上投摩根智选30股票型证券投资基金

【2014】第三季度报告

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年十月二十七日

§1重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	上投摩根智选30股票
基金主代码	370027
交易代码	370027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月6日
报告期末基金份额总额	1,014,637,062.50份
投资目标	本基金主要投资于受益于国家经济转型,具有较高增长潜力的上市公司股票,在有效控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	从长期来看,盈利的增长是推动公司股价上涨的重要因素。本基金将集中投资于具有良好业绩支撑和确定性成长的公司,以分享其股价上涨带来的收益。从具体操作上,本基金将通过严格的个股精选,筛选出具有较高竞争优势和成长能力的上市公司,并从中挑选出基金管理人认定的最具投资价值的30只左右的股票构建投资组合,以实现对优质股票的集中持股。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于较高风险、较高预期收益的基金产品。
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

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	-28,695,110.94
2.本期利润	127,206,471.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.1201
4.期末基金资产净值	1,165,916,747.99
5.期末基金份额净值	1.149

注: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。

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、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

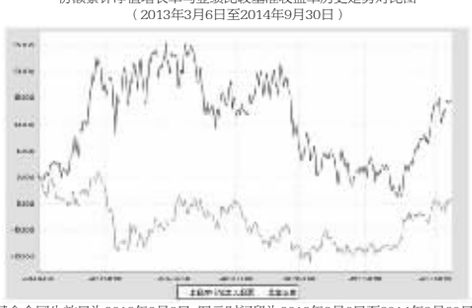
3.2基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	12.21%	1.04%	10.79%	0.72%	1.42%	0.32%

3.2.2自基金合同生效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

上投摩根智选30股票型证券投资基金
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
(2013年3月6日至2014年9月30日)



注:本基金合同生效日为2013年3月6日,图示时间段为2013年3月6日至2014年9月30日。本基金建仓期自2013年3月6日至2013年9月5日。建仓期结束时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基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜猛	本基金基金经理	2013-3-6	-	11年	南京大学经济学硕士,先后任职于天同证券、中原证券、国信证券和中银国际证券,任研究员、2007年10月起加入上投摩根基金管理有限公司,历任行业专家、上投摩根中国优势证券投资基金基金经理助理自2011年7月起担任上投摩根新兴动力股票型证券投资基金基金经理、自2013年3月起担任上投摩根智选30股票型证券投资基金基金经理,自2013年5月起同时担任上投摩根成长动力混合型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.杜猛先生为本基金首任基金经理,其任职日期指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《证券业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遵规守信情况的说明

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求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根智选30股票型证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求,严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动,通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析,以确保本公司管理的不同投资组合在投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动,本公司执行集中交易制度,确保不同投资组合在买卖同一证券时,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;对于银行间市场投资活动,本公司通过对手库控制和交易室询价机制,严格防范对手风险并检查价格公允性;对于申购投资行为,本公司遵循价格优先、比例分配的原则,根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内,通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析,未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,通过对交易价格、交易时间、交易方向等的分析,未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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的5%的情形:无。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

3季度宏观经济数据持续偏弱,宏观经济下行压力较为明显,央行主动释放流动性,保证了相对宽松的货币政策,同时也增强了市场对降息的预期。在此环境影响下,大市值公司有短暂反弹,但小市值及并购重组预期股票仍是3季度市场最活跃板块。

针对市场结构性特征,三季度在调整仓位的同时,对组合结构也做了调整:重点增持了信息服务、军工、公用事业和钢铁等行业,减持了金融服务,商业、电子等行业。

由于从年初以来小市值和并购重组题材股已经相对走强较长时间,我们预计短期较为丰厚的获利盘可能会带来相关个股较大调整压力。因此,进入4季度我们倾向于结合沪港互通的开启和3季财报发布期,逐步兑现小盘股和题材股收益。同时,结合年底估值切换行情,重点关注低估值、大市值蓝筹和前期滞涨的如医药、食品饮料等消费类公司。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为12.21%,同期业绩比较基准收益率为10.79%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

