

信息披露 Disclosure

上投摩根核心优选股票型证券投资基金

2014 半年度报告摘要

全、能源安全的领域需要特别重视,我们认为这些相关行业将会“有名有实”,既有出台政策支持预期,又可能有实际的政策投入,具备良好的市场预期。此外,主题性的机会依然会层出不穷,高透明度下的中前期市场仍有很好的投资机会。

4.2 管理人对于报告期内本基金估值程序变更的说明
本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责,根据相关的法律法规规定,基金合同的约定,制定了内部控制措施,对基金估值和会计核算的各个环节和流程进行风险控制,目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关专业工作经历。本公司成立了估值委员会,并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理,所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见,评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员,参加估值委员会会议,参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
本报告期本基金未实施收益分配。

5 托管人报告
报告期内本基金托管人遵守信托信守原则,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,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、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的基金资产运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人复核审查了本报告中的财务信息内容,未发现虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,对资产负债表、利润表和利润分配情况、资产负债表、投资组合报告等内容,保证投资者不存在虚假记载、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
报告截止日:2014年6月30日

资产	附注号	本期 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
货币存款	6.4.7.1	57,166,553.82	18,459,402.29
结算备付金		966,715.21	1,420,580.62
存出保证金		307,359.56	214,279.23
交易性金融资产	6.4.7.2	745,124,971.86	563,130,226.93
其中:股票投资		743,874,299.86	543,514,144.43
基金投资			
债券投资			
资产支持证券			
买入返售金融资产			
应收利息	6.4.7.3	1,250,172.00	19,616,082.50
应收股利			
其他应收款			
预付账款			
其他资产			
资产总计		805,167,541.11	637,610,622.85

负债和所有者权益
附注号 本期 2014年6月30日 上年度末 2013年12月31日

负债	附注号	本期 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
短期借款			
应付利息			
应付股利			
应付债券			
交易性金融负债			
衍生金融负债			
卖出回购金融资产款	6.4.7.3		
应付证券清算款		1,717.25	
应付赎回款		915,987.13	5,321,438.25
应付管理人报酬		973,620.27	679,927.64
应付托管费		162,271.55	113,321.25
应付销售服务费			
预收基金申购费	6.4.7.7	819,412.96	829,277.12
其他应付款			
其他负债			
负债合计		2,997,504.96	7,210,031.39
所有者权益			
实收基金	6.4.7.9	562,294,903.40	427,146,542.91
未分配利润	6.4.7.10	239,878,132.75	203,254,078.55
所有者权益合计		802,170,036.15	630,400,621.46
负债和所有者权益总计		805,167,541.11	637,610,622.85

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.427元,基金份额总额662,294,903.40份。

6.2 利润表
报告日期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		-38,196,356.08	23,745,980.33
1.利息收入	6.4.7.11	413,980.21	126,366.78
其中:存款利息收入		368,258.63	70,196.62
债券利息收入		10,782.58	56,440.76
资产支持证券利息收入			
买入返售金融资产收入			
其他利息收入			
2.股息收入			
3.其他收入			
二、费用		10,024,800.99	2,572,118.28
1.销售费用		5,775,203.91	1,124,565.54
2.管理费用		962,533.91	187,427.88
3.托管费			
4.其他费用	6.4.7.18	3,151,888.47	1,130,888.47
5.利息支出			
6.其他支出			
三、利润总额(亏损总额)“+”号填列		-48,221,187.07	21,173,862.05
四、净利润(净亏损)“+”号填列		-48,221,187.07	21,173,862.05

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
报告日期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	实收基金	2014年1月1日至2014年6月30日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	427,146,542.91	203,254,078.55	630,400,621.46
二、本期基金份额变动产生的基金资产变动数(本期净申购)	-	-48,221,187.07	-48,221,187.07
三、本期基金份额变动产生的基金资产变动数(净申购减少)“+”号填列	135,148,360.49	84,842,241.27	219,990,601.76
四、本期基金份额变动产生的基金资产变动数(净赎回)“+”号填列	585,939,168.73	314,303,966.33	900,243,135.06
五、本期基金份额变动产生的基金资产变动数(净赎回减少)“+”号填列	-450,790,808.24	-229,461,728.06	-680,252,533.30
六、本期基金份额变动产生的基金资产变动数(净申购、净赎回、净申购减少、净赎回减少)“+”号填列	562,294,903.40	239,878,132.75	802,170,036.15

项目	实收基金	2013年1月1日至2013年6月30日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	147,803,340.32	77,024,677.76	155,588,988.08
二、本期基金份额变动产生的基金资产变动数(本期净申购)	-	21,173,862.16	21,173,862.16
三、本期基金份额变动产生的基金资产变动数(净申购减少)“+”号填列	43,561,106.30	29,284,741.27	72,845,847.57
四、本期基金份额变动产生的基金资产变动数(净赎回)“+”号填列	277,711,991.23	78,745,712.62	356,457,703.85
五、本期基金份额变动产生的基金资产变动数(净申购、净赎回、净申购减少、净赎回减少)“+”号填列	191,364,446.62	58,241,251.08	249,605,697.70

报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:
基金管理人:章献刚,主管会计工作负责人:胡志强,会计机构负责人:张鹏

