

# 上投摩根中小盘股票型证券投资基金 2010 年年度报告摘要

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：二〇一一年三月二十九日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2011 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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
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

报告期末基金份额总额	895,728,944.53 份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

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富林明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	本基金的业绩比较基准为：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。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上投摩根基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	洪霞
	联系电话	021-38794999
	电子邮箱	xia.hong@jpmf-sitico.com
客户服务电话	400-889-4888	010-67595096
传真	021-68881170	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.51fund.com">http://www.51fund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所。

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日
---------------	--------	--

本期已实现收益	118,555,555.77	238,701,706.19
本期利润	56,949,038.21	383,719,999.43
加权平均基金份额本期利润	0.0596	0.4202
本期基金份额净值增长率	4.56%	53.00%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2010 年末</b>	<b>2009 年末</b>
期末可供分配基金份额利润	0.4233	0.3398
期末基金资产净值	1,391,424,010.29	1,482,027,795.03
期末基金份额净值	1.553	1.530

注：

1. 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。对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

2. 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. 本基金于 2009 年 1 月 21 日正式成立。2009 年度是指 2009 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	5.72%	1.84%	5.84%	1.44%	-0.12%	0.40%
过去六个月	28.03%	1.55%	25.61%	1.29%	2.42%	0.26%
过去一年	4.56%	1.50%	2.13%	1.33%	2.43%	0.17%
自基金合同生效起至今	59.97%	1.69%	75.04%	1.52%	-15.07%	0.17%

注：

本基金的业绩比较基准为：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。

#### 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 2010 年 12 月 31 日）



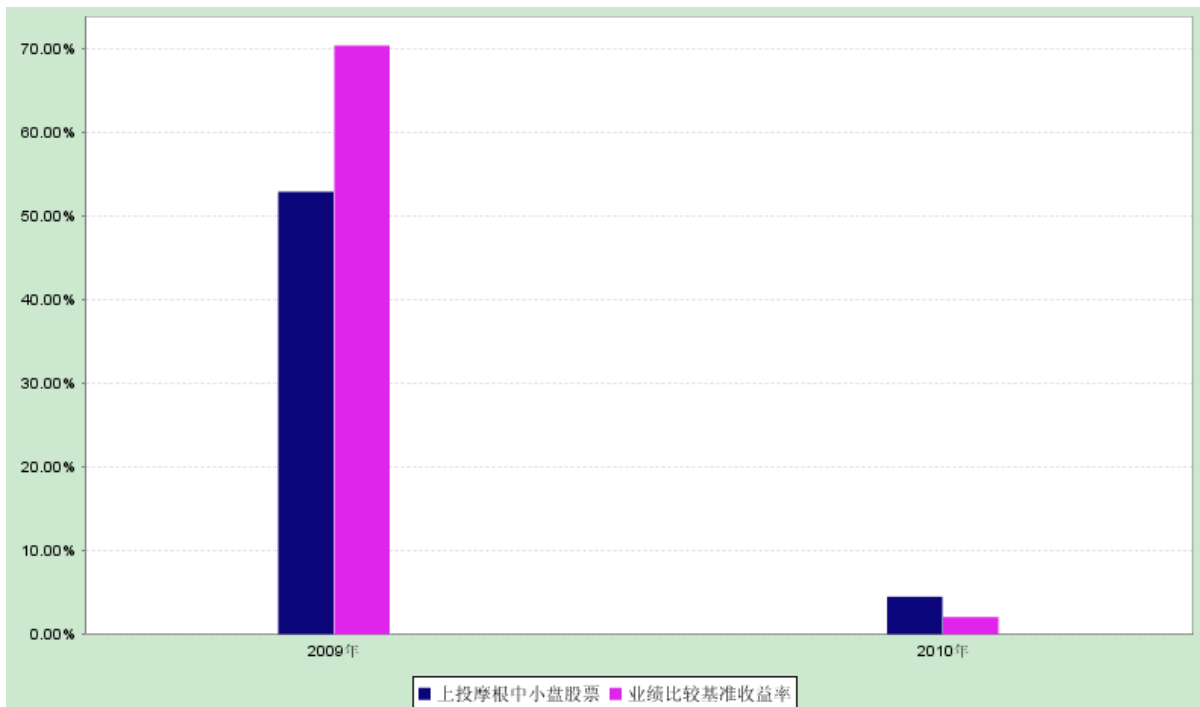
注：

1. 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。
2. 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 2010 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根中小盘股票型证券投资基金

