上投摩根核心成长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	上投摩根核心成长股票
基金主代码	000457
交易代码	000457
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年2月10日
报告期末基金份额总额	907,230,783.69份
投资目标	本基金将充分利用管理人的投资研究平台,通过系统和深入的基本面研究,选择公司治理良好且具有较高增长潜力的公司进行投资,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用"自下而上"的个股精选策略,综合运用定量分析与定性分析的手段,基于公司内部研究团队对于个股基本面的深入研究和细致的实地调研,重点投资于公司治理良好且具有较高增长潜力的公司。在行业配置层面,本基金将对宏观经济发展状况及趋势、行业周期性及景气度、行业相对估值水平等方面进行研究,判断各个行业的相对投资价值,参考整体市场的行业资产分布比例,确定和动态调整各个行业的配置比例。在个股选择层面,本基金通过纪律化的投资约束,力争最大程度地将内部研究成果转化为投资业绩,公司研究团队负责内部研究组合的构建与维护。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×85%+中债总指数收益率×15%
风险收益特征	本基金属于股票型基金产品,预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于较高风险收益水平的基金产品。
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	41,813,987.83
2.本期利润	173,879,274.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.1639
4.期末基金资产净值	1,034,208,787.47
5.期末基金份额净值	1.1400

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	16.92%	0.93%	11.32%	0.76%	5.60%	0.17%

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

上投摩根核心成长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
(2014年2月10日至2014年9月30日)

注:本基金合同生效日为2014年2月10日,截至报告期末本基金合同生效未满一年。本基金建仓期自2014年2月10日至2014年8月8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		
孙芳	本基金基金经理	2014-2-10	-	11年	华东师范大学经济学硕士,2003年7月至2006年10月任华宝兴业基金行业研究员;自2006年12月起加入上投摩根基金管理有限公司,先后担任行业专家、基金经理助理,主要负责投资研究方面的工作。自2011年12月起担任上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金经理,2012年11月起担任上投摩根核心优选股票型证券投资基金基金经理,2014年2月起同时担任上投摩根核心成长股票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.孙芳女士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、《上投摩根核心成长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

在经历短暂调整之后,3季度中小板指数与创业板指数继续上涨,并创出年度新高或者涨回前期高点。总体来说,本年度的中小市值板块的股价表现之好是超出我们预期的,其原因当然有我们之前持续认为的宏观经济缓步下行致使市场资金集中于政策支持与新增长方向的新型产业,此为长期因素。而在3季度,我们认为产业资本对资本市场愈来愈深的融入、参与是更为重要的原因。我们观察到,随着时间的推移,在政策的鼓励(新国九条)之下,产业资本通过各种方式拿出真金白银参与二级市场的行为越来越多,已成风潮。大股东、高管增持行为成为一剂强心针,引导投资者增强对企业经营改善的信心,这些企业多数都蕴含了转型预期,这种投资主题实质上与2季度有良好表现的转型主题一脉相承。另外,3季度的国防军工、新能源、信息安全相关板块表现良好,本基金也进行了适度参与。

年内最后一个季度,按经验往往具有更多的博弈可能,而且时点与方向总是与最初预期的不太一致,所以我们将保持谨慎与灵活并重。四中全会将是4季度一个重要的政策事件,沪港通的实施也将部分改变投资者结构。我们认为4季度应将组合趋于均衡,重点关注基本面良好的行业配置比重,如新能源、国防安全;此外,政策驱动因素将持续存在,改革相关的主题投资依然将活跃,如国企改革、新产业规划相关等。

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16.92%,同期业绩比较基准收益率为11.32%。

§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	965,495,250.76	89.71
	其中:股票	965,495,250.76	89.71
2	固定收益投资	49,124,100.00	4.56
	其中:债券	49,124,100.00	4.56
	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	43,069,640.17	4.00
7	其他资产	18,553,992.95	1.72
8	合计	1,076,242,983.88	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	4,356,447.09	0.42
C	制造业	693,732,867.18	67.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,024,065.76	1.74
E	建筑业	9,642,322.12	0.93
F	批发和零售业	30,885.75	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	3,568,334.00	0.35
H	住宿和餐饮业	5,023,231.40	0.49
I	信息传输、软件和信息技术服务业	140,766,823.09	13.61
J	金融业	19,852.41	0.00
K	房地产业	43,266,771.80	4.18
L	租赁和商务服务业	25,556,262.76	2.47
M	科学研究和技术服务业	3,871,448.00	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	12,193,975.40	1.18
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	3,092,444.00	0.30
S	综合	2,349,520.00	0.23
	合计	965,495,250.76	93.36

