上投摩根成长先锋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	上投摩根成长先锋股票
基金主代码	378010
交易代码	378010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月20日
报告期末基金份额总额	1,941,870,665.99份
投资目标	本基金主要投资于国内市场上展现最佳成长特质的股票,积极捕捉高成长性上市公司所带来的投资机会,努力实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	(1)股票投资策略 本基金采取定量分析与定性分析相结合方式,挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司,主动出击、积极管理将是本基金运作的重要特色。(2)固定收益类投资策略 本基金以股票投资为主,一般市场情况下,基金管理人不会积极追求大类资产配置,但为进一步控制投资风险,优化组合流动性管理,本基金将适度防御性资产配置,进行债券、货币市场工具等品种投资。 在券种选择上,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是主动型股票基金,属于证券投资基金的高风险品种,预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。
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	17,970,022.98
2.本期利润	237,641,007.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.1186
4.期末基金资产净值	2,505,579,915.43
5.期末基金份额净值	1.2903

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。

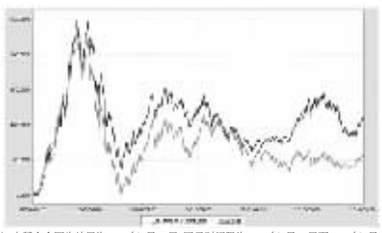
3.2基金净值表现

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	10.23%	0.93%	10.69%	0.72%	-0.46%	0.21%

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

上投摩根成长先锋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
(2006年9月20日至2014年9月30日)



注:本基金合同生效日为2006年9月20日,图示时间段为2006年9月20日至2014年9月30日。

本基金建仓期自2006年9月20日至2007年3月19日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金的业绩比较基准于2013年12月7日由原"富时中国A600成长指数×80%+同业存款利率×20%"变更为"沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%"。

§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		
罗建辉	本基金基金经理	2013-6-20	-	15年	南京大学管理学硕士,1999年7月至2002年9月在东方证券有限责任公司资产管理部从事投资研究工作;2002年10月至2005年5月在金鹰基金管理有限公司从事投资研究工作;2005年5月至2009年7月在平安资产管理有限责任公司从事成长股票组合的管理工作;2009年7月加入上投摩根基金管理有限公司,主要从事股票市场及上市公司营运及相关产业投资研究的工作。2009年10月起任上投摩根双核平衡混合型证券投资基金基金经理,2010年12月至2013年8月担任上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金基金经理,自2013年6月起担任上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金经理,自2013年11月起同时担任上投摩根转型动力灵活配置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、《上投摩根成长先锋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授权、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

进入3季度,地产下滑对于经济的拖累逐步显现,以PMI及工业增加值为代表的各项经济指标表现低迷,整体经济较2季度有所回落。与低迷的经济走势不对,不断增强的政策预期、出台的各种微刺激政策带动无风险利率水平不断下行,配合微观层面日趋活跃的兼并重组以及企业转型,风险溢价水平的下降推动市场迎来了一轮大幅上涨,上涨的显著特征就是小市值、绩差股为代表的个股以及相关指数大幅跑赢主板,与此同时,部分传统的大消费、金融地产等表现较为乏力,市场的价值投资理念受到了较大冲击。

针对这一阶段市场风格的切换,我们也积极进行了调整,适度降低前期持有中大市值的个股,加大了对于计算机、互联网等中小市值个股的配置,取得了不错的效果。

展望4季度,稳增长的政策基调以及适度宽松的货币政策没有变化,但同时市场也将引入三大新的变量:房地产政策的全面放松、十八届四中全会的改革方案以及沪港通的正式推出。经历了3季度的大幅上涨以及最近一段时间海外股市的大幅回撤,预计市场在获利回吐压力以及各种呼护市场力量并行的情况下将呈现出先抑后扬的走势。在市场运行中枢不断抬升的格局下,预计市场将更多的从前期滞涨板块以及新的主题中寻找投资机会。在大的宏观环境保持平稳的背景下,我们将坚持自下而上深挖主题和个股,挑选出真正代表中国经济发展方向和市值变迁的行业和个股,包括新能源汽车、互联网融合、医疗器械、移动支付、环保等,为投资者带来更好的回报。

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10.23%,同期业绩比较基准收益率为10.69%。

§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	2,298,063,759.93	91.04
	其中:股票	2,298,063,759.93	91.04
2	固定收益投资	113,939,180.02	4.51
	其中:债券	113,939,180.02	4.51
	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	108,031,337.41	4.28
7	其他资产	4,227,378.06	0.17
8	合计	2,524,261,655.42	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	326,239,774.02	13.02
B	采矿业	41,329,179.87	1.65
C	制造业	1,254,098,950.40	50.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,132,194.89	0.92
E	建筑业	7,058,907.24	0.28
F	批发和零售业	26,150,194.40	1.04
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	25,108,600.00	1.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	354,569,774.88	14.15
J	金融业	4,458,323.88	0.18
K	房地产业	87,357,644.16	3.49
L	租赁和商务服务业	39,957,484.88	1.59
M	科学研究和技术服务业	32,229,342.45	1.29
N	水利、环境和公共设施管理业	60,762,292.66	2.43
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	15,611,096.20	0.62
S	综合	-	-
	合计	2,298,063,759.93	91.72

