

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金

[2015] 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:中国建设银行股份有限公司

报告书日期:二〇一五年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及基金经理人声明不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、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基金合同规定,于2015年7月17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。

本报告告期财务数据未经审计。

本报告告期财务数据未经审计。

§2 基金产品概况

基金名称:上投摩根中证消费服务指数

基金代码:370023

交易时间:370023

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2012年8月25日

报告期末基金份额总额:26,766,642.40份

本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,在严格控制基金净值增长率和跟踪误差的基础上,追求超越标的指数的回报。

投资目标:本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。以实现对中证消费服务指数的跟踪。

业绩比较基准:95%×中证消费服务指数+5%×银行存款利率(税后)

风险收益特征:本基金为指数基金,长期平均风险和预期收益率高于货币基金,债券基金

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 (2015年4月1日-2015年6月30日)

1.本期已实现收益 12,064,169.62

2.本期利润 3,693,626.75

3.加权平均基金份额本期利润 0.1328

4.期末基金资产净值 43,016,831.94

5.期末基金份额净值 1.067

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,本期利息收入为本期应收利息加上本期公允价值变动收益。

本期利润指基金利润减去基金公允价值变动损失后的各项费用(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),计算时采用实际收益水平低于所列示的数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本期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 业绩比较基准收益率② 净值增长率差额③ ①-② ②-④

过去三个月 9.47% 2.4% 7.06% -0.89% 0.04%

3.2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金合同生效日:2012年3月24日,建仓期结束日:资产配置比例符合本基金合同规定。

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2012年3月25日至2015年6月30日)



注:本基金合同生效日为2012年3月25日,图示时间区间为2012年3月25日至2015年6月30日。本基金建仓自2012年3月25日至2013年3月24日,建仓期结束日资产配置比例符合本基金合同规定。

§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

黄伟 本基金基金经理 2012-09-25 - 10年 上海财经大学金融学硕士,2005年8月至2010年先后在东证、工银瑞信任职,2010年1月加入上投摩根基金管理有限公司,主要从事金融产品研究工作。2012年9月起担任本基金基金经理。

注:1. 本职即担任本基金基金经理,其任职日期即为本基金合同生效之日,即2012年3月25日。2. 本基金的基金经理由基金管理人决定并报中国证监会备案的人员担任。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》的规定。

4.2 基金经理的承诺 为基金份额持有人的利益勤勉尽责地履行基金合同规定的职责,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,不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.3 本基金基金经理在任职期间未有因基金合同约定的回避情形。

4.4 本基金基金经理在任职期间未有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到行政、民事处罚。

4.5 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.6 本基金基金经理在任职期间未有被撤销基金从业资格。

4.7 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.8 本基金基金经理在任职期间未有被撤销基金从业资格。

4.9 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.10 本基金基金经理在任职期间未有被撤销基金从业资格。

4.11 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.12 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.13 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.14 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.15 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.16 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.17 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.18 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.19 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.20 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.21 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.22 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.23 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.24 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.25 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.26 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.27 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.28 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.29 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.30 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.31 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.32 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.33 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.34 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.35 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.36 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.37 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.38 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.39 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.40 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.41 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.42 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.43 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.44 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.45 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.46 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.47 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.48 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.49 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.50 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.51 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.52 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.53 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.54 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.55 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.56 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.57 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.58 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.59 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.60 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.61 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.62 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.63 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.64 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.65 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.66 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.67 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.68 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.69 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.70 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.71 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.72 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.73 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.74 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.75 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.76 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.77 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.78 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.79 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.80 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.81 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.82 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.83 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.84 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.85 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.86 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.87 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.88 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.89 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.90 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.91 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.92 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.93 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.94 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.95 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.96 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.97 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.98 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.99 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.10 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.11 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.12 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.13 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.14 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.15 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.16 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.17 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.18 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.19 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.20 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.21 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.22 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.23 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.24 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。

4.25 本基金基金经理在任职期间未有被暂停履行职务。