

上投摩根阿尔法股票型证券投资基金

2013 年年度报告摘要

2013 年 12 月 31 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

报告送出日期：二〇一四年三月二十八日

§ 1 重要提示

1.1 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 2014 年 3 月 27 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 2013 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	上投摩根阿尔法股票
基金主代码	377010
交易代码	377010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 10 月 11 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	1,097,898,777.88 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用哑铃式投资技术(Barbell Approach)，同步以“成长”与“价值”双重量化指标进行股票选择。在基于由下而上的择股流程中，精选个股，纪律执行，构造出相对均衡的不同风格类资产组合。同时结合公司质量、行业布局、风险因子等深入分析，对资产配置进行适度调整，努力控制投资组合的市场适应性，以求多空环境中都能创造超越业绩基准的主动管理回报。
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，依据中国资本市场的具体特征，引入集团在海外市场成功运作的“Dynamic Fund”基金产品概念。具体而言，本基金将以量化指标分析为基础，通过严格的证券选择，积极构建并持续优化“哑铃式”资产组合，结合严密的风险监控，不断谋求超越业绩比较基准的稳定回报。
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	本基金是股票型证券投资基金，属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金产品。

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	胥洪擎
	联系电话	021-38794888
	电子邮箱	services@cifm.com
客户服务电话	400-889-4888	010-67595096
传真	021-20628400	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	http://www.cifm.com
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	2013 年	2012 年	2011 年
本期已实现收益	217,170,062.41	-683,509,706.87	-704,049,636.76
本期利润	262,066,927.75	-210,388,246.60	-1,328,653,805.67
加权平均基金份额本期利润	0.2422	-0.1463	-0.9235
本期基金份额净值增长率	10.75%	-7.17%	-28.71%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	0.5903	0.4036	0.8840
期末基金资产净值	2,535,980,466.89	2,884,804,423.89	3,512,682,909.22
期末基金份额净值	2.3098	2.0856	2.2467

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，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。

3.2 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 ①	份额净值 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	0.71%	1.07%	-2.89%	0.96%	3.60%	0.11%
过去六个月	13.87%	1.13%	7.81%	1.01%	6.06%	0.12%
过去一年	10.75%	1.14%	-0.43%	1.08%	11.18%	0.06%
过去三年	-26.70%	1.18%	-20.38%	1.08%	-6.32%	0.10%
过去五年	7.98%	1.30%	35.00%	1.25%	-27.02%	0.05%
自基金合同生 效起至今	285.13%	1.49%	152.90%	1.51%	132.23%	-0.02%

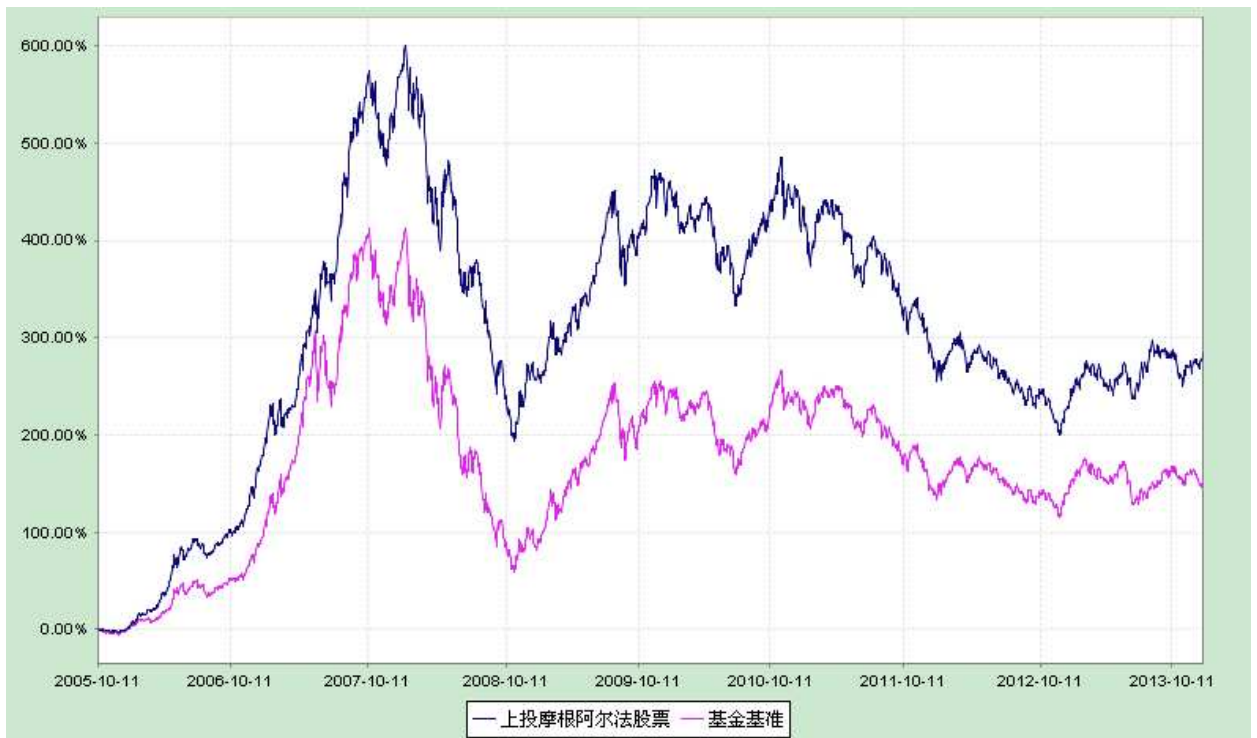
注：本基金的业绩比较基准于 2013 年 12 月 7 日由原“富时中国 A 全指数×80%+同业存款利率×20%”变更为“沪深 300 指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%”。