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	002714	牧原股份	2,822,836	155,171,294.92	6.19
2	002299	圣农发展	8,525,895	125,160,138.60	5.00
3	002358	森源电气	3,800,000	117,420,000.00	4.69
4	002153	石基信息	776,634	54,675,033.60	2.18
5	002353	杰瑞股份	1,222,500	47,653,050.00	1.90
6	600571	信雅达	2,018,352	46,482,646.56	1.86
7	000656	金科股份	4,173,382	45,907,202.00	1.83
8	000925	众合机电	1,819,883	42,112,092.62	1.68
9	002013	中航机电	1,847,770	40,928,105.50	1.63
10	000768	中航飞机	2,556,058	40,360,155.82	1.61

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	109,627,000.00	4.38
	其中:政策性金融债	109,627,000.00	4.38
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,312,180.02	0.17
8	其他	-	-
9	合计	113,939,180.02	4.55

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	140430	14农发30	200,000	20,044,000.00	0.80
2	140212	14国开12	200,000	20,022,000.00	0.80
3	130243	13国开43	200,000	20,010,000.00	0.80
4	110418	11农发18	200,000	19,988,000.00	0.80
5	140213	14国开13	200,000	19,972,000.00	0.80

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	1,273,442.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,682,923.45
5	应收申购款	271,011.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,227,378.06

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	3,741,001.00	0.15
2	128004	久立转债	355,991.15	0.01

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	002358	森源电气	117,420,000.00	4.69	筹划重大资产重组
2	002353	杰瑞股份	47,653,050.00	1.90	非公开发行流通受限
3	600571	信雅达	46,482,646.56	1.86	筹划重大资产重组
4	000768	中航飞机	40,360,155.82	1.61	筹划非公开发行股票

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	1,974,601,617.85
报告期期间基金总申购份额	95,691,683.26
减:报告期期间基金总赎回份额	128,422,635.12
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,941,870,665.99

§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成长先锋股票型证券投资基金设立的文件;
2、《上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金合同》;
3、《上投摩根成长先锋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

上投摩根大盘蓝筹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	上投摩根大盘蓝筹股票
基金主代码	376510
交易代码	376510
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月20日
报告期末基金份额总额	274,679,540.38份
投资目标	通过投资大盘蓝筹股票,力争最大程度的分享中国经济持续发展带来的中长期收益。在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
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,"自下而上"的精选个股,重点投资于在行业内占有领先地位、业绩良好且稳定增长、价值相对低估的大盘蓝筹上市公司。同时结合宏观经济运行状况和金融市场运行分析趋势的市场研判,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	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	本基金属于股票型基金产品,在开放式基金中,其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,属于风险水平较高的基金产品。
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	11,278,696.74
2.本期利润	19,770,821.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0681
4.期末基金资产净值	274,735,335.40
5.期末基金份额净值	1.000

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。

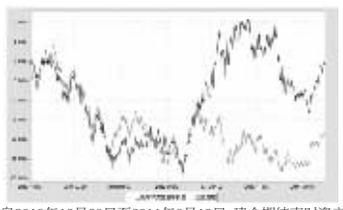
3.2基金净值表现

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	7.41%	0.87%	11.39%	0.76%	-3.98%	0.11%

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

上投摩根大盘蓝筹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
(2010年12月20日至2014年9月30日)



注:本基金建仓期自2010年12月20日至2011年6月19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2010年12月20日,图示时间段为2010年12月20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		
征茂平	本基金基金经理	2013-7-22	-	12年	征茂平先生自2001年3月至2004年3月在上海证大投资管理有限公司任高级研究员从事证券研究的工作;2004年3月至2005年4月在平安证券有限公司任高级研究员从事证券研究的工作;2005年5月至2008年5月在大成基金管理有限公司任研究员从事成长股票组合的管理工作;2008年5月起加入上投摩根基金管理有限公司,担任行业专家兼基金经理助理,自2013年7月起担任上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金基金经理,自2013年9月起担任上投摩根红利回报混合型证券投资基金基金经理,自2014年1月起同时担任上投摩根阿尔法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.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、《上投摩根大盘蓝筹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授权、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

尽管2014年三季度国内经济增速整体低于预期,但在沪港通、国企混合所有制改革、土地流转等政策红利刺激下,A股市场出现久违的放量反弹,市场风格轮动效应明显:以金融、汽车等低估值大盘蓝筹在沪港通以及经济复苏的带动下一度走高,但其持续性有限,之后中小盘个股和主题投资再次成为市场领涨的主导力量。事实上,三季度A股市场投资者风险偏好进一步提升,增量资金介入的迹象非常明显。

