上投摩根内需动力股票型证券投资基金

招募说明书(更新)摘要

基金合同生效日期:2007年4月13日

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司　基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示:

1.投资有风险,投资人申购基金时应当认真阅读招募说明书;

2.基金的过往业绩并不预示其未来表现;

3.基金投资者购买基金并不等于将资金作为存款存入银行或者存款类金融机构,基金管理人不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

4. 本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

一、基金管理人

(一)基金管理人简况

本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司,基本信息如下:

注册地址:上海市浦东富城路99号震旦国际大楼20层

办公地址:上海市浦东富城路99号震旦国际大楼20层

法定代表人:陈开元

总经理:王鸿嫦

成立日期:2004年5月12日

实缴注册资本:壹亿伍仟万元人民币

股东名称、股权结构及持股比例:

上海国际信托投资有限公司　51%

JPMorgan Asset Management (UK) Limited　49%

上投摩根基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[2004]56号文批准,于2004年5月12日成立的合资基金管理公司。2005年8月12日,基金管理人完成了股东之间的股权变更事项。公司注册资本保持不变,股东及出资比例分别由上海国际信托投资有限公司67%和摩根富林明资产管理(英国)有限公司33%变更为目前的51%和49%。

2006年6月6日,基金管理人的名称由"上投摩根基金管理有限公司"变更为"上投摩根基金管理有限公司",该更名申请于2006年4月29日获得中国证监会的批准,并于2006年6月2日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

基金管理人无任何受处罚记录。

(二)主要人员情况

1.董事会成员基本情况:

陈开元先生,董事长

大学本科学历,中共党员,高级经济师。

先后任职于上海市财政局第三分局,共青团上海市财政局委员会,英国伦敦 Coopers & Lybrand 咨询公司等,曾任上海市财政局对外经济财务处处长,现任上海国际集团有限公司副总经理。

独立董事4名:

独立董事:周道炯

大学专科学历,曾就学于安徽省委马列夜大学、中共安徽省委中级党校进修班、中共中央高级党校培训班。

曾任中国证监会主席、中国建设银行行长、九届全国人大财经委委员。

现任PECC(中国金融市场发展委员会主席。周道炯先生长期从事证券金融市场监管工作,目前作为高级顾问为证券市场改革提供顾问咨询意见。

独立董事:姜波克

获英国 Sussex University 博士学位,曾就读于上海复旦大学经济学系、上海复旦大学世界经济系。

现任复旦大学金融研究院常务副院长,国务院学位委员会学科评议组成员,博士后,教授,博士生导师。

独立董事:Robert Herries

获英国剑桥大学文学硕士学位。

历任JF集团有限公司董事、南非标准银行(非洲及中东第一大银行)行政总裁。

现任Tree Line Advisors (Hong Kong) Limited 营运总监。

独立董事:戴立宇

获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

历任台湾财政部常务次长。

现任台湾东吴大学专任客座副教授。

董事5名:

董事:Clive Brown

获布里斯托大学理学学士学位。

历任JF控股有限公司财务总监,JF投资管理有限公司首席执行官。

现任摩根富林明资产管理国际总裁。

董事:许立庆

获台湾政治大学工商管理硕士学位。

历任摩根富林明台湾有限公司董事长。

现任JF资产管理亚太区(不包括日本)总裁。

董事:蔡奋威

获香港理工大学学士学位。

历任德勤会计师事务所合伙人等。

现任JF资产管理有限公司行政总监。

董事:杨德红

获复旦大学经济学学士,中欧工商管理学院MBA。

现任上海国际集团有限公司总经理助理。

董事:林彬

获中欧工商管理学院MBA。

曾任香港上市的沪光基金副总经理。

现任上海国际信托投资有限公司副总经理。

2.监事会成员基本情况:

监事长:郭平

法律专业,本科学历,高级职称。

曾任黄浦区人民检察院检察长、浦东新区人民检察院代检察长、上海市人民检察院第二分院检察长。

现任上海国际集团有限公司党委副书记、副董事长、纪委书记。

监事:谭伟明

香港特许公认会计师工会资深会员,香港特许秘书公会会士,香港会计师公会会士,英国特许秘书及行政人员公会会员。

曾任伯富控股有限公司财务董事,JF资产管理有限公司副总裁。

现任JF资产管理有限公司总经理。

监事:俞楠

获北京大学光华管理学院工商管理硕士学位。

曾任伯富(中国)投资服务有限公司北京办事处资产管理主管、首席代表。

现任上投摩根基金管理有限公司北京分公司负责人。

3.总经理基本情况:

王鸿嫦女士,总经理。

毕业于台湾清华大学经济系。

历任摩根富林明投资信托股份有限公司电子商务部副总经理,摩根富林明投资顾问股份有限公司总经理。

4.其他高级管理人员情况:

刘樱女士,副总经理。

毕业于复旦大学法律系。

历任上海国际集团有限公司法律部总经理,上海国际集团有限公司监事。

傅帆先生,副总经理。

获伦敦城市大学工商管理学硕士学位。

历任上投实业公司副总经理,上海国际信托投资有限公司副总经理。

胡志强先生,副总经理。

毕业于香港中文大学,获得工商管理学院学士学位。

曾任职于中国银行香港分行、JF资产管理有限公司。

刘建平先生,督察长。

毕业于北京大学法律系,获法学硕士学位。

历任中国证券监督管理委员会基金监管部副处长。

5. 本基金基金经理

基金经理孙延群,男,1968年出生,硕士学历,中国注册会计师,8年证券从业经验。1992年进入哈尔滨飞机制造公司;1997年至2003年间,分别在中兴信托投资有限公司上海证券管理总部及平安证券有限责任公司担任行业分析师;2003年3月进入景顺长城基金管理有限公司,任景顺长城内需增长基金的基金经理;2005年6月加入上投摩根基金管理有限公司投资管理部,并从2005年11月起担任上投摩根阿尔法基金的基金经理。

6. 基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

王鸿嫦女士,总经理;孙延群先生,投资副总监、基金经理;芮肖先生,基金经理;赵梓峰先生,基金经理;杨安乐,基金经理;许运凯,研究副总监。上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1984年1月1日

法定代表人:姜建清

注册资本:人民币334,018,850,026元

联系电话:010-66106912

联系人:蒋松云

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国工商银行始终坚持"诚实信用、勤勉尽责"的原则,严格履行着资产托管人的责任和义务,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力,为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。截至2007年9月,托管证券投资基金83只,其中封闭式11只、开放式72只。托管资产规模年均递增超过70%。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、履约类产品、OFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。继先后获得《亚洲货币》和《全球托管人》评选的"2004年度中国最佳托管银行"称号、《财资》和《全球托管人》评选的"2005年度中国最佳托管银行"称号后,中国工商银行又分别摘取《环球金融》、《财资》杂志"2006年度中国最佳托管银行"桂冠。

三、相关服务机构

(一)基金销售机构:

1.直销机构:上投摩根基金管理有限公司(同上)

2.代销机构:

(1)中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

电话:010-66107900

联系人:田耕

客户服务统一咨询电话:95588

网址:www.icbc.com.cn

(2)中国建设银行股份有限公司

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼(长安兴融中心)

法定代表人:郭树清

客户服务电话:95533

网址:www.ccb.com

(3)招商银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:秦晓

电话:(0755)82090060

传真:(0755)82090817

联系人:刘薇

网址:www.cmbchina.com

(4)交通银行股份有限公司

注册地址:上海市仙霞路18号

办公地址:上海市银城中路188号

法定代表人:蒋超良

电话:(021)58781234

传真:(021)58408842

联系人:曹彬

客户服务热线:95559

网址:www.bankcomm.com

(5)中国光大银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人:王明权

电话:(010)68098000

传真:(010)68561260,68561290

客服电话:95595

联系人:刘静

网址:www.cebbank.com

(6)上海银行股份有限公司

注册地址:上海市中山东二路585号

办公地址:上海市中山东二路585号

法定代表人:陈辛

联系人:张浩

联系电话:021-63370888

传真:021-63370777

客户服务热线:021-962888

网址:www.bankofshanghai.com

(7)国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路618号

办公地址:上海市延平路135号

法定代表人:祝幼一

电话:(021)62580818转213

传真:(021)62569400

联系人:芮敏祺

客户服务咨询电话:400-8888-666

网址:www.gtja.com

(8)中信建投证券有限责任公司

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市东城区朝内大街188号

法定代表人:黎晓宏

电话:(010)65186758

传真:(010)65182261

联系人:魏明

客户服务咨询电话:400-8888-108;

