

(上接 B14 版)

截至 2006 年 6 月 30 日,上投摩根阿尔法股票型证券投资基金资产净值为 1,749,929,578.78 元,基金份额净值为 1.8447 元,累计基金份额净值为 1.8847 元。其资产组合情况如下:

| 序号 | 资产项目       | 金额(元)            | 占基金总资产的比例 |
|----|------------|------------------|-----------|
| 1  | 股票         | 1,495,399,092.67 | 85.23%    |
| 2  | 债券         | 30,321,000.00    | 1.69%     |
| 3  | 权证         | 947,592.89       | 0.05%     |
| 4  | 银行存款及清算备付金 | 213,302,040.71   | 11.95%    |
| 5  | 其他资产       | 88,143,791.44    | 3.79%     |
|    | 合计         | 1,748,894,333.71 | 100.00%   |

## 2、报告期未按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 分类               | 市值(元)            | 市值占基金资产净值比例 |
|----|------------------|------------------|-------------|
| 1  | A 农、林、牧、渔业       | 0.00             | 0.00%       |
| 2  | B 采掘业            | 56,891,448.87    | 5.48%       |
| 3  | C 制造业            | 885,323,484.94   | 60.65%      |
|    | C0 食品饮料          | 334,292,988.28   | 19.10%      |
|    | C1 纺织服装、皮毛       | 0.00             | 0.00%       |
|    | C2 木材、家具         | 0.00             | 0.00%       |
|    | C3 造纸、印刷         | 0.00             | 0.00%       |
|    | C4 石油、化学、塑胶、塑料   | 56,171,966.97    | 3.21%       |
|    | C5 电子            | 21,334,347.10    | 1.22%       |
|    | C6 金属、非金属        | 194,729,013.83   | 11.13%      |
|    | C7 机械、设备、仪表      | 265,585,570.25   | 15.18%      |
|    | C8 医药、生物制品       | 14,289,888.61    | 0.81%       |
|    | C9 其他制造业         | 0.00             | 0.00%       |
| 4  | D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 410,021.20       | 0.02%       |
| 5  | E 建筑业            | 0.00             | 0.00%       |
| 6  | F 交通运输、仓储业       | 104,750,427.63   | 5.99%       |
| 7  | G 信息技术业          | 40,193,781.06    | 2.30%       |
| 8  | H 批发和零售贸易        | 87,315,765.68    | 4.99%       |
| 9  | I 金融、保险业         | 111,589,724.21   | 6.37%       |
| 10 | J 房地产业           | 56,894,728.43    | 3.25%       |
| 11 | K 社会服务业          | 37,184,116.11    | 2.12%       |
| 12 | L 传播与文化业         | 0.00             | 0.00%       |
| 13 | M 综合类            | 65,836,203.55    | 3.76%       |
|    | 合计               | 1,495,399,092.67 | 84.93%      |

## 3、报告期未按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

## 上投摩根阿尔法股票型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 股票数量(股)    | 期末市值(元)        | 市值占基金资产净值比例 |
|----|--------|------|------------|----------------|-------------|
| 1  | 600320 | G 振华 | 5,712,214  | 112,759,104.36 | 6.44%       |
| 2  | 600036 | G 招行 | 12,070,462 | 93,063,262.02  | 5.32%       |
| 3  | 000895 | 双发   | 2,921,859  | 91,074,346.03  | 5.20%       |
| 4  | 600456 | G 宝钛 | 1,695,989  | 76,589,186.20  | 4.38%       |
| 5  | 600619 | G 茅台 | 1,491,063  | 70,735,933.84  | 4.04%       |
| 6  | 600761 | G 合力 | 3,853,358  | 56,721,426.06  | 3.24%       |
| 7  | 600887 | G 伊力 | 2,439,408  | 55,161,098.32  | 3.15%       |
| 8  | 600894 | 大商股份 | 1,318,178  | 54,506,690.30  | 3.11%       |
| 9  | 600558 | G 厦港 | 3,211,341  | 51,871,056.00  | 2.90%       |
| 10 | 000693 | G 张裕 | 1,139,365  | 44,714,717.05  | 2.55%       |