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	002309	中利科技	1,437,504	32,616,965.76	3.15
2	002241	歌尔声学	1,091,820	30,079,641.00	2.91
3	002610	爱康科技	1,524,417	29,061,993.36	2.81
4	600571	信雅达	1,261,499	29,052,321.97	2.81
5	300274	阳光电源	1,290,114	25,415,245.80	2.46
6	300071	华谊嘉信	1,462,451	24,510,678.76	2.37
7	600406	国电南瑞	1,341,276	22,976,057.88	2.22
8	002353	杰瑞股份	552,445	21,534,306.10	2.08
9	002139	拓邦股份	1,324,504	21,178,818.96	2.05
10	002038	双鹭药业	492,775	20,893,660.00	2.02

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	19,055,100.00	1.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,069,000.00	2.91
	其中:政策性金融债	30,069,000.00	2.91
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	49,124,100.00	4.75

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	300,000	30,069,000.00	2.91
2	019322	13国债22	190,000	19,055,100.00	1.84

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	504,040.61
2	应收证券清算款	9,940,716.67
3	应收股利	-
4	应收利息	1,396,336.97
5	应收申购款	6,712,898.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,553,992.95

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	600571	信雅达	29,052,321.97	2.81	公告重大资产重组事项
2	002610	爱康科技	6,282,900.00	0.61	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	1,119,680,187.77
报告期期间基金总申购份额	560,358,880.95
减:报告期期间基金总赎回份额	772,808,285.03
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	907,230,783.69

§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核心成长股票型证券投资基金设立的文件;
2.《上投摩根核心成长股票型证券投资基金基金合同》;
3.《上投摩根核心成长股票型证券投资基金基金托管协议》;
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

上投摩根核心优选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	上投摩根核心优选股票
基金主代码	370024
交易代码	370024
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月28日
报告期末基金份额总额	669,746,995.92份
投资目标	本基金将充分利用基金管理人研究团队的集体智慧,以内部研究组合作为核心股票,从中优选出具有良好基本面和较高成长性的公司进行投资,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1.资产配置策略 本基金将从宏观层面出发,采用定量分析和定性分析相结合的手段,对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行综合分析,结合股票、债券等各类资产风险收益特征,确定合适的资产配置比例。 2.股票投资策略 本基金将依托本基金管理人的研究平台,采用"自下而上"的个股精选策略,基于公司内部研究团队对于个股的基本面的深入研究和细致的实地调研,选择具有良好基本面和成长空间的个股。本基金的股票投资包含核心股票和优选股票两个层面。核心股票由公司内部研究组合构成,主要包含了研究部推荐股票,是研究员在对个股进行深度研究和实地调研基础上提出的投资建议。优选股票是指基金经理基于对宏观经济、政策、行业以及个股的深入研究与把握,从核心股票中优选具有良好投资价值的股票,构建股票投资组合。本基金明确提出将不低于80%的股票资产投资于公司内部研究组合中的股票。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%
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	33,066,066.55
2.本期利润	148,119,499.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.2400
4.期末基金资产净值	1,109,210,107.97
5.期末基金份额净值	1.656

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。

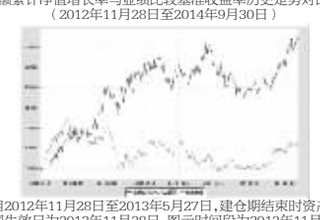
3.2基金净值表现

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	16.05%	0.96%	11.39%	0.76%	4.66%	0.20%

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

上投摩根核心优选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
(2012年11月28日至2014年9月30日)



注:本基金建仓期自2012年11月28日至2013年5月27日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。本基金合同生效日为2012年11月28日,图示时间段为2012年11月28日至2014年9月30日。

§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		
孙芳	本基金基金经理	2012-11-28	-	11年	华东师范大学经济学硕士,2003年7月至2006年10月任华宝兴业基金行业研究员;自2006年12月起加入上投摩根基金管理有限公司,先后担任行业专家、基金经理助理,主要负责投资研究方面的工作。自2011年12月起担任上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金经理,2012年11月起担任上投摩根核心优选股票型证券投资基金基金经理,2014年2月起同时担任上投摩根核心成长股票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.孙芳女士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、《上投摩根核心优选股票型证券投资基金基金合同》的规定。除以下情况外,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:本基金曾出现个别由于市场原因引起的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形,但已在规定时间内调整完毕。

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

在经历短暂调整之后,3季度中小板指数与创业板指数继续上涨,并创出年度新高或者涨回前期高点。总体来说,本年度的中小市值板块的股价表现之好是超出我们预期的,其原因当然有我们之前持续认为的宏观经济缓步下行致使市场资金集中于政策支持与新增长方向的新型产业,此为长期因素。而在3季度,我们认为产业资本对资本市场愈来愈深的融入、参与是更为重要的原因。我们观察到,随着时间的推移,在政策的鼓励(新国九条)之下,产业资本通过各种方式拿出真金白银参与二级市场的行为越来越多,已成风潮。大股东、高管增持行为成为一剂强心针,引导投资者增强对企业经营改善的信心,这些企业多数都蕴含了转型预期,这种投资主题实质上与2季度有良好表现的转型主题一脉相承。另外,3季度的国防军工、新能源、信息安全相关板块表现良好,本基金也进行了适度参与。