自基金合同生效以来每年净值增长率图



注：

1. 图示 2009 年是指本基金合同生效日 2009 年 1 月 21 日至 2009 年 12 月 31 日。
2. 合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010年	0.400	17,686,340.06	18,890,238.65	36,576,578.71	-
2009年	-	-	-	-	-
合计	0.400	17,686,340.06	18,890,238.65	36,576,578.71	-

注：

根据基金实际运作情况，本基金以 2009 年 12 月 31 日为收益分配基准日，于 2010 年 2 月 11 日实施收益分配，每 10 份基金份额派发红利 0.4 元，合计发放红利 36,576,578.71 元，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007 年 10 月 8 日更名为“上海国际信托有限公司”）与摩根富林明资产管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。截至 2010 年 12 月底，公司管理的基金共有十二只，均为开放式基金，分别是：上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根阿尔法股票型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋股票型证券投资基金、上投摩根内需动力股票型证券投资基金、上投摩根亚太优势股票型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘股票型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金和上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	-	8年以上	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，曾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月进入上投摩根基金管理有限公司。
王振州	本基金基金经理	2009-1-21	-	9年以上	中原大学电子电机学士，企业管理硕士；2002年3月至2004年5月任宝来证券国际金融集团高级研究员；2004年5月至2007年1月，任职于日盛证券投资信托股份有限公司，担任日盛美亚高科技基金及日盛小而美基金基金经理；2007年1月至2007年9月任元大证券投资信托股份有限公司元大双盈基金基金经理。2007年9月加入上投摩根基金管理有限公司。2007年11月至2008年11月任上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金经理，自2008年11月起任上投摩根中国优势股票型证券投资基金基金经理，自2009年10月起同时担任上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金经理。

注：

1. 董红波先生和王振州先生为本基金首任基金经理，其任职日期均指本基金基金合同生效之日。
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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金参与“亚厦股份”网下申购，由于基金管理人内部沟通不足，实际申报股数大于拟申报股数，造成基金申购资金不足，未能足额缴款，导致本次申购无效。事件发生后，托管行及时对基金管理人进行了提示。基金管理人迅速采取措施，以自有资金全额弥补了相关利息和费用，确保基金财产不因本事件受到损失。

本事件的发生反映基金管理人的内部新股申购流程还存在一定疏漏，基金管理人已认真查找分析原因，落实整改措施，避免将来再发生类似事件。上述事项已向监管部门进行专项汇报。

除上述事件外，本报告期内，基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，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。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：本基金曾出现几次由于市场原因造成基金个股投资比例被动上升并高于相关规定的情形，但已在规定时间内调整完毕。

#### **4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明**

##### **4.3.1 公平交易制度的执行情况**

报告期内，本基金管理人建立了完善的公平交易制度。确保不同基金在买卖同一证券时，按照时间优先，比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。交易系统中缺省使用公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行委托。

##### **4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较**

为更好的贯彻落实公平交易制度指导意见的相关精神，公司于 2009 年委托外部专业机构共同制定了公司投资组合投资风格分类办法，并自 2009 年起对旗下管理的投资组合投资风格的划分情况进行定期审阅。本年度，公司根据上述分类办法组织相关业务部门及外部专业机构共同开展投资组合投资风格的划分工作，并将分类结果作为本年度投资组合定期报告中相关披露内容的依据。

本年度，根据公司内部和外部专业机构的评价结果，本基金管理人旗下无与本基金投资风格相似的其他投资组合。

##### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

报告期内，本基金无异常交易行为。

#### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

##### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2010 年证券市场呈现大幅波动走势，各个行业的表现分化严重，结构性机会演绎到了极致。政府对房地产等行业的调控，流动性紧缩政策以及通过对新兴产业的扶持而实现结构转型的发展战略对证券市场的走势产生了较大影响。本基金 2010 年整体以新兴产业以及消费行业为重点配置方向，深入研究，积极把握相关投资机会，全年基金收益率跑赢了业绩基准。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2010 年 12 月 31 日，上投摩根中小盘股票型证券投资基金份额净值为 1.553 元，本报告期份额净值增长率为 4.56%，同期业绩比较基准收益率为 2.13%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