本基金三季度对组合结构有所调整:继续降低持股集中度,同时通过提高行业景气出现拐点的军工类等个股的持股比例以增加组合的弹性;超配盈利增长明确的医药、消费电子等行业。由于对主题投资参与度有限,加之部分重仓股在三季度初期出现大幅下跌,导致本基金净值在三季度表现一般。

预计四季度国内经济增速将企稳回升,主要基于政府托底经济的态势不会改变和政策调整对经济产生的积极影响将会逐步体现。在经过三季度的大幅上涨后,本基金判断四季度A股市场收益风险比将会逐步回落:前期涨幅较大、缺乏基本面支持的板块和个股将面临业绩证伪,同时海外市场风险偏好一旦回落将在一定程度上对A股权重板块带来负面影响;另一方面,在流动性整体宽松、长期利率回落、经济回升的背景下,预计市场下行空间有限,震荡调整为主。在操作上,本基金将继续优化组合结构,重点关注成长能力较强的医药、食品等大消费板块,看好消费电子、铁路设备、高端装备、环保等景气明显回升的行业投资机会;策略上总体回避估值高企的创业板个股,看好低估值蓝筹股投资机会。

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7.41%,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	246,770,017.32	89.03
	其中:股票	246,770,017.32	89.03
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	20,253,880.26	7.31
7	其他资产	10,160,199.40	3.67
8	合计	277,184,096.98	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	6,063,244.66	2.21
C	制造业	181,660,513.77	66.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,368,528.00	0.86
E	建筑业	9,393,877.96	3.42
F	批发和零售业	4,849,253.20	1.77
G	交通运输、仓储和邮政业	352,162.26	0.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,743,859.47	11.55
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,333,516.00	1.58
M	科学研究和技术服务业	6,005,062.00	2.19
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
	合计	246,770,017.32	89.82

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	663,070	18,267,578.50	6.65
2	002353	杰瑞股份	365,664	14,253,582.72	5.19
3	002038	双鹭药业	323,342	13,709,700.80	4.99
4	300115	长盈精密	403,956	8,866,834.20	3.23
5	600406	国电南瑞	482,700	8,268,651.00	3.01
6	002104	恒宝股份	565,771	8,203,679.50	2.99
7	002008	大族激光	408,056	7,977,494.80	2.90
8	002022	科华生物	273,173	7,359,280.62	2.68
9	300207	欣旺达	215,509	7,096,711.37	2.58
10	300157	恒泰艾普	338,162	6,063,244.66	2.21

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	184,854.75
2	应收证券清算款	9,882,100.64
3	应收股利	-
4	应收利息	6,034.06
5	应收申购款	87,209.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,160,199.40

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	300207	欣旺达	7,096,711.37	2.58	筹划重大事项
2	300157	恒泰艾普	6,063,244.66	2.21	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

因四舍五入的原因,投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

§6开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	298,051,840.63
报告期期间基金总申购份额	9,139,881.54
减:报告期期间基金总赎回份额	32,512,181.79
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	274,679,540.38

§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大盘蓝筹股票型证券投资基金设立的文件;
2. 《上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金基金合同》;
3. 《上投摩根大盘蓝筹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

上投摩根纯债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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	上投摩根纯债债券
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月24日
报告期末基金份额总额	45,574,448.31份
投资目标	本基金将根据对利率趋势的预判,适时规划与调整组合目标久期,结合主动性资产配置,在严格控制组合投资风险的同时,提高基金资产流动性与收益性水平,以追求超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	目标久期管理将优化固定收益投资的安全性、收益性与流动性。本基金严格遵循投资流程,对宏观经济、财政货币政策、市场利率水平及债券发行主体的信用情况等因素进行深入研究,通过审慎把握利率期限结构的变动趋势,适时制定目标久期管理计划,通过合理的资产配置及组合目标久期管理,控制投资风险,追求可持续的、超出业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中国债券总指数。
风险收益特征	本基金是债券型基金,在证券投资基金中属于较低风险品种,其预期风险收益水平低于股票型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	上投摩根纯债债券A / 上投摩根纯债债券B
下属两级基金的交易代码	371020 / 371120
报告期末下属两级基金的份额总额	20,643,700.37份 / 24,930,747.94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)	
	上投摩根纯债债券A	上投摩根纯债债券B
1.本期已实现收益	270,397.33	281,384.47
2.本期利润	760,120.32	840,325.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0364	0.0345
4.期末基金资产净值	23,962,133.36	28,306,345.01
5.期末基金份额净值	1.161	1.135

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

上投摩根纯债债券A:

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	3.29%	0.11%	0.64%	0.11%	2.65%	0.00%

上投摩根纯债债券B:

| 阶段 | 净值增长率① |