网址:www.csc108.com

(9)申银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路171号

法定代表人:丁国荣

电话:021-962505、021-54033888

传真:021-54038844

联系人:胡洁静

客户服务电话:(021)962505

网址:www.sw2000.com.cn

(10)兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人:兰荣

电话:021-68419125

联系人:杨盛芳

客户服务热线:021-68419974

公司网站:www.xyzq.com.cn

(11)招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座40-45层

法定代表人:宫少林

电话:(0755)26951111(客户服务中心)

传真:(0755)82943237

联系人:黄健

客户服务电话:400-8888-111

网址:www.newone.com.cn

(12)光大证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔15-16楼

法定代表人:王明权

电话:021-68816000

传真:021-68815009

联系人:刘晨

客户服务电话:10108998

网址:www.ebscn.com

(13)海通证券股份有限公司

注册地址:上海市淮海中路98号

法定代表人:王开国

电话:(021)53594566转4125

传真:(021)53858549

联系人:金芸 杨薇

客户服务咨询电话:(021)962503、400-8888-001

网址:www.htsec.com

(14)广发证券股份有限公司

注册地址:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

办公地址:广东广州天河北路大都会广场36、38、41和42楼

法定代表人:王志伟

联系人:肖中梅

咨询电话:(020)87555888转各营业网点

传真:(020)87557985

公司网站:http://www.gf.com.cn

(15)财富证券有限责任公司

注册地址:长沙市芙蓉中路二段八十号顺天国际财富中心26层

法定代表人:蔡永明

电话:0731-4403343

传真:0731-4403439

联系人:张治平

网址:www.cfzq.com

(16)东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

客户服务热线:021-962506

联系人:吴宇

电话:021-63325888

传真:021-63326173

网址:www.dfzq.com.cn

(17)联合证券有限责任公司

注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

法定代表人:马国强

联系电话:0755-82492190

客服热线:400-8888-555;0755-25125666

传真:0755-82492062

联系人:范雪玲

公司网站:www.lhzq.com

(18)国信证券有限责任公司

注册地址:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法定代表人:何如

电话:0755-82130833转2181

传真:0755-82133302

联系人:林建阀

客户服务电话:800-810-8868

公司网址:www.guosen.com

(19)国都证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区华强北路赛格广场45层

办公地址:北京市东城区安外大街安贞大厦3层

法定代表人:王少华

联系电话:010-64482828-390

传真:010-64482090

联系人:马泽承

咨询电话:800-810-8809

公司网址:www.guodu.com

(20)德邦证券有限责任公司

注册地址:沈阳市沈河区小西路49号

办公地址:上海市浦东南路588号浦发大厦26层

法定代表人:王军

电话:021-68590808-8119

传真:(021)68596077

联系人:罗芳

网址:www.tebon.com.cn

(21)上海证券有限责任公司

注册地址:上海市九江路111号

法定代表人:蒋元真

电话:(021)65087006

传真:(021)65213164

联系人:刘永

客户服务电话:800-6200-071

网址:www.962518.com

(22)上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址:上海市中山东一路12号

法定代表人:金运

联系人:倪苏云、汤嘉惠

联系电话:021-63296188-82438、82410

客户服务热线:95528,021-63298615

网址:www.spdb.com.cn

(23)中国银河证券有限责任公司

注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:朱利

电话:(010)66568587

传真:(010)66568536

联系人:郭京华

客户服务热线:(010)68016655

网址:www.chinastock.com.cn

(24)华泰证券有限责任公司

