

上投摩根成长先锋股票型证券投资基金2007年年度报告摘要

(上投 160 页) 18 风险管理(续) (d) 市场风险 (山) 外汇风险

Table with 4 columns: 2006年9月20日(基金合同生效日至2006年12月31日止期间), 2006年9月20日(基金合同生效日至2006年12月31日止期间), 2006年12月31日, 2006年12月31日

根据上述追溯调整,按照会计准则和制度直接计入所有者权益下“未实现利得(损失)”科目中核算,相应的未实现损益计入资产负债表中的“公允价值变动损益(损失)”科目中核算,相应的未实现损益计入所有者权益下“未分配利得(未计亏损)”科目。于会计期末,按照会计准则和制度计入所有者权益下“未实现利得(损失)”科目中的全部余额,现按企业会计准则包含于“未分配利得(未计亏损)”科目中。

七、投资组合报告 (一) 报告期末基金资产组合情况 截至2007年12月31日,上投摩根成长先锋股票型证券投资基金资产净值为14,781,296,809.67元,基金资产净值占净资产的3.2908%,累计基金份额净值为3.2908元。其资产组合情况如下:

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合 2007年12月31日

Table with 4 columns: 序号, 分类, 市值(元), 市值占基金资产净值比例

(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 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 持仓数量(万股), 证券市值(元), 市值占净值比例

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊载于上投摩根基金管理有限公司网站的年度报告正文。

(四) 报告期末股票投资组合的重大变动 1. 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名股票的明细如下:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计买入金额(人民币元), 占期初净值比例

2. 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名股票的明细如下:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计卖出金额(人民币元), 占期初净值比例

3. 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元)

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 券种, 市值(元), 市值占基金资产净值比例

(六) 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 4 columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 市值占基金资产净值比例

(七) 资产支持证券投资明细

(八) 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)

4. 截至2007年12月31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2007年12月31日,本基金持有的权证明细如下:

Table with 4 columns: 权证代码, 权证名称, 权证数量(份), 权证成本(人民币元)

6. 报告期内,本基金的基金管理人未运用自有资金投资本基金。

八、基金份额持有人信息、持有人结构 1. 基金份额持有人户数、持有人结构

Table with 4 columns: 基金份额持有人户数(户), 平均每户持有基金份额(份), 机构投资者持有份额(份), 期末持有人结构

Table with 2 columns: 项目, 期末持有本基金基金份额总额(%)

(一) 基金份额总额 基金合同生效以来的基金份额总额(份): 5,480,692,618.04

注:2006年9月20日为基金合同生效日

(二) 报告期末基金份额变动情况

Table with 4 columns: 基金份额总额(份), 期初基金份额总额(份), 报告期内基金份额变动(份), 期末基金份额总额(份)

十、重要事项提示

- (一) 基金份额持有人大会 本年度没有召开基金份额持有人大会。 (二) 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。 1. 2007年6月13日,上投摩根基金管理有限公司公告吕俊担任公司副总经理;2007年10月30日上投摩根基金管理有限公司公告吕俊辞去公司副总经理一职。 2. 2007年7月10日,上投摩根基金管理有限公司公告吕俊兼任担任公司董事,戴立宁担任公司独立董事。

(三) 诉讼事项 本年度未涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(四) 基金投资策略的改变 本年度未发生基金投资策略的改变。

(五) 基金收益分配事项 本年度未发生基金收益分配事项。

(六) 会计师事务所 已支付给普华永道中天会计师事务所有限公司2006年审计费用壹拾万元整。目前的审计机构已提供审计服务的连续年限为2年。

(七) 基金管理人、托管人及高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 本年度未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形。

(八) 本基金租用专用交易席位的情况 截止2007年12月31日本基金通过各机构的交易席位的成交情况见下表:

Table with 5 columns: 券商席位, 席位数量(个), 股票成交金额(元), 占股票成交总额的比例, 债券成交金额(元), 占债券成交总额的比例

上投摩根阿尔法股票型证券投资基金2007年年度报告摘要

(上投 162 页) (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合 2007年12月31日

Table with 4 columns: 序号, 分类, 市值(元), 市值占基金资产净值比例

(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 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 持仓数量(万股), 证券市值(元), 市值占净值比例

2. 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名股票明细如下:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计买入金额(人民币元), 占净值比例

3. 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元)

2006年度因股权分置改革获得非流通股股东支付的现金对价,对股票投资成本影响金额为11,626,272.99元(2006年元元)。

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 券种, 市值(元), 市值占基金资产净值比例

(六) 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 4 columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 市值占基金资产净值比例

(七) 资产支持证券投资明细

(八) 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)

4. 截至2007年12月31日,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细如下: 无

Table with 4 columns: 权证代码, 权证名称, 权证数量(份), 权证成本(人民币元)

6. 本公司未运用自有资金投资阿尔法基金。

八、基金份额持有人信息、持有人结构 1. 基金份额持有人户数、持有人结构

Table with 4 columns: 基金份额持有人户数(户), 平均每户持有基金份额(份), 机构投资者持有份额(份), 期末持有人结构

Table with 2 columns: 项目, 期末持有本基金基金份额总额(%)

(一) 基金份额总额 基金合同生效以来的基金份额总额(份): 767,630,081.16

注:2006年10月11日(基金成立日)为基金合同生效日

(二) 报告期末基金份额变动情况

Table with 4 columns: 基金份额总额(份), 期初基金份额总额(份), 报告期内基金份额变动(份), 期末基金份额总额(份)