展望 2011 年，CPI 以及流动性政策的变化方向是我们关注的重点，在投资方面我们会采取适度均衡的策略，保持基金收益和风险控制的均衡，努力实现基金业绩的稳定增值。在投资方向上，我们会对符合政策扶持方向的板块、消费行业以及受益于全球经济复苏的行业保持更高的关注。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

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整个流程进行风险控制，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 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据基金实际运作情况，本基金以 2009 年 12 月 31 日为收益分配基准日，于 2010 年 2 月 11 日实施收益分配，每 10 份基金份额派发红利 0.4 元，合计发放红利 36,576,578.71 元，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

### **§ 5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，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，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定，且发现本基金无效申购“亚厦股份”并及时通知了基金管理人，基金管理人对该行为给基金资产造成的损失进行了补偿，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 36,576,578.71 元。

#### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、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指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。



## § 6 审计报告

上投摩根中小盘股票型证券投资基金 2010 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所审计、注册会计师陈宇、张振波签字出具了“无保留意见的审计报告”（编号：普华永道中天审字(2011)第 20630 号）。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：上投摩根中小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款		82,610,711.43	85,786,895.03
结算备付金		7,380,625.58	4,400,167.29
存出保证金		1,457,869.46	2,453,140.73
交易性金融资产		1,299,203,489.50	1,413,184,426.45
其中：股票投资		1,299,203,489.50	1,383,694,426.45
基金投资		-	-
债券投资		-	29,490,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		7,932,892.35	2,255,455.72
应收利息		25,188.30	230,644.57
应收股利		-	-
应收申购款		1,314,170.88	1,013,816.81
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,399,924,947.50</b>	<b>1,509,324,546.60</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2010年12月31日</b>	<b>上年度末 2009年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,547,480.71	12,337,847.66
应付赎回款		843,413.62	9,427,938.96
应付管理人报酬		1,918,214.62	1,921,811.46
应付托管费		319,702.45	320,301.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3,219,500.05	2,693,319.62
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		652,625.76	595,531.99
<b>负债合计</b>		<b>8,500,937.21</b>	<b>27,296,751.57</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		895,728,944.53	968,883,824.64
未分配利润		495,695,065.76	513,143,970.39
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,391,424,010.29</b>	<b>1,482,027,795.03</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,399,924,947.50</b>	<b>1,509,324,546.60</b>

注：

1. 报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.553 元，基金份额总额 895,728,944.53 份。
2. 比较财务报表的实际编制期间为 2009 年 1 月 21 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：上投摩根中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月21日(基金合同生效日)至2009年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>100,873,145.19</b>	<b>425,481,426.62</b>
1. 利息收入		1,834,435.61	1,528,437.12
其中：存款利息收入		1,517,018.48	1,327,806.33
债券利息收入		317,417.13	200,630.79
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. 投资收益(损失以“-”填列)		159,636,300.99	276,457,654.68
其中：股票投资收益		153,297,691.80	270,566,743.02

基金投资收益		-	-
债券投资收益		547,162.44	593,908.20
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		5,791,446.75	5,297,003.46
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-61,606,517.56	145,018,293.24
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		1,008,926.15	2,477,041.58
<b>减：二、费用</b>		<b>43,924,106.98</b>	<b>41,761,427.19</b>
1.管理人报酬		20,269,254.51	17,493,616.43
2.托管费		3,378,209.17	2,915,602.69
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		19,830,604.89	21,007,473.28
5.利息支出		6,930.13	-
其中：卖出回购金融资产支出		6,930.13	-
6.其他费用		439,108.28	344,734.79
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>56,949,038.21</b>	<b>383,719,999.43</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>56,949,038.21</b>	<b>383,719,999.43</b>

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：上投摩根中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	968,883,824.64	513,143,970.39	1,482,027,795.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	56,949,038.21	56,949,038.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-73,154,880.11	-37,821,364.13	-110,976,244.24
其中：1.基金申购款	545,185,232.87	246,144,097.30	791,329,330.17
2.基金赎回款	-618,340,112.98	-283,965,461.43	-902,305,574.41
四、本期向基金份额持有人分配利润	-	-36,576,578.71	-36,576,578.71