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

上投摩根阿尔法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

(2005 年 10 月 11 日至 2013 年 12 月 31 日)



注：1. 本基金合同生效日为 2005 年 10 月 11 日，图示时间段为 2005 年 10 月 11 日至 2013 年 12 月 31 日。

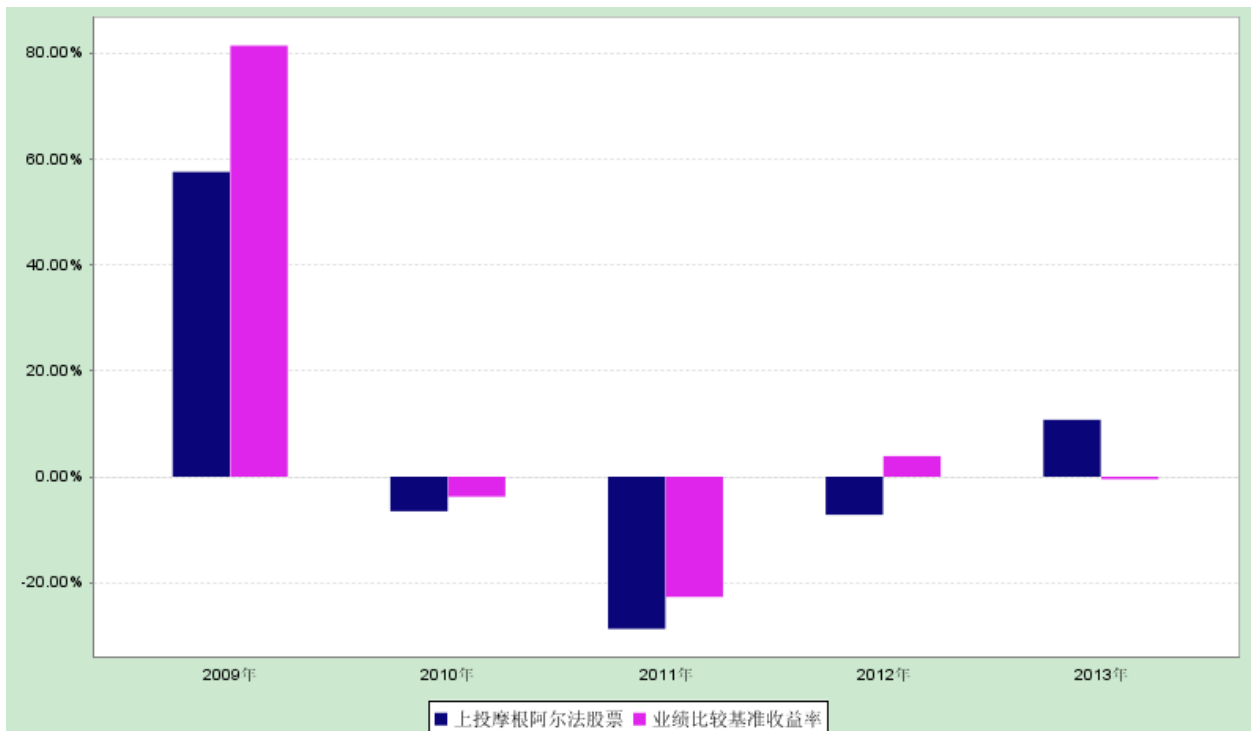
2. 本基金建仓期自 2005 年 10 月 11 日至 2006 年 4 月 10 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金的业绩比较基准于 2013 年 12 月 7 日由原“富时中国 A 全指数×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%”。