§5投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,028,949,417.30	83.84
	其中:股票	1,028,949,417.30	83.84
2	固定收益投资	30,057,000.00	2.45
	其中:债券	30,057,000.00	2.45
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	126,010,884.42	10.27
7	其他资产	42,245,461.97	3.44
8	合计	1,227,262,763.69	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,499.19	0.00
C	制造业	694,040,915.76	59.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,862,107.32	1.27
E	建筑业	139,849,230.97	11.99
F	批发和零售业	13,914,093.78	1.19
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	100,279,227.69	8.60
J	金融业	1,772,378.72	0.15
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,702,417.62	1.69
M	科学研究和技术服务业	30,178,010.78	2.59
N	水利、环境和公共设施管理业	13,902,592.26	1.19
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	446,943.21	0.04
S	综合	-	-
	合计	1,028,949,417.30	88.25

5.3报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002241	歌尔声学	3,503,867	96,531,535.85	8.28
2	300115	长盈精密	4,315,019	94,714,667.05	8.12
3	002353	杰瑞股份	2,087,836	81,383,847.28	6.98
4	002081	金螳螂	3,923,651	76,001,119.87	6.52
5	300168	万达信息	2,418,600	66,753,360.00	5.73
6	002375	亚厦股份	2,939,969	63,591,529.47	5.45
7	601633	长城汽车	1,564,639	47,580,671.99	4.08
8	002309	中利科技	2,027,014	45,992,947.66	3.94
9	000925	众合机电	1,533,339	35,481,464.46	3.04
10	002008	大族激光	1,750,844	34,229,000.20	2.94

5.4报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,057,000.00	2.58
	其中:政策性金融债	30,057,000.00	2.58
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	30,057,000.00	2.58

5.5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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140207	14国开07	200,000	20,046,000.00	1.72
2	140212	14国开12	100,000	10,011,000.00	0.86

5.6报告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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.7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
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 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。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.11投资组合报告附注
5.11.1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被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2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。
5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	405,178.46
2	应收证券清算款	40,958,926.04
3	应收股利	-
4	应收利息	665,233.62
5	应收申购款	216,123.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,245,461.97

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002353	杰瑞股份	21,633,900.00	1.86	非公开发行流通受限

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,133,165,329.17
报告期期间基金总申购份额	198,348,900.74
减:报告期期间基金总赎回份额	316,877,167.41
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,014,637,062.50

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
无。

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录
1. 中国证监会批准上投摩根智选30股票型证券投资基金设立的文件;
2.《上投摩根智选30股票型证券投资基金基金合同》;
3.《上投摩根智选30股票型证券投资基金托管协议》;
4.《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照;
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照
8.2存放地点
基金管理人或基金托管人处。
8.3查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一四年十月二十七日

上投摩根中国优势证券投资基金

【2014】第三季度报告

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年十月二十七日

§1重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	上投摩根中国优势混合
基金主代码	375010
交易代码	375010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年9月15日
报告期末基金份额总额	1,601,919,201.54份
投资目标	本基金在以长期投资为基本原则的基础上,通过严格的投资纪律约束和风险管理手段,将战略资产配置与投资时机有效结合,精心选择在经济全球化趋势下具有国际比较优势的中国企业,通过精选证券和适度主动投资,为国内投资者提供国际水平的理财服务,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金充分借鉴摩根资产管理集团全球行之有效的投资理念和技术,以国际视野审视中国经济发展,将国内行业发展趋势与上市公司价值判断纳入全球经济综合考量的范畴,通过定性/定量严谨分析的有机结合,准确把握国家/地区与上市公司的比较优势,最终实现上市公司内在价值的合理评估,投资组合资产配置与风险管理的正确实施。本基金以股票投资为主体,在股票选择和资产配置上分别采取"由下到上"和"由上到下"的投资策略。根据国内市场的具体特点,本基金积极利用摩根资产管理集团在全球市场的研究资源,用其国际视野观的优势价值评估体系甄别个股素质,并结合本地长期深入的公司调研和严格审慎的基本面与市场面分析,筛选出重点关注的上市公司股票。资产配置层面包括类别资产配置和行业资产配置,本基金不仅在股票、债券和现金三大资产类别间实施策略性调控,也通过对全球/区域行业效应进行评估后,确定行业资产配置权重,总体紧密监控组合风险与收益特征,以最终切实提高组合的流动性、稳定性与收益性。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中债总指数收益率×30%
风险收益特征	本基金努力追求资产配置动态平衡,在风险预算目标下使基金收益最大化,属于中等风险证券投资基金产品。
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