产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	895,728,944.53	495,695,065.76	1,391,424,010.29
项目	上年度可比期间 2009年1月21日(基金合同生效日)至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	826,057,598.05	-	826,057,598.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	383,719,999.43	383,719,999.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	142,826,226.59	129,423,970.96	272,250,197.55
其中：1.基金申购款	1,592,960,823.11	647,664,404.14	2,240,625,227.25
2.基金赎回款	-1,450,134,596.52	-518,240,433.18	-1,968,375,029.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	968,883,824.64	513,143,970.39	1,482,027,795.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：章硕麟

主管会计工作负责人：胡志强

会计机构负责人：罗嘉

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

上投摩根中小盘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”)证监许可[2008]1316号《关于核准上投摩根中小盘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依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集期间为2008年12月22日至2009年1月16日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集825,940,005.46元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第015号验资报告予以验证。经向中国证监会备案《上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金合同》于2009年1月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为826,057,598.05份基金份额,其中认购资金利息折合117,592.59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《上投摩根中小盘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国内依法发行上市的 A 股、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金投资组合中股票投资的比例范围为基金资产的 60%-95%，债券、权证、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 5%-40%，并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金将不低于 80%的股票资产投资于中小盘股票。本基金的业绩比较基准为：天相中盘指数收益率 X 40% + 天相小盘指数收益率 X 40% + 上证国债指数收益率 X 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于 2011 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 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、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 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 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、

红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上投摩根基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司(“上国投”)	基金管理人的股东
摩根富林明资产管理(英国)有限公司	基金管理人的股东
上海国利货币经纪有限公司	基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司
香港沪光国际投资管理有限公司	基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司
J.P. Morgan Investment Management Limited	基金管理人的股东摩根富林明资产管理(英国)有限公司控制的公司
J.P. Morgan 8CS Investments (GP) Limited	基金管理人的股东摩根富林明资产管理(英国)有限公司控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月21日(基金合同生效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,269,254.51	17,493,616.43
其中：支付销售机构的客户维护费	2,367,778.39	1,997,285.94

注：支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

###### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月21日（基金合同生效日）至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,378,209.17	2,915,602.69

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月21日（基金合同生效日）至2009年12月31日
基金合同生效日(2009年1月21日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	7,799,531.98
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	7,799,531.98
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

##### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月21日（基金合同生效日）至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国建设银行	82,610,711.43	1,432,583.85	85,786,895.03	1,246,666.65
--------	---------------	--------------	---------------	--------------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

### 7.4.9 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600963	岳阳纸业	10/12/28	11/01/06	配股未流通	7.70	10.09	1,634,878	12,588,560.60	16,495,919.02	-
合计								12,588,560.60	16,495,919.02	

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600518	康美药业	10/12/28	筹划配股事宜	19.71	11/01/06	17.29	2,681,010	33,555,238.27	52,842,707.10	
600315	上海家化	10/12/06	筹划国资改革事宜	36.37	未知	未知	5,437	128,847.31	197,743.69	
合计								33,684,085.58	53,040,450.79	

注：本基金截至2010年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。



#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

###### (b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,246,163,038.71 元，属于第二层级的余额为 53,040,450.79 元，无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：第一层级 1,346,314,404.36 元，第二层级 66,870,022.09 元，无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009 年度：同)。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,299,203,489.50	92.81
	其中：股票	1,299,203,489.50	92.81
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	89,991,337.01	6.43
6	其他各项资产	10,730,120.99	0.77
7	合计	1,399,924,947.50	100.00

注：截至 2010 年 12 月 31 日，上投摩根中小盘股票型证券投资基金资产净值为 1,391,424,010.29 元，基金份额净值为 1.553 元，累计基金份额净值为 1.593 元。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	26,319,376.95	1.89
B	采掘业	222,805,493.97	16.01
C	制造业	928,625,110.15	66.74
C0	食品、饮料	69,336,334.33	4.98
C1	纺织、服装、皮毛	14,385,580.56	1.03
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	107,258,189.58	7.71
C4	石油、化学、塑胶、塑料	54,596,335.62	3.92
C5	电子	133,206,487.86	9.57
C6	金属、非金属	137,144,944.10	9.86
C7	机械、设备、仪表	172,411,500.80	12.39
C8	医药、生物制品	212,348,251.90	15.26
C99	其他制造业	27,937,485.40	2.01
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	122.10	0.00
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	121,453,386.33	8.73
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,299,203,489.50	93.37