注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

客户咨询电话:025-84579897

联系人:张雪莲

联系电话:(025)84457777-882

网址:www.htsc.com.cn

(25)湘财证券有限责任公司

地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

法定代表人:陈学荣

电话:021-68634518

传真:021-68865938

联系人:陈伟 021-68634818-8631

开放式基金客服电话:021-68865020

公司网址:www.xcsc.com

(26)中信证券股份有限公司

注册地址:深圳市湖贝路1030号海龙王大厦

办公地址:北京朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人:王东明

电话:010-84864818

传真:010-84865560

联系人:陈忠

客户服务热线:010-95558

公司网址:www.ecitic.com

(27)兴业银行股份有限公司

注册地址:福州市湖东路154号

法定代表人:高建平

电话:(021)62677777-218937

联系人:陈晓瑾

客户服务电话:95561

公司网站:www.cib.com.cn

(28)深圳发展银行

地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

邮政编码:518001

联系人:周勤

联系电话:0755-82088888

传真电话:0755-82080714

客户服务电话:95501

公司网址:www.sdb.com.cn

(29)中信金通证券有限责任公司

住所:杭州市中河南路11号万凯商务楼A座

办公地址:杭州市中河南路11号万凯商务楼A座

法定代表人:刘军

电话:0571-85783750

传真:0571-85783771

联系人:龚晓军

网址:www.bigsun.com.cn

客户服务热线:0571-96598

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)基金注册登记机构:

上投摩根基金管理有限公司(同上)

(三)律师事务所与经办律师:

名称:源泰律师事务所

注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号,华夏银行大厦14层

负责人:廖海

联系电话:021-5115 0298

传真:021-5115 0398

经办律师:廖海、吕红

(四)会计师事务所:

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室

法定代表人:杨绍信(SI,AS SIU SHUN YANG)

联系电话:+86 21 6123 8888

传真电话:+86 21 6123 8800

经办注册会计师:汪棣　陈宇

联系人:郁豪伟

四、基金概况

基金名称:上投摩根内需动力股票型证券投资基金

基金类型:契约型开放式

五、基金的投资

(一)投资目标

本基金重点投资于内需增长背景下具有竞争优势的上市公司,把握中国经济和行业快速增长带来的投资机会,追求基金资产长期稳定增值。

(二)投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的60%-95%,债券、现金及其它短期金融工具为0-40%,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。对于中国证监会允许投资的创新金融产品,将依据有关法律法规进行投资管理。本基金投资重点是内需驱动行业中的优势企业,80%以上的非现金股票基金资产属于上述投资方向所确定的内容。

如果法律法规对上述比例要求有变更的,本基金投资范围将及时做出相应调整,以调整变更后的比例为准。

(三)投资理念

内需增长来自经济本身内生,国民经济内生增长机制的加强,有力推动经济可持续性发展,为相关行业的优质上市公司提供超常规成长动力。本基金通过深刻价值挖掘内需驱动带来的投资机会,积极把握投资标的的升值潜力。

(四)投资策略

1.股票投资策略

在投资组合构建和管理的过程中,本基金将采取"自上而下"与"自下而上"相结合的方法。基金管理人在内需驱动行业分析的基础上,选择具有可持续增长前景的优势上市公司股票,以合理价格买入并进行中长期投资。本基金股票投资具体包括以下几个层次:

(1)宏观机会/风险判断

内需增长将为相关行业的优质上市公司提供超常规成长动力,本基金基于对宏观经济运行状况及政策分析、金融货币运行状况及政策分析、行业运行景气状况及政策分析的基础上,重点判断宏观经济周期对内需相关行业的影响,作为资产配置的依据。

(2)行业分析与配置

本基金将根据各行业所处生命周期、产业竞争结构、近期发展趋势等方面因素对各行业的相对盈利能力及投资吸引力进行评价,考察净资产收益率、营运周期、销售收入、净利润等指标,重点对内需驱动行业投资机会进行评估,并根据行业综合评价结果确定股票资产中各行业的权重。

(3)公司竞争优势评估

企业在行业中的相对竞争力是决定企业成败和投资价值的关键,本基金将从公司质地和盈利增长两方面对上市公司当前和未来的竞争优势加以评估。

A. 公司质地

公司质地良好的企业通常具备以下特征:企业在管理、品牌、资源、技术、创新能力中的某一方面或多个方面具有竞争对手在短时间内难以模仿的显著优势,从而能够获得超越行业平均的盈利水平和增长速度。本基金将通过包括实际调研在内的多种分析手段,对上市公司质地进行判断,重点关注以下四个方面:

- 公司治理与管理层;
- 品牌/商誉;
- 盈利能力;
- 现金流评估。

B. 盈利增长

在以上研究的基础上,本基金将通过定量与定性相结合的评估方法,对上市公司的增长前景进行分析,确保所选择的企业具备长期竞争优势。

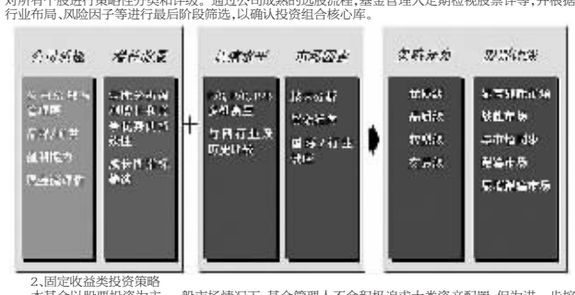
在对上市公司盈利增长前景进行分析时,本基金将充分利用上市公司的财务数据,通过上市公司的成长能力指标进行量化筛选,主要包括EPS增长率、主营业务收入增长率、净利润增长率、净资产增长率等。

(4)决定持券内容

本基金的战略目标是构造可以创造主动管理报酬的投资组合,上市公司经过竞争优势指标筛选之后,将由研究团队进行估值水平考察。

用来衡量上市公司估值水平的主要指标为P/E、P/B、P/S、利润/营运现金流。我们将严格考察公司估值,并与公司的历史、同行业的竞争对手和国际上类似公司的数据进行比较。

通过基本面和估值指标筛选的基础组合即被纳入上投摩根基金公司策略性评价体系。研究团队将对所有个股进行策略性分类和评级。通过公司成熟的选股流程,基金管理人定期检视股票评等,并根据行业布局、风险因子等进行最后阶段筛选,以确认投资组合核心库。



2.固定收益类投资策略

本基金以股票投资为主,一般市场情况下,基金管理人不会积极追求大类资产配置,但为进一步控制投资风险,优化组合流动性管理,本基金将适度防御性资产配置,进行债券、货币市场工具等品种投资。

在券种选择上,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体策略有:

(1)利率预期策略:本基金将首先根据对国内外经济形势的预测,分析市场投资环境的变化趋势,重点关注利率趋势变化。通过全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、物价水平变化趋势等因素,对利率走势形成合理预期。

(2)估值策略:建立不同品种的收益率曲线预测模型,并利用这些模型进行估值,确定价格中枢的变动趋势。根据收益率、流动性、风险匹配原则以及债券的估值原则构建投资组合,合理选择不同市场中有投资价值的券种。

(3)久期管理:本基金努力把握久期与债券价格波动之间的量化关系,根据未来利率变化预期,以久期和收益率变化评估为核心。通过久期管理,合理配置投资品种。

(4)流动性管理:本基金会紧密关注申购/赎回现金流情况、季节性资金流动、日历效应等,建立组合流动性预警指标,实现对基金资产的结构化管理,以确保基金资产的整体变现能力。

(五)业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

沪深300指数是反映沪深两市A股综合表现的跨市场成份指数,指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。本基金为主动管理的股票型基金,在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制方法和历史情况后,我们选定沪深300指数作为本基金股票组合的业绩基准,债券部分的业绩基准则采用上证国债指数。

如果今后市场中出现更具有代表性的业绩比较基准,或者更科学的复合指数权重比例,本基金将根据实际情况对业绩比较基准予以调整。业绩比较基准的变更需经基金管理人和基金托管人协商一致,并在更新的招募说明书中列示。

(六)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。

六、基金的投资组合报告

1.报告期末基金资产组合情况

截至2007年06月30日,上投摩根内需动力股票型证券投资基金资产净值为16,594,959,983.14元,基金份额净值为1.0702元,累计基金份额净值为1.0702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	8,641,241,362.00	50.00%
2	债券	1,411,515,803.94	8.17%
3	权证	0.00	0.00%
4	资产支持证券	0.00	0.00%
5	银行存款及清算备付金	7,129,544,098.47	41.25%
6	其他资产	100,390,692.21	0.58%
	合计	17,282,691,956.62	100.00%