3.2.3 过去五年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

上投摩根阿尔法股票型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比如图



注:本基金的业绩比较基准于 2013 年 12 月 7 日由原“富时中国 A 全指数×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%”。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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 2013 年 12 月底,公司管理的基金共有二十九只,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、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质股票型证券投资基金、上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金、上投摩根分红添利债券型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选股票型证券投资基金、上投摩根轮动添利债券型证券投资基金、上投摩根智选 30 股票型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上证 180 高贝塔交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金、上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金、上投摩根红利回报混合型证券投资基金、上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金和上投摩根双债增利债券型证券投资基金。

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		
欧宝林	本基金基金经理	2012-11-26	2014-1-10	6 年	欧宝林先生自 2004 年 6 月至 2007 年 6 月在中德安联任研究员、科经理,从事研究方面的工作;

					2007年6月至2009年6月在国海富兰克林管理有限公司任研究员、基金经理助理；2009年7月至2012年7月在嘉实基金管理有限公司任基金经理助理、基金经理；2010年12月至2012年7月任嘉实主题新动力股票型证券投资基金基金经理；2012年7月起加入上投摩根基金管理有限公司，2012年11月起担任上投摩根阿尔法股票型证券投资基金基金经理。
刘军	本基金基金经理助理	2009-01-01	-	15年	武汉大学理学硕士，1998年至2007年先后任武汉桥建集团公司，海通证券研究所行业公司部经理、海富通基金管理有限公司股票分析师。2007年5月加入上投摩根基金管理有限公司，曾任行业专家，负责食品饮料、农业行业研究。

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。

3. 因工作需要，经上投摩根基金管理有限公司批准，决定自2014年1月3日起增聘征茂平先生为上投摩根阿尔法股票型证券投资基金的基金经理；同时，因工作需要，经上投摩根基金管理有限公司批准，欧宝林先生自2014年1月10日起不再担任上投摩根阿尔法股票型证券投资基金基金经理。

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。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根阿尔法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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求，制订了《上投摩根基金管理有限公司公平交易制度》，规范了公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动，同时涵盖了授权、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各个环节，以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

公司执行自上而下的三级授权体系，依次为投资决策委员会、投资总监、经理人，经理人在其授权范围内自主决策，投资决策委员会和投资总监均不得干预其授权范围内的投资活动。公司已建立客观的研究方法，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。对于交易所市场投资活动，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机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易室询价机制，严格防范交易对手风险并抽检价格公允性；对于一级市场申购投资行为，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。

公司制订了《异常交易监控与报告制度》，通过系统和人工相结合的方式投资交易行为的监控分析，并执行异常交易行为监控分析记录工作机制，确保公平交易可稽核。公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行上述公平交易制度和控制方法，开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的收益率差异、以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易时机和交易价差等方面的监控分析，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

其中，在同向交易的监控和分析方面，根据法规要求，公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控，通过定期抽查前述的同向交易行为，定性分析交易时机、对比不同投资组合长期的交易趋势，重点关注任何可能导致不公平交易的情形。对于识别的异常情况，由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释。同时，公司根据法规的要求，通过系统模块定期对连续四个季度内不同投资组合在不同时间窗内（日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行分析，采用概率统计方法，主要关注不同投资组合之间同向交易价差均值为零的显著性检验，以及同向交易价格占优的交易次数占比分析。

报告期内，通过前述分析方法，未发现不同投资组合之间同向交易价差异异常的情况。

4.3.3 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、交易方向等的抽样分析，公司未发现存在异常交易行为。