## 8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	002038	双鹭药业	2,290,270	135,125,930.00	9.71
2	600963	岳阳纸业	7,684,442	77,536,019.78	5.57
3	002013	中航精机	2,179,821	70,931,375.34	5.10
4	000630	铜陵有色	1,569,770	55,020,438.50	3.95
5	600518	康美药业	2,681,010	52,842,707.10	3.80
6	000937	冀中能源	1,219,651	48,847,022.55	3.51
7	002155	辰州矿业	1,199,457	43,084,495.44	3.10
8	600537	海通集团	1,032,211	41,474,237.98	2.98
9	000933	神火股份	1,529,828	38,322,191.40	2.75
10	600198	大唐电信	1,634,733	32,089,808.79	2.31

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于<http://www.51fund.com> 网站的年度报告正文。

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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

金额单位：人民币元

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	002038	双鹭药业	150,301,629.90	10.14
2	600266	北京城建	146,868,769.84	9.91
3	600963	岳阳纸业	137,469,356.39	9.28
4	600519	贵州茅台	135,750,776.12	9.16
5	600900	长江电力	119,330,578.09	8.05
6	601166	兴业银行	108,381,970.12	7.31
7	600518	康美药业	94,125,545.67	6.35
8	600720	祁连山	94,034,125.26	6.34
9	600000	浦发银行	88,639,525.63	5.98
10	601111	中国国航	87,385,189.27	5.90
11	000400	许继电气	83,285,825.80	5.62
12	600537	海通集团	83,268,626.47	5.62
13	002013	中航精机	79,053,886.28	5.33
14	600037	歌华有线	76,381,568.44	5.15
15	600507	方大特钢	76,152,311.26	5.14
16	002228	合兴包装	72,468,631.80	4.89
17	600489	中金黄金	70,654,363.19	4.77
18	600545	新疆城建	66,627,827.20	4.50
19	000823	超声电子	66,603,822.03	4.49
20	600481	双良节能	65,682,999.67	4.43
21	000937	冀中能源	64,455,142.64	4.35

22	600036	招商银行	61,067,226.58	4.12
23	000055	方大集团	57,180,012.86	3.86
24	600997	开滦股份	56,541,078.16	3.82
25	600029	南方航空	56,025,401.18	3.78
26	600487	亨通光电	55,326,686.24	3.73
27	002155	辰州矿业	54,862,496.13	3.70
28	000983	西山煤电	52,491,247.24	3.54
29	600326	西藏天路	52,379,807.76	3.53
30	002106	莱宝高科	52,362,349.08	3.53
31	600115	东方航空	50,047,505.76	3.38
32	600111	包钢稀土	48,408,744.49	3.27
33	002261	拓维信息	46,677,416.98	3.15
34	600585	海螺水泥	46,070,679.98	3.11
35	000960	锡业股份	45,346,636.89	3.06
36	600117	西宁特钢	45,262,644.77	3.05
37	601688	华泰证券	45,150,971.64	3.05
38	000933	神火股份	45,004,771.31	3.04
39	000630	铜陵有色	44,380,908.79	2.99
40	000063	中兴通讯	43,808,601.64	2.96
41	600198	大唐电信	43,508,071.58	2.94
42	000876	新希望	43,208,613.10	2.92
43	600499	科达机电	42,793,783.47	2.89
44	600837	海通证券	42,731,942.08	2.88
45	600406	国电南瑞	42,301,370.00	2.85
46	600425	青松建化	41,891,209.88	2.83
47	601318	中国平安	40,719,085.16	2.75
48	000783	长江证券	40,654,659.73	2.74
49	600031	三一重工	40,042,377.83	2.70
50	600335	鼎盛天工	39,224,380.89	2.65
51	600875	东方电气	38,658,690.41	2.61
52	601168	西部矿业	37,323,648.23	2.52
53	600354	敦煌种业	37,143,989.79	2.51
54	600048	保利地产	36,195,642.63	2.44
55	600096	云天化	35,210,711.70	2.38
56	600863	内蒙华电	35,193,715.80	2.37
57	600644	乐山电力	34,772,952.94	2.35
58	601169	北京银行	34,177,437.38	2.31
59	601766	中国南车	33,938,430.99	2.29
60	600223	鲁商置业	33,598,516.56	2.27
61	600893	航空动力	32,134,786.21	2.17
62	600183	生益科技	31,820,190.07	2.15