## 4、报告期末按券种分类的债券投资组合

| 序号 | 券种   | 市值(元)         | 市值占基金资产净值比例 |
|----|------|---------------|-------------|
| 1  | 国债   | 0.00          | 0.00%       |
| 2  | 金融债  | 30,321,000.00 | 1.73%       |
| 3  | 可转债  | 0.00          | 0.00%       |
| 4  | 央行票据 | 0.00          | 0.00%       |
| 5  | 企业债  | 0.00          | 0.00%       |
|    | 合计   | 30,321,000.00 | 1.73%       |

## 5、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

| 序号 | 债券名称    | 市值(元)         | 市值占基金资产净值比例 |
|----|---------|---------------|-------------|
| 1  | 04国债 01 | 30,321,000.00 | 1.73%       |

## 6、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

## 7、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。

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。

## 3)截至 2006 年 6 月 30 日,本基金的其他资产项目包括:

| 序号 | 其他资产项目   | 金额(元)         |
|----|----------|---------------|
| 1  | 交易保证金    | 437,726.00    |
| 2  | 应收利息     | 402,094.00    |
| 3  | 应收申购款    | 67,110,216.27 |
| 4  | 应收股利     | 8,010.00      |
| 5  | 待摊费用     | 185,236.27    |
|    | 其他资产项目合计 | 69,142,791.44 |

## 4)截至 2006 年 6 月 30 日,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细如下:

无

5)截至 2006 年 6 月 30 日,本基金持有的权证全部为被动持有。

## 八、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

| 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     |
|-----------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|---------|
| 基金成立日-2006/12/31      | 2.02%  | 0.0035    | 0.47%      | 0.0075        | 1.55%  | -0.0040 |
| 2006/01/01-2006/06/30 | 86.47% | 0.0157    | 46.37%     | 0.0112        | 40.11% | 0.0025  |

## 九、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

## 1、费用的种类

- 1)基金管理人的管理费;
  - 2)基金托管人的托管费;
  - 3)基金财产划拨支付的银行费用;
  - 4)基金合同生效后的信息披露费用;
  - 5)基金份额持有人大会费用;
  - 6)基金合同生效后的会计师事务所和律师费;
  - 7)基金的证券交易费用;
  - 8)按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。
- 2、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

## 3、基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式

1)基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H = E × 年管理费率 ÷ 当年天数,本基金年管理费率为 1.5%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

## 2)基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H = E × 年托管费率 ÷ 当年天数,本基金年托管费率为 0.25%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

股票简称:S\*ST 长岭 股票代码:000561 公告编号:2006—041

长岭(集团)股份有限公司  
关于股权分置改革的提示性公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

根据国务院相关文件的规定,S\*ST 长岭国有股实际控制人宝鸡市人民政府国有资产监督管理委员会提出了股权分置改革动议,并委托公司董事会办理相关事宜。经与深圳证券交易所商定,现就有关事项公告如下:

- 1、公司股票自本公告发布之日起开始停牌。
- 2、公司将在近期发布召开相关股东大会的通知,披露股权分置改革相关文件。特此公告

长岭(集团)股份有限公司  
董 事 会  
二〇〇六年十一月二十七日

证券代码:600081 证券简称:S 东风科 编号:临 2006—33

东风电子科技股份有限公司  
关于股权分置改革的提示性公告

东风电子科技股份有限公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

根据国务院《关于推进资本市场改革开放和稳定发展的若干意见》(国发[2004]3 号)和中国证券监督管理委员会、国务院国有资产监督管理委员会、财政部、中国人民银行和商务部联合颁布的《关于上市公司股权分置改革的指导意见》等相关法规的规定,遵循股权分置改革的操作程序,东风电子科技股份有限公司的非流通股股东提出了股权分置改革动议。经与上海证券交易所商定,现就有关事项公告如下:

- 1、东风电子科技股份有限公司 A 股股票自本公告发布之日起开始停牌。
- 2、东风电子科技股份有限公司将根据股权分置改革工作进展情况尽快公告股权分置改革工作的相关文件。特此公告。

东风电子科技股份有限公司  
董 事 会  
二〇〇六年十一月二十四日

证券代码:600092 股票简称:S\*ST 精密 编号:临 2006—044

## 陕西精密合金股份有限公司终止上市公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,并对公告中的任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担连带责任。

经中国证券监督管理委员会核准,陕西精密合金股份有限公司股票已于 2006 年 11 月 24 日终止上市。

陕西精密合金股份有限公司股票终止上市的公告已于 2006 年 11 月 24 日刊登于上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)上,主要内容包括:

“你公司未按规定披露 2005 年年度报告,根据《上海证券交易所股票上市规则》第 14.3.1 条、第 14.3.6 条和第 14.3.12 条的规定,本所决定自 2006 年 11 月 30 日起终止你公司股票上市。”

自 2005 年 1 月以来,公司经营业务处于停顿状态,公司持续经营能力存在极大的不确定性,有关推进重组事项无进展。公司虽经过诸多努力亦无

陕西精密合金股份有限公司董事会  
二〇〇六年十一月二十四日

证券代码:600215 证券简称:s 长经开 编号:2006—030

长春经开(集团)股份有限公司  
关于公司重大资产出售和购买方案  
获得中国证监会审核通过的更正公告

公司于 2006 年 11 月 24 日披露了《关于公司重大资产出售和购买方案获得中国证监会重组委审核通过的公告》,现更正为《关于公司重大资产出售和购买方案获得中国证监会审核通过的公告》,原公告中涉及的“重组委”字样去掉。现将全文公告如下:

近日,公司接到中国证监会证监公司字[2006]252 号文,中国证券监督管理委员会已经审核通过公司与长春东南开发建设有限公司、长春经济技术开发区国资委、长春经济技术开发区管委会进行重大资产出售和购买方案,同意公司按照证监公司字[2001]105 号文件规定的程序实施重组。

本公司根据中国证监会的审核意见对本公司 2006 年 8 月 7 日披露的《长春经开股份有限公司重大资产出售和购买报告书(草案)》(详见 2006 年 8 月 7 日《上海证券报》,和上海证券交易所网站)进行了补充和修改,现将全文予以披露。

此外,经过补充和修改的《重大资产出售和购买报告书》、《独立财务顾问报告》、《法律意见书》作为附件亦将在上海证券交易所网站上进行披露。

投资者在阅读和使用本公司《长春经开股份有限公司重大资产出售和购买报告书》时,需特别注意两次报告书的差异,并以本次披露的报告书内容为准。

特此公告

长春经开(集团)股份有限公司董事会  
2006 年 11 月 27 日

证券代码:600693 证券简称:东百集团 编号:临 2006—023

## 福建东百集团股份有限公司提示性公告

福建东百集团股份有限公司因有重大信息需要披露,特申请对公司股票于 2006 年 11 月 27 日继续停牌一天,公司将于 2006 年 11 月 28 日(星期二)披露重要信息,同时公司股票复牌交易。

特此公告。

福建东百集团股份有限公司  
2006 年 11 月 25 日

证券代码:600859 股票简称:S 王府井 编号:临 2006—028

北京王府井百货(集团)股份有限公司  
关于股权分置改革获得北京市国资委批复的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负有连带责任。

公司接到北京市国有资产监督管理委员会《关于北京王府井百货(集团)股份有限公司股权分置改革有关问题的批复》(京国资产权字[2006]202 号),北京市国资委同意本公司股权分置改革方案。