2.报告期末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	66,924,457.50	0.40%
2	B 采掘业	788,858,232.41	4.75%
3	C 制造业	3,206,992,019.67	19.32%
	C0 食品、饮料	1,032,735,198.55	6.22%
	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	153,129,195.19	0.92%
	C5 电子	26,768,937.35	0.16%
	C6 金属、非金属	855,352,118.78	5.15%
	C7 机械、设备、仪表	924,252,237.12	5.57%
	C8 医药、生物制品	116,996,104.58	0.71%
	C99 其他制造业	97,758,228.10	0.59%
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	159,568,000.00	0.96%
5	E 建筑业	43,225,906.60	0.26%
6	F 交通运输、仓储业	535,615,245.42	3.23%
7	G 信息技术业	363,703,904.21	2.19%
8	H 批发和零售贸易	765,738,378.09	4.61%
9	I 金融、保险业	1,833,719,556.17	11.05%
10	J 房地产业	812,598,920.58	4.90%
11	K 社会服务业	0.00	0.00%
12	L 传播与文化产业	0.00	0.00%
13	M 综合类	64,296,741.35	0.39%
	合计	8,641,241,362.00	52.07%

3.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

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	600036	招商银行	32,340,220	794,922,607.60	4.7901%
2	000002	万 科 A	26,249,892	501,897,935.04	3.0244%
3	600519	贵州茅台	3,934,530	470,884,550.40	2.8375%
4	600028	中国石化	35,237,863	465,844,548.86	2.8071%
5	600016	民生银行	31,899,952	364,616,451.36	2.1972%
6	601919	中国远洋	17,472,700	319,051,502.00	1.9226%
7	600019	宝钢股份	26,828,357	295,111,927.00	1.7783%
8	601318	中国平安	3,555,585	254,259,883.35	1.5322%
9	600005	武钢股份	19,999,979	201,199,788.74	1.2124%
10	600030	中信证券	3,429,950	181,684,451.50	1.0948%

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	企业债	0.00	0.00%
3	金融债	269,906,600.00	1.63%
4	可转债	3,110,417.80	0.02%
5	央行票据	1,138,498,786.14	6.86%
	合计	1,411,515,803.94	8.51%

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	07央行票据52	397,280,000.00	2.39%
2	06央行票据60	291,891,410.96	1.76%
3	02国开10	149,972,000.00	0.90%
4	07央行票据34	116,437,643.84	0.70%
5	06央行票据64	106,989,842.47	0.64%

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2007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	250,000.00
2	应收股利	4,587,889.41
3	应收利息	21,931,999.35
4	应收申购款	1,359,803.45
5	其他应收款	72,261,000.00
	其他资产项目合计	100,390,692.21

(4)截至2007年6月30日,本基金持有的处于转股期的可转债明细如下:

无

(5)截至2007年6月30日,本基金持有的权证明细如下:

无

(6)报告期内本基金管理人没有运用自有资产投资本基金。

(7)报告期内发生交易错误一起:2007年5月9日,本基金因操作失误购买托管行中国工商银行股票,发现后立即于次日纠正,卖出全部持有的中国工商银行股票,所得收益归入基金资产。

七、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。基金的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
2007/04/13-2007/06/30	7.02%	1.03%	14.50%	2.16%	-7.48%	-1.13%

八、基金费用概览

1.基金费用的种类

1)基金管理人的管理费;

2)基金托管人的托管费;

3)销售服务费;

4)基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;

5)基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;

6)基金份额持有人大会费用;

7)基金的证券交易费用;

8)银行汇划费用;

9)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金《基金合同》终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1)基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2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、公休假等,支付日期顺延。

2)基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×2.5‰÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3)销售服务费

销售服务费是指基金管理人根据基金合同的约定及届时有效的相关法律法规的规定,从开放式基金财产中计提的一定比例的费用,用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

基金管理人可以选取适当的时机(但应于中国证监会发布有关收取开放式证券投资基金销售费用的规定后)开始计提销售服务费,但至少应提前2个工作日在至少一种指定报刊和网站上公告。公告中应规定计提销售服务费的条件、程序、用途和费率标准。

基金管理人依据本基金合同及届时有效的有关法律法规公告收取基金销售服务费或酌情降低基金销售服务费的,无须召开基金份额持有人大会。

上述一、基金费用的种类中第4-9项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

3.不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1)基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2)基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3)基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

4)其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4.费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率等相关费率。调高基金管理费率、基金托管费率等相关费率须召开基金份额持有人大会审议。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体公告并报中国证监会备案。

5.基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

九、招募说明书更新部分说明

本基金于2007年4月13日成立,至2007年10月12日运作满半年。现依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合基金管理人对本基金实施的投资经营活动,对2007年4月6日公告的《上投摩根内需动力股票型证券投资基金招募说明书》进行内容补充和更新,主要更新的内容如下:

1、在"三、基金管理人"的"主要人员情况"中,对董事、独立董事、监事、基金经理及投资决策委员会等信息进行了更新。

2、在"四、基金托管人"中,对基金托管人的基本情况及相关业务经营情况进行了更新。

3、在"五、相关服务机构"部分,补充了湘财证券、浦发银行、深圳发展银行、华泰证券、中信证券、银河证券、兴业银行、中信金通等新增代销机构的有关信息。

4、本基金的实际募集期是2007年4月10日一天,根据本基金的实际募集情况,在"六、基金的募集及基金合同的生效"中更新了相关内容。

5、在"七、基金份额的申购与赎回"的"申购和赎回的价格、费用及其用途"中,根据我公司在2007年5月29日发布的《关于上投摩根基金管理有限公司旗下基金申购费用及申购份额的计算采用外扣法的公告》,更新了申购费计算的公式。

6、在"七、基金份额的申购与赎回"的"基金转换"中,明确了基金转换的具体规则与费用计算。

7、在"八、基金的投资"的"基金的投资组合报告"中,根据本基金实际运作情况更新了最近一期投资组合报告的内容。

8、在"九、基金的业绩"中,根据基金的实际运作情况,对本基金成立以来的业绩进行了说明。

9、在"十一、基金资产的估值"中,根据我公司在2007年9月28日发布的《上投摩根基金管理有限公司旗下基金基金合同修改公告》的相关内容进行了更新。

10、在"十九、基金托管协议的内容摘要"中对托管人基本情况进行了相应修改。

上投摩根基金管理有限公司

2007年11月28日

证券代码:000799　　证券简称:S*ST酒鬼　　公告编号:2007-85

酒鬼酒股份有限公司相关股东会议表决结果公告

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,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

一、重要提示

1、本次会议无否决议案的情况。

2、公司将于近期刊登股权分置改革实施公告。

3、公司停牌、复牌时间:详见公司股权分置改革方案实施公告。

二、会议召开情况

1、会议召开时间

(1)现场会议召开时间为:2007年11月27日(星期2)14:00。

(2)网络投票时间为:2007年11月23日、26日、27日。其中,通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为:2007年11月23日、26日、27日的上午9:30-11:30以及下午13:00-15:00;通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的具体时间为:2007年11月23日9:30至2007年11月27日15:00任意时间。

2、股权登记日:2007年11月19日。

3、现场会议召开地点:酒鬼酒股份有限公司酒文化陈列馆。

4、召集人:公司董事会。

5、会议方式:本次相关股东会议采取现场投票、委托董事会投票、网络投票相结合的方式,公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统向流通股股东提供网络形式的投票平台,流通股股东可以在网络投票时间内通过上述系统行使表决权。

6、参加会议的方式:公司股东只能选择现场投票、委托董事会投票和网络投票三种方式的任一种方式行使表决权。

8、会议出席对象

(1)凡2007年11月19日下午交易结束后在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的公司股东均有权以本通知公布的方式出席本次相关股东会议及参加表决;不能亲自出席本次相关股东会议现场会议的股东可授权他人代为出席(被授权人不必为本公司股东),或在网络投票时间内参加网络投票。

(2)公司部分董事、监事、其他高级管理人员,保荐机构代表及公司聘请的见证律师参加了本次会议。

三、会议出席情况

1、总体出席会议情况

出席本次会议的股东及股东授权代表共3351人,代表股份225792461股,占公司总股本的74.506%。

2、非流通股股东出席会议情况

出席本次会议的非流通股股东及股东授权代表共11名(其中委托董事会投票3名),代表股份165800000股,占所有非流通股股份总数的84.678%,占总股本的54.71%。

3、流通股股东出席会议情况

出席本次会议的流通股股东及股东授权代表共3350名,代表股份59992461股,占所有流通股股份总数的55.937%,占总股本的19.79%。

其中:

(1)出席现场投票的流通股股东及股东授权代表(非公司董事会)共34名,共持有股份4688759股,占所有流通股股份总数的4.37%,占总股本的1.547%。

(2)委托公司董事会投票的流通股股东10名,代表股份1142248股,占所有