6.4 财务报表附注
6.4.1 基金基本情况
上投摩根核心优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2012]第1040号《关于核准上投摩根核心优选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由上投摩根基金管理有限公司(以下简称“上投摩根”)发起设立,并经中国证监会核准,于2012年11月28日正式成立,基金合同生效日为2012年11月28日,初始募集资金总额为283,534,302.22份基金份额,其中认购基金份额折合48,103.61份基金份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根核心优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的公司股票、创业板及其他经中国证监会核准上市的公司股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许证券投资基金的其他金融工具(但须符合中国证监会有关规定),本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的70%-95%,其中投资于国内研究范围内的股票资产不低于股票资产的80%;权益类资产占基金资产的0%-3%;现金类资产占基金资产的0-5%;权证占基金资产的0-3%;股指期货占基金资产的0-5%。本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%。

6.4.2 会计报表的编制基础
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、《企业会计准则解释及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]15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>》、中国证监会公告[2007]56号颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根核心优选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
本基金2014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2014年6月30日的财务状况以及2014年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期末基金资产净值及基金份额总额
报告截止日:2014年6月30日,基金份额净值1.427元,基金份额总额662,294,903.40份。

6.4.5 本报告期末基金资产净值及基金份额总额
报告截止日:2014年6月30日,基金份额净值1.427元,基金份额总额662,294,903.40份。

6.4.6 本报告期末基金资产净值及基金份额总额
报告截止日:2014年6月30日,基金份额净值1.427元,基金份额总额662,294,903.40份。

6.4.7 本报告期末基金资产净值及基金份额总额
报告截止日:2014年6月30日,基金份额净值1.427元,基金份额总额662,294,903.40份。

6.4.8 本报告期末基金资产净值及基金份额总额
报告截止日:2014年6月30日,基金份额净值1.427元,基金份额总额662,294,903.40份。

6.4.9 本报告期末基金资产净值及基金份额总额
报告截止日:2014年6月30日,基金份额净值1.427元,基金份额总额662,294,903.40份。

6.4.10 本报告期末基金资产净值及基金份额总额
报告截止日:2014年6月30日,基金份额净值1.427元,基金份额总额662,294,903.40份。

6.4.11 本报告期末基金资产净值及基金份额总额
报告截止日:2014年6月30日,基金份额净值1.427元,基金份额总额662,294,903.40份。

6.4.12 本报告期末基金资产净值及基金份额总额
报告截止日:2014年6月30日,基金份额净值1.427元,基金份额总额662,294,903.40份。

6.4.13 本报告期末基金资产净值及基金份额总额
报告截止日:2014年6月30日,基金份额净值1.427元,基金份额总额662,294,903.40份。

6.4.14 本报告期末基金资产净值及基金份额总额
报告截止日:2014年6月30日,基金份额净值1.427元,基金份额总额662,294,903.40份。

6.4.15 本报告期末基金资产净值及基金份额总额
报告截止日:2014年6月30日,基金份额净值1.427元,基金份额总额662,294,903.40份。

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

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(%)
1	600208	中国石化	25,413,696.61	4.86
2	600518	康美药业	24,233,129.83	4.65
3	000516	开元投资	17,830,971.85	3.28
4	600667	美安药业	17,625,893.83	3.26
5	002689	中利科技	17,528,784.99	3.24
6	002241	普华永道	17,353,578.33	3.24
7	000002	万科A	15,627,776.30	2.87
8	600048	中信证券	15,564,901.99	2.87
9	300271	华信医药	15,516,401.44	2.86
10	002191	游族网络	15,457,975.62	2.85
11	002513	芭田股份	15,320,010.33	2.83
12	600376	普华永道	15,008,866.44	2.79
13	002038	蒙发科技	14,592,977.35	2.70
14	600998	九州通	14,275,258.79	2.69
15	002038	蒙发科技	13,520,447.81	2.56
16	000961	中南建设	13,315,527.14	2.50
17	600525	长园集团	12,999,690.38	1.97
18	600280	华业地产	11,997,272.18	1.89
19	000558	莱茵置业	11,891,140.83	1.89
20	603000	人民同泰	11,871,478.04	1.88

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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(%)
1	600028	中国石化	24,641,738.33	3.91
2	600046	国电南瑞	17,493,240.60	2.77
3	600667	美安药业	16,990,866.71	2.70
4	601008	中信证券	16,448,869.48	2.61
5	002648	卫星石化	16,317,979.88	2.59
6	300058	蓝色光标	15,890,315.01	2.52
7	000002	万科A	15,709,130.27	2.49
8	000516	开元投资	15,116,819.94	2.35
9	601018	中信银行	14,640,809.82	2.32
10	300248	普华永道	14,533,771.11	2.31
11	002713	东富药业	14,275,145.13	2.26
12	601021	中农国际	13,303,083.18	2.11
13	600280	华业地产	12,901,105.35	2.00
14	000961	中南建设	12,594,125.71	2.00
15	300073	碧水源	12,110,405.00	1.92
16	601018	中信银行	11,834,300.00	1.88
17	300020	银江股份	11,260,140.43	1.78
18	300178	博晖光电	11,194,300.00	1.77
19	300058	蓝色光标	11,114,288.52	1.77
20	600518	康美药业	10,752,851.47	1.70

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(成交总额)	1,202,561,295.14
卖出股票的收入(成交总额)	958,427,178.93

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	地方政府债	-	-
4	企业债,高收益债	-	-
5	中期票据	-	-
6	中期债券	1,250,172.00	0.16
8	其他	-	-
9	合计	1,250,172.00	0.16

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	110025	国债转债	10,890	1,250,172.00	0.16

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)	
1	110025	国债转债	10,890	1,250,172.00	0.16

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12.1 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12.2 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12.3 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12.4 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12.5 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12.6 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12.7 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12.8 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12.9 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12.10 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12.11 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12.12 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细