特此公告。

北京王府井百货(集团)股份有限公司  
二〇〇六年十一月二十三日

证券代码:600623 900909 股票简称:轮胎橡胶 轮胎 B 股 编号:临 2006—029

## 上海轮胎橡胶(集团)股份有限公司 2006 年第一次临时股东大会决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

- 本次会议无否决提案的情况;
- 本次会议没有新提案提交表决。

## 一、会议召开情况

1、会议召开时间:现场会议召开时间为 2006 年 11 月 24 日(周五)下午 2:00;网络投票时间为当日上午 9:30 至 11:30、下午 1:00 至 3:00。

2、现场会议地点:上海市中山山东二路 9 号上海档案馆 8 楼会议室。

3、召集人:上海轮胎橡胶(集团)股份有限公司(以下简称“公司”)董事会。

4、会议方式:采用现场投票和网络投票的一种表决方式,重复投票以第一次投票为准。

5、现场会议主持人:董事长范奕先生。

6、会议通知于 2006 年 10 月 31 日在《上海证券报》、《南华早报》和上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)上公告。会议的召集、召开符合《公司法》和《公司章程》的有关规定。北京市金杜律师事务所为本次股东大会出具了法律意见书。

## 二、会议出席情况

参加表决的股东及代表共 60 人,代表股份 591,774,198(五亿九千一百七十七万四千一百九十八)股,占公司总股本的 66.5313%;其中,参加网络投票的流通股股东和股东授权代理人共 17 人,代表股份 134,178(拾三万四千一百七十八)股,占公司总股本的 0.0151%。

公司部分董事、监事、高级管理人员、见证律师出席了本次会议。

## 三、提案审议情况

本次会议以记名投票表决方式,逐项审议并通过了如下议案:

## 1、《关于审查公司符合公开增发 A 股条件的议案》

|       | 代表股份数       | 同意股数        | 反对股数   | 弃权股数    | 赞成比例   |
|-------|-------------|-------------|--------|---------|--------|
| 全体股东  | 591,774,198 | 590,919,000 | 36,181 | 819,017 | 99.85% |
| A 股股东 | 590,062,788 | 590,006,890 | 31,181 | 24,717  | 99.99% |
| B 股股东 | 1,711,410   | 912,110     | 5,000  | 794,300 | 53.3%  |

## 2、《关于公司申请公开增发 A 股方案的议案》

| 2.1、发行股票种类 |             |             |        |         |        |
|------------|-------------|-------------|--------|---------|--------|
|            | 代表股份数       | 同意股数        | 反对股数   | 弃权股数    | 赞成比例   |
| 全体股东       | 591,774,198 | 590,894,680 | 47,381 | 832,137 | 99.85% |
| A 股股东      | 590,062,788 | 589,992,270 | 42,381 | 281,37  | 99.99% |
| B 股股东      | 1,711,410   | 902,410     | 5,000  | 804,000 | 52.73% |

| 2.2、每股面值 |             |             |        |         |        |
|----------|-------------|-------------|--------|---------|--------|
|          | 代表股份数       | 同意股数        | 反对股数   | 弃权股数    | 赞成比例   |
| 全体股东     | 591,774,198 | 590,894,680 | 47,381 | 832,137 | 99.85% |
| A 股股东    | 590,062,788 | 589,992,270 | 42,381 | 281,37  | 99.99% |
| B 股股东    | 1,711,410   | 902,410     | 5,000  | 804,000 | 52.73% |

| 2.3、发行数量 |             |             |        |         |        |
|----------|-------------|-------------|--------|---------|--------|
|          | 代表股份数       | 同意股数        | 反对股数   | 弃权股数    | 赞成比例   |
| 全体股东     | 591,774,198 | 590,894,680 | 47,381 | 832,137 | 99.85% |
| A 股股东    | 590,062,788 | 589,992,270 | 42,381 | 281,37  | 99.99% |
| B 股股东    | 1,711,410   | 902,410     | 5,000  | 804,000 | 52.73% |