63	002063	远光软件	31,191,990.16	2.10
64	002236	大华股份	30,882,416.24	2.08
65	600050	中国联通	30,858,000.80	2.08
66	600030	中信证券	30,452,829.00	2.05
67	000559	万向钱潮	30,283,979.21	2.04
68	000581	威孚高科	30,261,160.24	2.04
69	600106	重庆路桥	30,164,470.96	2.04
70	002289	宇顺电子	29,832,429.80	2.01

注：

1.“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。

2.600335于2011年2月23日开始实施退市风险警示特别处理,公司股票简称由“鼎盛天工”改为“\*ST盛工”。

#### 8.4.2 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

金额单位：人民币元

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	601166	兴业银行	193,869,592.93	13.08
2	600266	北京城建	145,334,903.77	9.81
3	600519	贵州茅台	136,825,642.23	9.23
4	600900	长江电力	120,024,776.82	8.10
5	600537	海通集团	115,746,337.82	7.81
6	600518	康美药业	112,808,110.38	7.61
7	002038	双鹭药业	108,113,233.86	7.29
8	600315	上海家化	93,850,838.36	6.33
9	601169	北京银行	92,478,929.26	6.24
10	600000	浦发银行	82,865,463.65	5.59
11	601111	中国国航	79,978,398.91	5.40
12	000759	武汉中百	74,579,978.05	5.03
13	000400	许继电气	73,000,824.03	4.93
14	600031	三一重工	71,600,995.18	4.83
15	600037	歌华有线	67,960,562.34	4.59
16	000937	冀中能源	67,495,472.19	4.55
17	600545	新疆城建	66,944,181.36	4.52
18	600720	祁连山	66,740,295.47	4.50
19	600837	海通证券	65,337,146.11	4.41
20	600029	南方航空	64,555,132.57	4.36
21	002228	合兴包装	63,706,856.73	4.30
22	600507	方大特钢	62,264,059.91	4.20
23	600354	敦煌种业	59,154,947.47	3.99
24	002063	远光软件	59,029,322.75	3.98

25	600036	招商银行	56,932,459.69	3.84
26	600223	鲁商置业	55,436,103.97	3.74
27	600481	双良节能	55,265,206.86	3.73
28	600111	包钢稀土	54,824,179.07	3.70
29	000983	西山煤电	52,963,565.04	3.57
30	600487	亨通光电	52,512,705.89	3.54
31	000858	五粮液	51,054,531.63	3.44
32	000800	一汽轿车	50,959,486.79	3.44
33	600581	八一钢铁	50,722,225.66	3.42
34	000581	威孚高科	50,501,359.96	3.41
35	000568	泸州老窖	49,183,227.44	3.32
36	600963	岳阳纸业	49,022,684.44	3.31
37	600326	西藏天路	47,998,659.55	3.24
38	000055	方大集团	47,147,335.42	3.18
39	000651	格力电器	47,138,401.00	3.18
40	600585	海螺水泥	46,455,653.06	3.13
41	000918	嘉凯城	45,325,659.48	3.06
42	002261	拓维信息	45,213,695.07	3.05
43	600489	中金黄金	44,377,592.15	2.99
44	600115	东方航空	43,816,060.61	2.96
45	000063	中兴通讯	43,331,767.94	2.92
46	000584	友利控股	43,118,283.11	2.91
47	601688	华泰证券	42,925,626.19	2.90
48	600875	东方电气	42,711,144.14	2.88
49	000623	吉林敖东	42,629,857.34	2.88
50	601318	中国平安	42,441,080.79	2.86
51	600406	国电南瑞	42,298,844.29	2.85
52	600335	鼎盛天工	41,704,018.66	2.81
53	600644	乐山电力	40,976,976.46	2.76
54	600117	西宁特钢	40,928,336.07	2.76
55	600499	科达机电	40,660,050.72	2.74
56	600231	凌钢股份	40,126,188.11	2.71
57	000823	超声电子	39,765,723.87	2.68
58	600048	保利地产	37,104,910.05	2.50
59	000960	锡业股份	36,917,908.08	2.49
60	601766	中国南车	35,803,446.79	2.42
61	600863	内蒙华电	35,695,045.90	2.41
62	600425	青松建化	35,483,772.84	2.39
63	601009	南京银行	35,418,613.21	2.39
64	000783	长江证券	35,234,075.46	2.38
65	600330	天通股份	32,891,089.23	2.22