报告期内，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% 的情形共计发生 1 次，为指数基金在建仓期被动跟踪标的指数和其他投资组合发生的反向交易。

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

2013 年是中国证券市场走势分化比较大的一年：代表新兴产业的创业板指数全年大涨 82.7%，而传统产业权重较大的上证综指和沪深 300 分别下跌 6.75% 和 7.65%；其中行业指数的分化更加显著，传媒行业指数全年涨幅超过 100%，而传统周期性行业指数以下跌为主，煤炭板块跌幅超过 40%。究其原因，在经济转型趋势不可逆转的背景下，2013 年是中国新一届政府施政的第一年，新兴产业不仅充分受益于持续推出的各项优惠政策，而且订单需求增长带来的盈利更是超出市场预期，反之亦然。2013 年度本基金对中国经济转型的重大意义认识不够充分，组合中较多配置了前期经过调整的消费品行业，但政府政策负面影响的深度和广度均超出本基金基金经理的预期，导致投资效果受到影响。在 2014 年，本基金将力争获取好的投资收益，以回报投资者。

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 10.75%，同期业绩比较基准收益率为-0.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014 年中国经济的结构性调整特征比 2013 年将更加明显：在保持经济继续平稳运行的同时，全面深化改革不仅是经济结构调整的应有之意，更是推动体制改革、为之营造一个宽松宏观环境的迫切要求。因此尽管中国经济在 2014 年将面临许多深层次的矛盾和问题，并对经济的稳定运行造成一定的威胁，但我们对国内经济复苏充满信心：一方面结构调整的积极因素正在逐渐发挥作用，并主要体现在企业效益的改善上、经济运行的内在稳定性和持续性得到加强，另一方面全球经济复苏也为国内经济复苏提供了较好的外部环境。

在经济结构调整和经济弱复苏的背景下，预期证券市场大幅走强并不现实：流动性预期管理在很大程度上决定了市场的高度，而国内经济从需求衰退调整周期转换为供给调整周期也是一个相对漫长的过程，2014 年证券市场仍将是结构性行情和主题投资并行的格局。因此本基金 2014 年仍坚持“淡化指数、精选个股”策略，行业配置上，将重点关注受益于经济结构调整、持续成长能力突出的医药、大众消费品、电子消费、环保、高端装备等行业，在市场回调时买入行业内成长性突出、具有较强竞争优势的优质个股，优化组合结构，以获取超额收益。

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

本报告期，本基金未实施利润分配。

§ 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，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

上投摩根阿尔法股票型证券投资基金2013年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所审计、注册会计师汪棣、王灵签字出具了“无保留意见的审计报告”（编号：普华永道中天审字(2014)第20775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：上投摩根阿尔法股票型证券投资基金

报告截止日：2013年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	54,302,698.85	154,245,680.12
结算备付金		11,902,352.68	3,133,033.24
存出保证金		1,014,282.04	3,072,672.46
交易性金融资产	7.4.7.2	2,168,796,768.17	2,767,436,531.84
其中：股票投资		2,079,326,768.17	2,666,361,531.84
基金投资		-	-
债券投资		89,470,000.00	101,075,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	240,000,000.00	-
应收证券清算款		87,335,142.25	-
应收利息	7.4.7.5	1,238,357.96	383,641.28
应收股利		-	-
应收申购款		574,322.36	801,415.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,565,163,924.31	2,929,072,974.83
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2013年12月31日	2012年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		17,464,793.76	32,158,515.18
应付赎回款		3,555,441.73	2,546,636.57
应付管理人报酬		3,161,302.92	3,368,714.20
应付托管费		526,883.83	561,452.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,822,136.74	4,227,034.83
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	652,898.44	1,406,197.80
负债合计		29,183,457.42	44,268,550.94
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,097,898,777.88	1,383,215,798.63
未分配利润	7.4.7.10	1,438,081,689.01	1,501,588,625.26
所有者权益合计		2,535,980,466.89	2,884,804,423.89
负债和所有者权益总计		2,565,163,924.31	2,929,072,974.83