| 2.4、发行方式 |             |             |        |         |        |
|----------|-------------|-------------|--------|---------|--------|
|          | 代表股份数       | 同意股数        | 反对股数   | 弃权股数    | 赞成比例   |
| 全体股东     | 591,774,198 | 590,894,680 | 47,381 | 832,137 | 99.85% |
| A 股股东    | 590,062,788 | 589,992,270 | 42,381 | 281,37  | 99.99% |
| B 股股东    | 1,711,410   | 902,410     | 5,000  | 804,000 | 52.73% |

| 2.5、发行地区 |             |             |        |         |        |
|----------|-------------|-------------|--------|---------|--------|
|          | 代表股份数       | 同意股数        | 反对股数   | 弃权股数    | 赞成比例   |
| 全体股东     | 591,774,198 | 590,894,680 | 47,381 | 832,137 | 99.85% |
| A 股股东    | 590,062,788 | 589,992,270 | 42,381 | 281,37  | 99.99% |
| B 股股东    | 1,711,410   | 902,410     | 5,000  | 804,000 | 52.73% |

| 2.6、发行对象 |             |             |        |         |        |
|----------|-------------|-------------|--------|---------|--------|
|          | 代表股份数       | 同意股数        | 反对股数   | 弃权股数    | 赞成比例   |
| 全体股东     | 591,774,198 | 590,894,680 | 47,381 | 832,137 | 99.85% |
| A 股股东    | 590,062,788 | 589,992,270 | 42,381 | 281,37  | 99.99% |
| B 股股东    | 1,711,410   | 902,410     | 5,000  | 804,000 | 52.73% |

| 2.7、定价方式 |             |             |        |         |        |
|----------|-------------|-------------|--------|---------|--------|
|          | 代表股份数       | 同意股数        | 反对股数   | 弃权股数    | 赞成比例   |
| 全体股东     | 591,774,198 | 590,894,680 | 47,381 | 832,137 | 99.85% |
| A 股股东    | 590,062,788 | 589,992,270 | 42,381 | 281,37  | 99.99% |
| B 股股东    | 1,711,410   | 902,410     | 5,000  | 804,000 | 52.73% |

| 2.8、关于本次增发决议的有效期 |             |             |        |         |        |
|------------------|-------------|-------------|--------|---------|--------|
|                  | 代表股份数       | 同意股数        | 反对股数   | 弃权股数    | 赞成比例   |
| 全体股东             | 591,774,198 | 590,894,680 | 47,381 | 832,137 | 99.85% |
| A 股股东            | 590,062,788 | 589,992,270 | 42,381 | 281,37  | 99.99% |
| B 股股东            | 1,711,410   | 902,410     | 5,000  | 804,000 | 52.73% |

| 2.9、本次增发 A 股募集资金数额及用途 |             |             |        |         |        |
|-----------------------|-------------|-------------|--------|---------|--------|
|                       | 代表股份数       | 同意股数        | 反对股数   | 弃权股数    | 赞成比例   |
| 全体股东                  | 591,774,198 | 590,894,680 | 47,381 | 832,137 | 99.85% |
| A 股股东                 | 590,062,788 | 589,992,270 | 42,381 | 281,37  | 99.99% |
| B 股股东                 | 1,711,410   | 902,410     | 5,000  | 804,000 | 52.73% |

| 3、《关于公司增发 A 股募集资金投资项目可行性分析报告的议案》 |             |             |        |         |        |
|----------------------------------|-------------|-------------|--------|---------|--------|
|                                  | 代表股份数       | 同意股数        | 反对股数   | 弃权股数    | 赞成比例   |
| 全体股东                             | 591,774,198 | 590,880,210 | 29,051 | 865,937 | 99.85% |
| A 股股东                            | 590,062,788 | 589,992,100 | 2      |         |        |