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	-14,833,484.32
2.本期利润	345,961,624.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.2091
4.期末基金资产净值	2,492,466,314.50
5.期末基金份额净值	1.5559

注: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。

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、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	15.65%	0.93%	9.43%	0.63%	6.22%	0.30%

3.2.2自基金合同生效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

上投摩根中国优势证券投资基金
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
(2004年9月15日至2014年9月30日)

注:本基金合同生效时间为2004年9月15日,图示时间段为2004年9月15日至2014年9月30日。

本基金建仓期自2004年9月15日至2005年3月14日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金自2013年12月7日起,将基金业绩比较基准由"富时中国A600指数收益率×70%+上证国债指数收益率×25%+同业存款利率×5%"变更为"沪深300指数收益率×70%+中债总指数收益率×30%"。

§4管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
董红波	本基金基金经理	2013-5-27	-	11年	管理学硕士,曾任职于中华全国供销合作总社监察局及办公厅、中国平安人寿上海分公司战略发展部,2004年进入泰信基金管理公司,先后担任研究部副经理、泰信先行策略基金经理助理,2007年1月至2008年6月担任泰信先行策略基金经理,2008年7月加入上投摩根基金管理有限公司,2009年1月起担任上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金经理,自2012年2月起担任上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金基金经理,自2013年5月起同时担任上投摩根中国优势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.证券从业的含义遵从行业协会《证券业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遵规守信情况的说明

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求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根中国优势证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求,严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动,通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析,以确保本公司管理的不同投资组合在投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动,本公司执行集中交易制度,确保不同投资组合在买卖同一证券时,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;对于银行间市场投资活动,本公司通过对手库控制和交易室询价机制,严格防范对手风险并检查价格公允性;对于申购投资行为,本公司遵循价格优先、比例分配的原则,根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内,通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析,未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,通过对交易价格、交易时间、交易方向等的分析,未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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的5%的情形:无。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

3季度宏观经济数据持续偏弱,宏观经济下行压力较为明显,央行主动释放流动性,保证了相对宽松的货币政策,同时也增强了市场对降息的预期。在此环境影响下,大市值公司有短暂反弹,但小市值及并购重组预期股票仍是3季度市场最活跃板块。

针对市场结构性特征,三季度在调整仓位和组合结构。操作上,本期主要增加了信息设备和信息服务等中小市值股票的配置比例,同时也加仓了军工、光伏配置比重;适当降低了房地产、金融、钢铁和化工等大市值公司的配置比例。前十大重仓股也对应做了调整。

我们认为,从年初以来小市值和并购重组题材股已经相对走强较长时间,较为丰厚的获利盘可能会带来相关个股较大调整压力。因此,进入4季度我们倾向于结合沪港互通的开启和3季财报陆续发布,逐步兑现小盘股和题材股收益。同时,把握年底估值切换行情时机,重点关注大市值蓝筹、前期滞涨的如医药、食品饮料等消费类行业公司。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为16.98%,同期业绩比较基准收益率为16.81%。

§5投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,305,216,708.33	90.80
	其中:股票	2,305,216,708.33	90.80
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	218,441,245.95	8.60
7	其他资产	15,121,980.84	0.60
8	合计	2,538,779,935.12	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,797,688,206.36	72.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	77,401,378.77	3.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	62,850.04	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	15,763,204.66	0.63
I	信息传输、软件和信息技术服务业	176,494,645.01	7.08
J	金融业	23,243,235.30	0.93
K	房地产业	117,606,370.47	4.72
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	85,759,617.72	3.44
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	11,197,200.00	0.45
	合计	2,305,216,708.33	92.49