注：报告截止日2013年12月31日，基金份额净值2.3098元，基金份额总额1,097,898,777.88份。

7.2 利润表

会计主体：上投摩根阿尔法股票型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013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
		2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		339,493,226.56	-117,730,758.02
1. 利息收入		6,166,470.76	7,286,937.81
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,023,427.22	2,304,071.04
债券利息收入		3,285,226.94	3,165,701.26
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,857,816.60	1,817,165.51
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		287,359,772.42	-598,745,691.78
其中：股票投资收益	7.4.7.12	256,623,211.76	-629,721,174.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	238,938.38	267,934.94
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	30,497,622.28	30,707,547.46
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	44,896,865.34	473,121,460.27

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,070,118.04	606,535.68
减：二、费用		77,426,298.81	92,657,488.58
1. 管理人报酬		35,648,765.74	46,654,885.09
2. 托管费		5,941,460.83	7,775,814.17
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	35,414,735.29	37,767,462.85
5. 利息支出		-	34,038.34
其中：卖出回购金融资产支出		-	34,038.34
6. 其他费用	7.4.7.19	421,336.95	425,288.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		262,066,927.75	-210,388,246.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		262,066,927.75	-210,388,246.60

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根阿尔法股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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）	1,383,215,798.63	1,501,588,625.26	2,884,804,423.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	262,066,927.75	262,066,927.75
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）	-285,317,020.75	-325,573,864.00	-610,890,884.75
其中：1. 基金申购款	301,660,273.15	367,625,797.37	669,286,070.52
2. 基金赎回款	-586,977,293.90	-693,199,661.37	-1,280,176,955.27
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）	1,097,898,777.88	1,438,081,689.01	2,535,980,466.89
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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）	1,563,503,257.25	1,949,179,651.97	3,512,682,909.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-210,388,246.60	-210,388,246.60
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）	-180,287,458.62	-237,202,780.11	-417,490,238.73
其中：1. 基金申购款	121,458,165.79	138,051,560.46	259,509,726.25
2. 基金赎回款	-301,745,624.41	-375,254,340.57	-676,999,964.98
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）	1,383,215,798.63	1,501,588,625.26	2,884,804,423.89
-----------------	------------------	------------------	------------------

报告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：张璐

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上投摩根阿尔法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”)证监基金字[2005]第 155 号《关于同意上投摩根阿尔法股票型证券投资基金设立的批复》核准，由上投摩根富林明基金管理有限公司(后更名为“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《上投摩根阿尔法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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 767,319,308.57 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(2005)第 150 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根阿尔法股票型证券投资基金基金合同》于 2005 年 10 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 767,620,088.15 份基金份额，其中认购资金利息折合 300,779.58 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《上投摩根阿尔法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公开发行、上市的股票、债券、货币市场工具及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常情况下，本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 60% - 95%，其它为 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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 X 80% + 中债总指数收益率 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 2014 年 3 月 27 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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根阿尔法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 2013 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 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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的说明。

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**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。
- (2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (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支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
- (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(“上海信托”)	基金管理人的股东
摩根资产管理(英国)有限公司	基金管理人的股东
上信资产管理有限公司	基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司
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
J.P.MorganInvestmentManagementLimited	基金管理人的股东摩根资产管理(英

	国)有限公司控制的公司
J.P.Morgan&CInvestments(GP)Limited	基金管理人的股东摩根资产管理(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	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	35,648,765.74	46,654,885.09
其中：支付销售机构的客户维护费	3,614,859.34	3,847,895.10

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 X 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	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,941,460.83	7,775,814.17

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 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

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		上年度可比期间	
	2013年1月1日至2013年12月31日		2012年1月1日至2012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	54,302,698.85	829,328.36	154,245,680.12	2,145,945.70

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（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于2013年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为2,079,326,768.17元，属于第二层级的余额为89,470,000.00元，无属于第三层级的余额(2012年12月31日：第一层级2,644,940,531.84元，第二层级122,496,000.00元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。(于2012年12月31日，本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具。2012年度：本基金净转入/(转出)第三层级的金额为零元，计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元。)

(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	2,079,326,768.17	81.06
	其中：股票	2,079,326,768.17	81.06
2	固定收益投资	89,470,000.00	3.49
	其中：债券	89,470,000.00	3.49
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	240,000,000.00	9.36
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	66,205,051.53	2.58
8	其他各项资产	90,162,104.61	3.51
9	合计	2,565,163,924.31	100.00