66	002132	恒星科技	32,573,881.92	2.20
67	600178	东安动力	32,387,687.44	2.19
68	002024	苏宁电器	31,042,365.44	2.09
69	600050	中国联通	31,019,597.75	2.09
70	002310	东方园林	30,835,437.29	2.08
71	600183	生益科技	30,491,818.11	2.06
72	000527	美的电器	30,221,294.85	2.04
73	600106	重庆路桥	30,125,868.22	2.03
74	002068	黑猫股份	29,700,557.75	2.00

注：

1.“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。

2.600335于2011年2月23日开始实施退市风险警示特别处理,公司股票简称由“鼎盛天工”改为“\*ST盛工”。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本(成交)总额	6,416,277,669.32
卖出股票的收入(成交)总额	6,592,468,690.51

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

#### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.9.2

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。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,457,869.46
2	应收证券清算款	7,932,892.35
3	应收股利	-
4	应收利息	25,188.30
5	应收申购款	1,314,170.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,730,120.99

### 8.9.4 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转股期可转债。

### 8.9.5 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	600518	康美药业	52,842,707.10	3.80	筹划配股事宜
2	600963	岳阳纸业	16,495,919.02	1.19	配股未流通

注：本基金截至 2010 年 12 月 31 日止持有的因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。本基金本报告期末其他前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.9.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
50,246	17,826.87	164,645,104.21	18.38%	731,083,840.32	81.62%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本 开放式基金	378,245.22	0.0422%

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年1月21日)基金份额总额	826,057,598.05
本报告期期初基金份额总额	968,883,824.64
本报告期基金总申购份额	545,185,232.87
减：本报告期基金总赎回份额	618,340,112.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	895,728,944.53

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 基金管理人：

2010年2月3日基金管理人发布《上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，因上投摩根基金管理有限公司原总经理王鸿嫔女士任期届满，经本公司董事会审议通过，决定聘任章硕麟先生为公司总经理。王鸿嫔女士不再担任本公司总经理职务。

经本公司董事会审议通过，决定聘任董威先生为公司副总经理。

2010年6月12日基金管理人发布《上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，上投摩根基金管理有限公司副总经理刘樱女士因工作调动，已向本公司董事会提出辞职。董事会经讨论后作出决议，同意刘樱女士辞去副总经理职务。

#### 基金托管人：

本基金托管人2011年2月9日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2011〕115号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

本基金托管人2011年1月31日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。报告年度应支付给聘任普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为100,000元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为2年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人、托管人未受稽查或处罚，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
联合证券	1	5,022,465,520.31	38.72%	4,269,063.52	39.38%	-
中投证券	1	4,166,293,966.26	32.12%	3,385,147.83	31.23%	-
国信证券	1	2,982,928,428.15	23.00%	2,535,483.76	23.39%	-
平安证券	1	800,198,884.06	6.17%	650,168.65	6.00%	-

注：

1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 交易单元的选择标准：

1) 资本金雄厚,信誉良好。

2) 财务状况良好,经营行为规范。

3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。

4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

5) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 交易单元的选择程序：

1) 本基金管理人定期召开会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进行评估，确定选用交易单元的券商。

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

4. 2010年度本基金无新增席位，无注销席位。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
联合证券	3,280,581.90	100.00%	-	-	-	-

中投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下：

2010年1月29日,托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告,决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

2010年5月13日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告,范一飞先生已提出辞呈,辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010年6月21日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

2010年7月1日,托管人中国建设银行股份有限公司发布2009年度A股分红派息实施公告,每10股派发现金股息人民币2.02元(含税)。

2010年9月15日,托管人中国建设银行股份有限公司发布公告,张福荣先生担任中国建设银行股份有限公司监事长,谢渡扬先生辞去中国建设银行股份有限公司监事、监事长职务。

2010年11月2日,托管人中国建设银行股份有限公司发布2010年度A股配股发行公告。

上投摩根基金管理有限公司

二〇一一年三月二十九日