年内最后一个季度,按经验往往具有更多的博弈可能,而且时点与方向总是与最初预期的不太一致,所以我们将保持谨慎与灵活并重。十八届四中全会将是4季度一个重要的政策事件,沪港通的实施也将部分改变投资者结构。我们认为4季度应将组合趋于均衡,重点关注基本面良好的行业配置比重,如新能源、国防安全;此外,政策驱动因素将持续存在,改革相关的主题投资依然将保持活跃,如国企改革、新产业规划相关等。

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16.05%,同期业绩比较基准收益率为11.39%。

§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	1,008,075,212.41	87.66
	其中:股票	1,008,075,212.41	87.66
2	固定收益投资	40,098,000.00	3.49
	其中:债券	40,098,000.00	3.49
	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	94,936,863.27	8.26
7	其他资产	6,813,221.20	0.59
8	合计	1,149,923,296.88	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	6,541,151.06	0.59
C	制造业	690,661,338.33	62.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,783,733.24	1.87
E	建筑业	28,218,043.21	2.54
F	批发和零售业	1,870,256.40	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	6,511,850.00	0.59
H	住宿和餐饮业	11,566,630.00	1.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	123,677,260.78	11.15
J	金融业	11,916,812.56	1.07
K	房地产业	44,180,957.84	3.98
L	租赁和商务服务业	31,097,596.24	2.80
M	科学研究和技术服务业	6,825,406.00	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	11,975,000.55	1.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	22,536.20	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,522,940.00	0.50
S	综合	6,703,700.00	0.60
	合计	1,008,075,212.41	90.88

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	002309	中利科技	1,382,003	31,357,648.07	2.83
2	002610	爱康科技	1,344,485	25,965,058.80	2.34
3	600571	信雅达	1,110,582	25,576,703.46	2.31
4	002241	歌尔声学	842,304	23,205,475.20	2.09
5	002353	杰瑞股份	573,555	22,357,173.90	2.02
6	600406	国电南瑞	1,280,666	21,937,808.58	1.98
7	002139	拓邦股份	1,230,140	19,669,938.60	1.77
8	002444	巨星科技	1,507,720	19,600,360.00	1.77
9	600038	哈飞股份	501,518	17,653,433.60	1.59
10	300071	华谊嘉信	1,046,258	17,535,284.08	1.58

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	10,029,000.00	0.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,069,000.00	2.71
	其中:政策性金融债	30,069,000.00	2.71
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	40,098,000.00	3.62

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	300,000	30,069,000.00	2.71
2	019322	13国债22	100,000	10,029,000.00	0.90

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	337,480.78
2	应收证券清算款	3,129,983.93
3	应收股利	-
4	应收利息	1,084,062.59
5	应收申购款	2,261,693.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,813,221.20

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	600571	信雅达	25,576,703.46	2.31	公告重大资产重组
2	002353	杰瑞股份	8,770,500.00	0.79	非公开发行流通受限
3	002610	爱康科技	4,188,600.00	0.38	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	562,294,903.40
报告期期间基金总申购份额	337,006,717.81
减:报告期期间基金总赎回份额	229,554,625.29
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	669,746,995.92

§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核心优选股票型证券投资基金设立的文件;
2.《上投摩根核心优选股票型证券投资基金基金合同》;
3.《上投摩根核心优选股票型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

上投摩根分红添利债券型证券投资基金

【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	上投摩根分红添利债券
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月25日
报告期末基金份额总额	67,768,468.14份
投资目标	在有效控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极主动的投资管理,力争为投资者创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。通过对固定收益资产的投资,获取稳定的投资收益;在此基础上,适当参与新股发行申购及增发新股申购,在严格控制基金资产运作风险的基础上,实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中信标普全债指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	上投摩根分红添利债券A类 / 上投摩根分红添利债券B类
下属两级基金的交易代码	370021 / 370022
报告期末下属两级基金的份额总额	48,563,835.14份 / 19,204,633份

§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)	
	上投摩根分红添利债券A类	上投摩根分红添利债券B类
1.本期已实现收益	1,577,753.39	416,544.87
2.本期利润	2,308,365.85	660,706.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0447	0.0469
4.期末基金资产净值	52,181,379.75	20,576,539.91
5.期末基金份额净值	1.074	1.071

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

上投摩根分红添利债券A类:

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	4.44