注：截至2013年12月31日，上投摩根阿尔法股票型证券投资基金资产净值为2,535,980,466.89元，基金份额净值为2.3098元，累计基金份额净值为4.2298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	-	-
B	采矿业	69,833,317.12	2.75
C	制造业	1,237,216,229.18	48.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,509,964.98	0.77
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	439,055,149.76	17.31
G	交通运输、仓储和邮政业	29,215,686.60	1.15
H	住宿和餐饮业	14,246,713.52	0.56
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,252,234.00	1.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	67,695,440.92	2.67
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	177,302,032.09	6.99
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	2,079,326,768.17	81.99

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	600079	人福医药	7,566,752	214,517,419.20	8.46
2	600276	恒瑞医药	3,576,794	135,846,636.12	5.36
3	002646	青青稞酒	6,564,991	131,299,820.00	5.18
4	600511	国药股份	4,793,128	90,446,325.36	3.57
5	000893	东凌粮油	4,931,445	85,412,627.40	3.37
6	002262	恩华药业	2,984,226	84,065,646.42	3.31
7	002390	信邦制药	2,798,412	77,208,187.08	3.04
8	000516	开元投资	13,034,127	77,031,690.57	3.04
9	002159	三特索道	4,433,403	71,688,126.51	2.83
10	600028	中国石化	15,587,794	69,833,317.12	2.75

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.cifm.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	600276	恒瑞医药	451,934,167.18	15.67
2	600079	人福医药	368,380,488.92	12.77
3	600519	贵州茅台	360,746,356.78	12.51
4	600809	山西汾酒	335,541,897.94	11.63
5	601788	光大证券	273,446,884.81	9.48

6	000568	泸州老窖	272,708,940.60	9.45
7	600028	中国石化	243,369,812.67	8.44
8	600887	伊利股份	237,707,078.78	8.24
9	600705	中航投资	228,546,293.91	7.92
10	000858	五粮液	227,188,991.00	7.88
11	000800	一汽轿车	224,880,532.38	7.80
12	600199	金种子酒	196,536,286.58	6.81
13	601377	兴业证券	181,249,081.19	6.28
14	600702	沱牌舍得	177,567,656.46	6.16
15	000028	国药一致	171,213,922.94	5.94
16	600500	中化国际	148,477,891.57	5.15
17	002646	青青稞酒	139,958,327.18	4.85
18	000792	盐湖股份	120,153,442.48	4.17
19	000063	中兴通讯	118,721,513.21	4.12
20	002570	贝因美	116,082,624.14	4.02
21	601888	中国国旅	107,473,185.86	3.73
22	300016	北陆药业	96,485,738.76	3.34
23	000933	神火股份	95,936,640.99	3.33
24	002262	恩华药业	95,500,855.67	3.31
25	600403	大有能源	95,434,991.77	3.31
26	000516	开元投资	94,719,021.98	3.28
27	600837	海通证券	93,383,014.00	3.24
28	002092	中泰化学	92,940,902.92	3.22
29	600221	海南航空	87,599,052.90	3.04
30	000893	东凌粮油	86,895,932.79	3.01
31	600616	金枫酒业	84,113,543.99	2.92
32	002345	潮宏基	78,956,814.62	2.74
33	600197	伊力特	78,871,410.46	2.73
34	600195	中牧股份	78,071,526.08	2.71
35	000888	峨眉山 A	76,213,262.53	2.64
36	600729	重庆百货	75,624,332.45	2.62
37	000799	酒鬼酒	74,091,578.38	2.57
38	600482	风帆股份	73,382,386.76	2.54
39	600873	梅花集团	73,126,499.24	2.53
40	002159	三特索道	73,047,534.52	2.53
41	300006	莱美药业	72,237,248.80	2.50
42	002251	步步高	71,731,284.17	2.49
43	600566	洪城股份	69,596,063.67	2.41
44	600138	中青旅	69,458,237.10	2.41
45	000729	燕京啤酒	68,882,297.94	2.39
46	002311	海大集团	67,962,616.79	2.36

