

上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金

[2014] 第二季度报告

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一四年六月二十一日

§ 1重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员保证本报告不存在虚假记载、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责任。

基金托管人对本报告书内容进行复核，于2014年6月18日核对了本报告中的财务数据、净值表现、资产配置等内容，在报告复核过程中未发现虚假记载、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。

本报告书内容财务数据未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§ 2基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权证投资	236,372,908.52	84.63
其中:股票			
2	国债逆回购投资	10,002,000.00	3.58
其中:债券			
3	货币市场基金	10,002,000.00	3.58
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	29,776,828.57	10.66
7	其他资产	3,153,047.14	1.13
8	合计	279,505,584.23	100.00

注:截至2014年6月30日,上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金资产净值为277,436,256.10元,基金份额净值为0.931元,累计基金份额净值为0.931元。

基金份额持有人报告期未按行业分类的股票投资组合

注:

注: