

上投摩根中国优势证券投资基金 2006年第三季度报告

2006年第3号

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

重要提示:基金管理人、董事及高级管理人员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,并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金投资目标:本基金投资于具有良好成长性的股票、债券、货币市场工具等,在有效控制风险和保持较高流动性的前提下,追求基金资产的长期增值。

基金投资策略:本基金在有效控制风险和保持较高流动性的前提下,追求基金资产的长期增值。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。

基金业绩比较基准:本基金业绩比较基准为:新华富时中国A600指数收益率*70%+新华富时中国A600指数收益率*25%+上证国债指数收益率*5%。

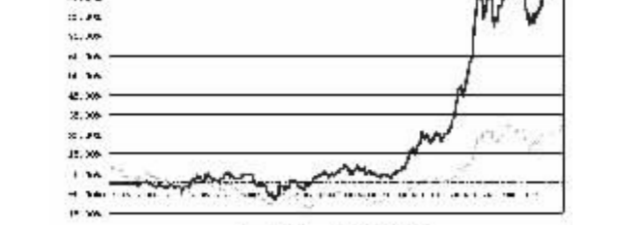
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司 基金托管人:中国建设银行股份有限公司

Table with 2 columns: 主要财务指标, 单位:人民币元. Rows include 基金本期净收益, 基金份额本期净收益, etc.

Table with 2 columns: 业绩比较基准, 单位:人民币元. Rows include 基金本期净收益, 基金份额本期净收益, etc.

提示: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。

2、上投摩根中国优势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



图一:上投摩根中国优势基金成立以来净值增长率与业绩比较基准收益率对比图

(一)基金经理介绍:基金经理吕刚,1973年出生,硕士学位,曾服务于国泰基金管理有限公司,现任上投摩根基金管理有限公司基金经理。

(二)基金运作合规性说明: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,基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规。

(三)基金投资策略:上半年行情波动较大,市场发生了一些局部性变化,由于宏观经济的部分指标持续“过热”和民众对于房价上升的不满,政府陆续出台了一些宏观调控措施。

Table with 2 columns: 资产项目, 金额(元), 占基金总资产的比例. Rows include 股票, 债券, 权证, etc.

Table with 2 columns: 报告期末按行业分类的股票投资组合, 市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 农林牧渔, 化工, etc.

截至2006年9月30日,上投摩根中国优势证券投资基金资产净值为2,834,027,213.62元,基金份额净值为2.0206元,累计基金份额净值为2,121.18元。

3、C制造业 1,442,559,099.20 50.9%

Table with 2 columns: 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 000001, 000002, etc.

(三)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 1, 000001, etc.

(四)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

Table with 2 columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 1, 国债, etc.

(五)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

Table with 2 columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 1, 06央行01, etc.

(六)基金投资资产支持证券及报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持

证券明细:无

(七)投资组合报告附注: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。

Table with 2 columns: 序号, 其他资产项目, 金额(元). Rows include 1, 交易保证金, etc.

4、截至2006年9月30日,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细如下:

Table with 2 columns: 权证代码, 权证名称, 权证数量(份), 权证成本(人民币元). Rows include 580007, 580097, etc.

5、截至2006年9月30日,本基金持有的权证明细如下:

Table with 2 columns: 权证代码, 权证名称, 权证数量(份), 权证成本(人民币元). Rows include 580007, 580097, etc.

七、备查文件目录:1、中国证监会批准《上投摩根中国优势证券投资基金》设立的文件;

2、《上投摩根中国优势证券投资基金基金合同》;

3、《上投摩根中国优势证券投资基金托管协议》;

4、《上投摩根中国优势证券投资基金业务规则》;

上投摩根双息平衡混合型证券投资基金 2006年第三季度报告

2006年第2号

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

重要提示:基金管理人、董事及高级管理人员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,并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金投资目标:本基金投资于具有良好成长性的股票、债券、货币市场工具等,在有效控制风险和保持较高流动性的前提下,追求基金资产的长期增值。

基金投资策略:本基金在有效控制风险和保持较高流动性的前提下,追求基金资产的长期增值。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。

基金业绩比较基准:本基金业绩比较基准为:新华富时150红利指数收益率*45%+新华富时中国国债指数收益率*45%+国债收益率*10%。

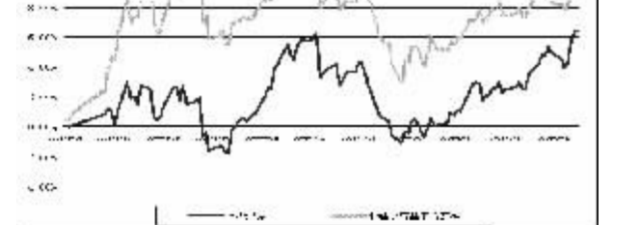
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司 基金托管人:中国建设银行股份有限公司

Table with 2 columns: 主要财务指标, 单位:人民币元. Rows include 基金本期净收益, 基金份额本期净收益, etc.

Table with 2 columns: 业绩比较基准, 单位:人民币元. Rows include 基金本期净收益, 基金份额本期净收益, etc.

提示: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。

2、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金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



图一:上投摩根双息平衡混合型证券投资基金成立以来净值增长率与业绩比较基准收益率对比图

(一)基金经理介绍:吕刚女士,1973年出生,硕士学位,曾服务于国泰基金管理有限公司,现任上投摩根基金管理有限公司基金经理。

(二)基金运作合规性说明: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,基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规。

(三)基金投资策略:三季度,市场波动较大,特别是银行、金融等行业表现良好。本基金在这些行业进行了布局,取得了一定的收益。

Table with 2 columns: 资产项目, 金额(元), 占基金总资产的比例. Rows include 股票, 债券, 权证, etc.

Table with 2 columns: 报告期末按行业分类的股票投资组合, 市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include A, 农林牧渔, etc.

截至2006年9月30日,上投摩根双息平衡混合型证券投资基金资产净值为5,594,853,540.55元,基金份额净值为1.0643元,累计基金份额净值为1.0643元。

3、C制造业 1,442,559,099.20 50.9%

Table with 2 columns: 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 000001, 000002, etc.

(三)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 1, 600006, etc.

(四)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

Table with 2 columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 1, 国债, etc.

(五)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

Table with 2 columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 1, 06央行01, etc.

(六)基金投资资产支持证券及报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持

证券明细:无

(七)投资组合报告附注: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。

Table with 2 columns: 序号, 其他资产项目, 金额(元). Rows include 1, 交易保证金, etc.

4、截至2006年9月30日,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细如下:

Table with 2 columns: 权证代码, 权证名称, 权证数量(份), 权证成本(人民币元). Rows include 580007, 580097, etc.

5、截至2006年9月30日,本基金持有的权证明细如下:

Table with 2 columns: 权证代码, 权证名称, 权证数量(份), 权证成本(人民币元). Rows include 580007, 580097, etc.

七、备查文件目录:1、中国证监会批准《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金》设立的文件;

2、《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金合同》;

3、《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金托管协议》;

4、《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金业务规则》;

上投摩根货币市场基金 2006年第三季度报告

2006年第3号

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

重要提示:基金管理人、董事及高级管理人员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,并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金投资目标:本基金投资于具有良好流动性的短期金融工具,在有效控制风险和保持较高流动性的前提下,追求基金资产的长期增值。

基金投资策略:本基金在有效控制风险和保持较高流动性的前提下,追求基金资产的长期增值。本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。

基金业绩比较基准:本基金业绩比较基准为:上证国债指数收益率*70%+新华富时中国A600指数收益率*25%+上证国债指数收益率*5%。

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

Table with 2 columns: 主要财务指标, 单位:人民币元. Rows include 基金本期净收益, 基金份额本期净收益, etc.

Table with 2 columns: 业绩比较基准, 单位:人民币元. Rows include 基金本期净收益, 基金份额本期净收益, etc.

提示: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,基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

1、上投摩根货币市场基金本期净值增长率与业绩比较基准收益率对比图



图一:上投摩根货币市场基金成立以来净值增长率与业绩比较基准收益率对比图

(一)基金经理介绍:李静女士,1976年出生,管理学硕士,中国注册会计师,曾任上海金信证券研究所研究员;湘财证券研究所研究员;中信基金管理公司基金经理。

(二)基金运作合规性说明: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,基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规。

(三)基金投资策略:三季度宏观经济数据在央行一系列的调控下放缓了增长速度,贸易顺差仍保持高位,货币市场资金仍较为充裕,央行票据利率仍保持高位。

Table with 2 columns: 资产项目, 金额(元), 占基金总资产的比例. Rows include 股票, 债券, 权证, etc.

Table with 2 columns: 报告期末按行业分类的股票投资组合, 市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include A, 农林牧渔, etc.

截至2006年9月30日,上投摩根货币市场基金资产净值为4,227,521,527.27元,基金份额净值为1.0000元,累计基金份额净值为1.0000元。

3、C制造业 1,442,559,099.20 50.9%

Table with 2 columns: 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 000001, 000002, etc.

(三)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 1, 300001, etc.

(四)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

Table with 2 columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 1, 06央行01, etc.

(五)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

Table with 2 columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 市值占基金资产净值比例. Rows include 1, 06央行01, etc.

(六)基金投资资产支持证券及报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持

证券明细:无

(七)投资组合报告附注: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。

Table with 2 columns: 序号, 其他资产项目, 金额(元). Rows include 1, 交易保证金, etc.

4、截至2006年9月30日,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细如下:

Table with 2 columns: 权证代码, 权证名称, 权证数量(份), 权证成本(人民币元). Rows include 580007, 580097, etc.

5、截至2006年9月30日,本基金持有的权证明细如下:

Table with 2 columns: 权证代码, 权证名称, 权证数量(份), 权证成本(人民币元). Rows include 580007, 580097, etc.

七、备查文件目录:1、中国证监会批准《上投摩根货币市场基金》设立的文件;

2、《上投摩根货币市场基金基金合同》;

3、《上投摩根货币市场基金托管协议》;

4、《上投摩根货币市场基金业务规则》;

5、基金管理人业务资格证件、营业执照;

6、基金托管人业务资格证件、营业执照;

7、基金销售机构业务资格证件、营业执照;