47	600779	水井坊	67,048,566.87	2.32
48	300181	佐力药业	66,670,886.27	2.31
49	000537	广宇发展	66,505,739.61	2.31
50	002390	信邦制药	66,207,009.94	2.30
51	000043	中航地产	63,154,068.79	2.19
52	002304	洋河股份	62,378,402.95	2.16
53	600029	南方航空	61,966,942.94	2.15
54	000860	顺鑫农业	59,798,121.57	2.07
55	300113	顺网科技	58,517,862.85	2.03
56	600030	中信证券	58,377,056.86	2.02

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。

8.4.2 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	600519	贵州茅台	499,976,524.03	17.33
2	600276	恒瑞医药	462,645,683.37	16.04
3	601788	光大证券	447,993,527.73	15.53
4	000568	泸州老窖	414,808,331.00	14.38
5	000028	国药一致	331,403,439.87	11.49
6	600079	人福医药	315,675,269.77	10.94
7	600028	中国石化	313,436,050.45	10.87
8	000858	五粮液	291,043,276.83	10.09
9	600809	山西汾酒	290,762,781.03	10.08
10	600887	伊利股份	260,198,132.52	9.02
11	600705	中航投资	248,716,855.69	8.62
12	000800	一汽轿车	238,198,197.21	8.26
13	600029	南方航空	194,860,195.46	6.75
14	601377	兴业证券	181,370,997.64	6.29
15	600199	金种子酒	167,592,332.86	5.81
16	600500	中化国际	159,333,830.93	5.52
17	600511	国药股份	150,555,151.99	5.22
18	601111	中国国航	133,481,337.85	4.63
19	002570	贝因美	129,838,811.73	4.50
20	002412	汉森制药	124,447,499.81	4.31
21	600115	东方航空	123,805,960.65	4.29
22	002179	中航光电	120,518,589.61	4.18
23	000792	盐湖股份	120,020,258.36	4.16

24	600221	海南航空	118,609,253.29	4.11
25	000063	中兴通讯	113,635,156.03	3.94
26	601888	中国国旅	107,781,320.49	3.74
27	600195	中牧股份	107,779,982.06	3.74
28	300016	北陆药业	107,364,782.69	3.72
29	600702	沱牌舍得	107,047,841.08	3.71
30	600596	新安股份	99,512,119.83	3.45
31	600837	海通证券	99,466,998.12	3.45
32	300006	莱美药业	92,432,857.59	3.20
33	600351	亚宝药业	92,403,726.28	3.20
34	600403	大有能源	92,294,224.06	3.20
35	000933	神火股份	91,694,206.41	3.18
36	600030	中信证券	91,472,194.38	3.17
37	002092	中泰化学	87,787,961.40	3.04
38	600529	山东药玻	87,404,001.92	3.03
39	600873	梅花集团	78,672,166.20	2.73
40	600482	风帆股份	76,863,316.44	2.66
41	600197	伊力特	76,786,892.52	2.66
42	000537	广宇发展	74,269,687.85	2.57
43	300113	顺网科技	73,163,571.72	2.54
44	000729	燕京啤酒	69,791,275.45	2.42
45	000043	中航地产	65,658,000.15	2.28
46	002311	海大集团	64,778,274.50	2.25
47	600859	王府井	64,350,118.81	2.23
48	600729	重庆百货	62,153,591.35	2.15
49	000877	天山股份	61,281,395.22	2.12
50	000799	酒鬼酒	60,568,013.54	2.10
51	002501	利源精制	60,348,042.36	2.09
52	300181	佐力药业	60,130,130.57	2.08
53	600009	上海机场	59,421,979.57	2.06
54	002304	洋河股份	58,595,221.44	2.03

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。

8.4.3 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	11,037,567,142.15
卖出股票的收入（成交）总额	11,925,988,122.92

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	89,470,000.00	3.53
	其中：政策性金融债	89,470,000.00	3.53
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	89,470,000.00	3.53

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	130243	13 国开 43	300,000	29,790,000.00	1.17
2	130248	13 国开 48	200,000	19,966,000.00	0.79
3	110234	11 国开 34	200,000	19,878,000.00	0.78
4	130227	13 国开 27	200,000	19,836,000.00	0.78

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 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 1.本基金投资的贵州信邦制药股份有限公司（下称：信邦制药，股票代码：002390）于2013年6月3日收到深圳证券交易所《关于对贵州信邦制药股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》（下称：《决定》），《决定》指出：2013年1月6日，信邦制药根据国家药监局新药审评技术要求和新出台的政策，通过贵州省药监局向国家药品审评中心请求撤回人参皂苷-Rd注射液的新药生产注册申请，公司对该重大进展情况，未及时履行信息披露，直至2013年1月30日国家药品审评中心在其网站公布相关信息后才进行披露。鉴于上述违规事实，依据有关规定，决定对信邦制药及相关当事人给予通报批评的处分，并记入上市公司诚信档案，并向社会公布。

对上述股票投资决策程序的说明：本基金管理人在投资信邦制药前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库，由研究员跟踪并分析。上述事件发生后，本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分

析，认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，因此，没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

2.本基金投资的中国石油化工股份有限公司（下称：中国石化，股票代码：600028）于2013年11月24日发布公告：2013年11月22日凌晨，中国石化位于青岛经济技术开发区的原油管道发生破裂，导致原油泄漏，部分原油漏入市政排水暗渠，流入海岔。当日上午10点30分左右，市政排水暗渠发生爆燃，导致周边行人、抢险人员伤亡的重大事故。关于此次事故发生的原因以及有关事宜，中国政府已派出事故调查组进行全面调查。中国石化于2014年1月12日就前述事件再次发布公告：国务院对山东省青岛市“11•22”中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告作出批复，同意国务院事故调查组的调查处理结果，认定是一起特别重大责任事故；同意对事故有关责任单位和责任人的处理建议，对中国石化及当地政府的48名责任人分别给予纪律处分，对涉嫌犯

罪的15名责任人移送司法机关依法追究法律责任。

对上述股票投资决策程序的说明：本基金管理人在投资中国石化前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库，由研究员跟踪并分析。上述事件发生后，本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分
析，认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，因此，没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

其余八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。

8.12.2 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。

8.12.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,014,282.04
2	应收证券清算款	87,335,142.25
3	应收股利	-
4	应收利息	1,238,357.96
5	应收申购款	574,322.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	90,162,104.61

8.12.4 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。

8.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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
99,751	11,006.39	258,137,806.55	23.51%	839,760,971.33	76.49%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	35,224.41	0.0032%

注：期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0至10万份（含），该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为0。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2005年10月11日)基金份额总额	767,620,088.15
本报告期期初基金份额总额	1,383,215,798.63
本报告期基金总申购份额	301,660,273.15
减：本报告期基金总赎回份额	586,977,293.90
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,097,898,777.88

§ 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：

2013 年 2 月 8 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》，经上投摩根基金管理有限公司董事会审议通过，决定聘任陈星德先生为公司副总经理且陈星德先生不再担任公司督察长一职、聘任刘万方先生为公司督察长。

2013 年 4 月 19 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》，经上投摩根基金管理有限公司董事会审议通过，决定聘任张军先生为公司副总经理。

基金托管人：

本基金托管人 2013 年 12 月 5 日发布任免通知，聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

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 9 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	佣金	占当期佣金总量的	

			交总额 的比例		比例	
中信证券	1	6,798,590,126.36	29.61%	6,131,723.93	29.44%	-
中信建投	1	4,071,815,071.32	17.73%	3,706,978.61	17.80%	-
申银万国	1	3,817,399,989.51	16.62%	3,475,356.95	16.69%	-
国泰君安	1	3,662,868,619.33	15.95%	3,334,664.71	16.01%	-
广发证券	1	1,615,768,555.10	7.04%	1,459,111.69	7.01%	-
国信证券	1	1,561,018,650.78	6.80%	1,412,274.43	6.78%	-
光大证券	1	1,380,490,489.07	6.01%	1,256,793.62	6.03%	-
华泰证券	1	55,603,763.60	0.24%	50,621.99	0.24%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-

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。

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. 2013 年度本基金新增席位(广发证券)，注销席位（凯基证券，天相，中信证券）。

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	成交金额	占当期	成交金额	占当期

		债券成交总额的比例		回购成交总额的比例		权证成交总额的比例
中信证券	1,404,209.06	100.00%	-	-	-	-
中信建投	-	-	1,795,000,000.00	62.66%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	1,069,800,000.00	37.34%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

§ 12影响投资者决策的其他重要信息

无。

上投摩根基金管理有限公司

二〇一四年三月二十八日