.7.29

—

应付股利

6.4.7.30

—

应付股利

6.4.7.31

—

应付股利

6.4.7.32

—

应付股利

6.4.7.33

—

应付股利

6.4.7.34

—

应付股利

6.4.7.35

—

应付股利

6.4.7.36

—

应付股利

6.4.7.37

—

应付股利

6.4.7.38

—

应付股利

6.4.7.39

—

应付股利

6.4.7.40

—

应付股利

6.4.7.41

—

应付股利

6.4.7.42

—

应付股利

6.4.7.43

—

应付股利

6.4.7.44

—

应付股利

6.4.7.45

—

应付股利