

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

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。

1.2基金管理人:上投摩根基金管理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。

1.3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。

1.4本年度报告摘要除摘自半年度报告正文外,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。

1.5本报告中财务数据未经审计。

1.6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	上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金
基金主代码	370023
交易代码	370023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月25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	71,771,335.31份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,严格执行本基金的规模增长率与业绩比较基准的偏离度不超过±35%,年跟踪误差不超过4%,以实现对中证消费服务领先指数的有效跟踪。
投资策略	本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,严格执行本基金的规模增长率与业绩比较基准的偏离度不超过±35%,年跟踪误差不超过4%,以实现对中证消费服务领先指数的有效跟踪。
业绩比较基准	95%×中证消费服务领先指数收益率+5%×税后银行活期存款收益率
风险收益特征	本基金为指数型基金,长期平均风险和预期收益率高,混合型基金,债券型基金、货币市场基金等,为高风险、高收益产品。
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
姓名	胥洪庆	田青
信息披露负责人	021-38794888	010-67595096
电子邮箱	services@pmf-sitco.com	tianq@cbcm.com
客户服务电话	400-889-4888	010-67595096
传真	021-68881170	010-66275853

4.4信息披露方式	登载基金半年度报告正文的管理人: http://www.51fund.com 互联网网址: http://www.51fund.com
基金半年度报告置地	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
报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)	
本期已实现收益	5,960,721.71
本期利润	2,747,171.57
加权平均基金份额本期利润	0.0294
本期基金份额净值增长率	-1.07%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供基金份额利润	0.0130
期末基金份额净值	72,704,141.86
期末基金份额净值	1.013

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,扣除本期分配利润,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、基金转换费等,计算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2012年9月25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与其同期业绩比较基准收益率的比较

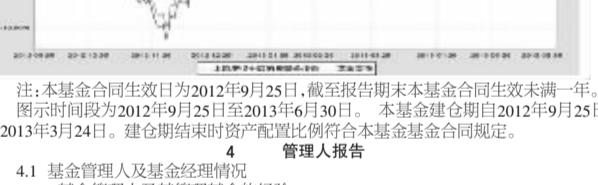
阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去一个月	-10.20%	1.63%	-10.79%	1.62%	0.59%
过去三个月	-3.62%	1.26%	-4.26%	1.26%	0.64%
过去六个月	-1.07%	1.25%	-1.22%	1.25%	0.15%
过去一年	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-
自基金合同生	1.30%	1.15%	3.14%	1.22%	-1.84%
效之日起至今	-	-	-	-	-0.07%

注:本基金的业绩比较基准为:95%×中证消费服务领先指数收益率+5%×税后银行活期存款收益率。

3.2.2基金合同生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

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金
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

2012年9月25日至2013年6月30日



注:本基金合同生效日为2012年9月25日,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

图表时间跨度为2012年9月25日至2013年6月30日。本基金建仓期自2012年9月25日至2013年6月24日。建仓结束后待资产配置比例符合本基金基金合同规定。

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经验

上投摩根基金管理有限公司经中国证监会监督管理委员会批准,于2004年5月12日正式成立。公司由上投国际信托有限公司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,注册地址:上海市2002316号底,公司管理的基金共有二十只,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、上投摩根行业股票型证券投资基金、上投摩根平衡型证券投资基金、上投摩根成长先锋股票型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根双盈平衡型证券投资基金、上投摩根亚太优质股票型证券投资基金、上投摩根深证综指股票型证券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、上投摩根稳健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、上投摩根量化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、上投摩根精选30股票型证券投资基金和上投摩根成功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	附注	说明
黄栋	本基金 基金经理	2012-9-25	- 8年 上海财经大学经济学硕士;2005年至2010年先后在东方证券、工银瑞信基金从事金融工程研究工作;2010年7月起加入上投摩根基金管理有限公司担任高级金融工程师;2012年9月起担任上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金基金经理。
熊志勇	本基金 基金经理助理	2012-11-13	- 6年 英国考文垂大学,博士研究生,自2007年7月至2009年12月在华安基金管理有限公司担任高级金融工程师,2009年12月至2011年8月在国投瑞银基金管理有限公司担任公司项目经理,2012年1月起担任上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金基金经理。

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.黄栋先生为本基金基金经理,其任职日期为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性的说明

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取利益。本基金代理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售行为规范》、《证券投资基金评价办法》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《证券投资基金销售支付结算办法》、《证券投资基金销售机构内部控制指导意见》等法律法规的规定,并严格按照基金合同的约定,履行了诚实守信、勤勉尽责的义务,没有损害基金份额持有人的利益。

在本报告期内,基金管理人不存在对投资决策形成重大影响的关联交易。

4.3异常交易行为的专项说明

报告期内,通过交易对手交易、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5%的情形。

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报告期内基金的投资策略和分析

报告期内,本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的各项要求,严格规范境内上市股票、债券的发行和交易,通过系统和人工相结合的方式进行交易行为的监控和预防。

4.4.2会计报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的业绩表现与同期业绩相比,对同向交易和反向交易的交易时机和交易价格进行分析,监察稽核部未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.4.3通常通过对交易的专项说明

报告期内,通过对交易时间、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5%的情形。

4.4.4管理人对报告期内基金的业绩表现说明

4.4.5报告期未持有过积极投资的金融工具

4.4.6报告期未持有过消极投资的金融工具

4.4.7报告期未持有过衍生品投资

4.4.8报告期未持有过商品期货、期权投资

4.4.9报告期未持有过远期、互换投资

4.4.10报告期未持有过黄金等贵金属投资

4.4.11报告期未持有过外汇投资

4.4.12报告期未持有过其他金融工具

4.4.13报告期未持有过其他投资

4.4.14报告期未持有过其他投资

4.4.15报告期未持有过其他投资

4.4.16报告期未持有过其他投资

4.4.17报告期未持有过其他投资

4.4.18报告期未持有过其他投资

4.4.19报告期未持有过其他投资

4.4.20报告期未持有过其他投资

4.4.21报告期未持有过其他投资

4.4.22报告期未持有过其他投资

4.4.23报告期未持有过其他投资

4.4.24报告期未持有过其他投资

4.4.25报告期未持有过其他投资

4.4.26报告期未持有过其他投资

4.4.27报告期未持有过其他投资