5.3报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002038	双鹭药业	4,510,773	191,256,775.20	7.67
2	600893	航空动力	5,262,848	156,411,842.56	6.28
3	600518	康美药业	8,738,849	139,996,360.98	5.62
4	600887	伊利股份	5,324,574	137,906,466.60	5.53
5	000800	一汽轿车	7,144,513	79,304,094.30	3.18
6	000958	东方热电	5,765,668	77,317,607.88	3.10
7	000558	莱茵置业	12,177,423	76,595,990.67	3.07
8	000768	中航飞机	4,570,832	72,173,437.28	2.90
9	300315	掌趣科技	3,456,000	66,942,720.00	2.69
10	000555	神州信息	1,572,786	65,663,815.50	2.63

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
5.5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债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6报告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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.7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
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 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。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.11投资组合报告附注
5.11.1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被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票中没有超出基金合同规定的备选股票库。
5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	662,397.26
2	应收证券清算款	11,541,894.57
3	应收股利	-
4	应收利息	40,517.86
5	应收申购款	2,877,171.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,121,980.84

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000768	中航飞机	72,173,437.28	2.90	筹划非公开发行股票
2	300315	掌趣科技	66,942,720.00	2.69	筹划重大资产重组

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,698,640,887.84
报告期期间基金总申购份额	30,426,853.67
减:报告期期间基金总赎回份额	127,148,539.97
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,601,919,201.54

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
无。

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录
1、中国证监会批准上投摩根中国优势证券投资基金设立的文件;
2、《上投摩根中国优势证券投资基金基金合同》;
3、《上投摩根中国优势证券投资基金托管协议》;
4、《上投摩根开放式基金业务规则》;
5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
6、基金托管人业务资格批件和营业执照
8.2存放地点
基金管理人或基金托管人处。
8.3查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一四年十月二十七日

上投摩根中小盘股票型证券投资基金

【2014】第三季度报告

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年十月二十七日

§1重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	上投摩根中小盘股票
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
报告期末基金份额总额	456,652,871.15份
投资目标	本基金重点投资于中国A股市场上的中小盘股票,通过缜密的资产配置原则和严格的行业个股选择,分享中国经济高速增长给优势中小市值上市公司带来的机遇,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。
投资策略	本基金充分借鉴摩根资产管理集团全球行之有效的投资理念和技术,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,重点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监控,动态调整股票、债券等大类资产配置。
业绩比较基准	40%×天相中盘指数收益率+40%×天相小盘指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	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混合型基金和债券型基金。
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

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	20,977,589.37
2.本期利润	98,755,187.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.2060
4.期末基金资产净值	651,380,075.87
5.期末基金份额净值	1.426

注: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。

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、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

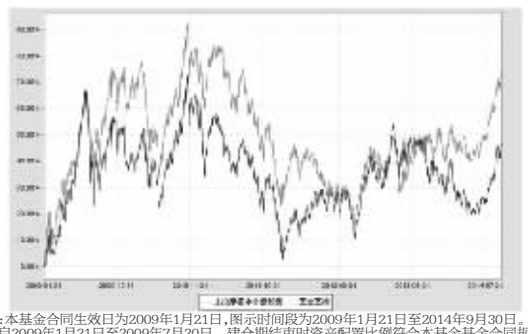
3.2基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.98%	0.92%	16.81%	0.70%	0.17%	0.22%

3.2.2自基金合同生效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

上投摩根中小盘股票型证券投资基金
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
(2009年1月21日至2014年9月30日)



注:本基金合同生效日为2009年1月21日,图示时间段为2009年1月21日至2014年9月30日。本基金建仓期自2009年1月21日至2009年7月20日。建仓期结束时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基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
董红波	本基金基金经理	2009-1-21	-	11年	管理学硕士,曾任职于中华全国供销合作总社监察局及办公厅、中国平安人寿上海分公司战略发展部,2004年进入泰信基金管理公司,先后担任研究部副经理、泰信先行策略基金经理助理,2007年1月至2008年6月担任泰信先行策略基金经理,2008年7月加入上投摩根基金管理有限公司,2009年1月起担任上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金经理,自2012年2月起担任上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金基金经理,自2013年5月起同时担任上投摩根中国优势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.董红波先生为本基金首任基金经理,其任职日期指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《证券业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遵规守信情况的说明

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求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制