十、重要事项提示

- (一) 基金份额持有人大会 本年度没有召开基金份额持有人大会。 (二) 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。 2007年6月13日,上投摩根基金管理有限公司公告吕俊担任公司副总经理;2007年10月30日上投摩根基金管理有限公司公告吕俊辞去公司副总经理一职。 2007年7月10日,上投摩根基金管理有限公司公告吕俊兼任担任公司董事,戴立宁担任公司独立董事。

(三) 诉讼事项 本年度未涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(四) 基金投资策略的改变 本年度未发生基金投资策略的改变。

(五) 基金收益分配事项 本年度未发生基金收益分配事项。

(六) 会计师事务所 已支付给普华永道中天会计师事务所有限公司2006年审计费用100,000元。目前的审计机构已提供审计服务的连续年限为3年。

(七) 基金管理人、托管人及高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 本年度未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形。

(八) 基金托管人重大人事 本基金托管人于2007年9月26日在上海证券交易所上市及开始交易,股票代码为601939。

(九) 本基金租用专用交易席位的情况 截止2007年12月31日本基金通过各机构的交易席位的成交情况见下表:

Table with 5 columns: 券商席位, 席位数量(个), 股票成交金额(元), 占股票成交总额的比例, 债券成交金额(元), 占债券成交总额的比例

Table with 5 columns: 券商席位, 回购成交金额(元), 占回购成交总额的比例, 权证成交金额(元), 占权证成交总额的比例, 佣金(元), 占佣金总额的比例

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,并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 专用席位的选择标准:本基金根据券商的研究实力和客户服务水平选择专用席位。

3. 专用席位的选择程序:研究部提交方案,由公司经营管理委员会批准。

4. 其中,国泰君安深圳直投、高华证券为新增席位。

(九) 其他重要事项 1. 2007年1月18日,上投摩根成长先锋股票型证券投资基金恢复日常申购业务的公告。

2. 2007年1月24日,上投摩根成长先锋股票型证券投资基金增加财富证券为代销机构的公告。

3. 2007年2月2日,上投摩根基金管理有限公司关于上投摩根成长先锋股票型证券投资基金暂停申购的公告。

4. 2007年2月15日,上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金投资北京城建(600296)非公开发行股票的公告。

5. 2007年3月8日,上投摩根成长先锋股票型证券投资基金恢复日常申购业务的公告。

6. 2007年3月16日,上投摩根成长先锋股票型证券投资基金增加交通银行作为代销机构的公告。

7. 2007年3月20日,上投摩根成长先锋股票型证券投资基金增加招商证券的公告。

8. 2007年3月26日,上投摩根成长先锋股票型证券投资基金增加东方财富证券、德邦证券为代销机构的公告。

9. 2007年4月10日,上投摩根成长先锋股票型证券投资基金增加浦发银行、湘财证券为代销机构的公告。

10. 2007年5月8日,上投摩根成长先锋股票型证券投资基金增加光大银行作为代销机构的公告。

11. 2007年5月17日,上投摩根基金管理有限公司关于于对建的处理决定。

12. 2007年5月26日,上投摩根基金管理有限公司北京分公司搬迁公告。

13. 2007年5月29日,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。

14. 2007年6月7日,关于上投摩根基金管理有限公司旗下基金转换费用的计算采用外扣法的公告。

15. 2007年6月13日,上投摩根基金管理有限公司关于聘任吕俊担任副总经理的公告。

16. 2007年6月25日,上投摩根基金管理有限公司关于上投摩根成长先锋股票型证券投资基金暂停申购的公告。

17. 2007年7月2日,上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金实施新会计准则的公告。

18. 2007年7月6日,上投摩根基金管理有限公司关于增加交通银行并办下暂停申购基金定期定额投资业务的公告。

19. 2007年7月10日,上投摩根基金管理有限公司关于公司董事变更的公告。

20. 2007年7月11日,上投摩根基金管理有限公司关于增加光大银行并办下基金定期定额投资业务的公告。

21. 2007年7月17日,上投摩根基金管理有限公司旗下基金新增深圳发展银行作为代销机构的公告。

22. 2007年7月27日,上投摩根基金管理有限公司关于聘任胡志强担任副总经理的公告。

23. 2007年8月24日,上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金投资三一重工(600331)非公开发行股票的公告。

24. 2007年8月31日,上投摩根基金管理有限公司关于增加建设银行并办下暂停申购基金定期定额投资业务的公告。

25. 2007年9月5日,上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金投资新材料(600299)非公开发行股票的公告。

26. 2007年9月7日,上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金投资中宝股份(600208)非公开发行股票的公告。

27. 2007年9月7日,上投摩根基金管理有限公司关于深圳分公司搬迁公告。

28. 2007年9月28日,上投摩根基金管理有限公司关于修改成长先锋基金合同的公告。

29. 2007年9月28日,上投摩根基金管理有限公司关于增加基金新增中信金通作为代销机构的公告。

30. 2007年10月13日,上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金新增中信万通为代销机构的公告。

31. 2007年10月30日,上投摩根基金管理有限公司关于高管人员变更的公告。

32. 2007年11月9日,上投摩根基金管理有限公司关于公司股东变更的公告。

33. 2007年11月24日,上投摩根成长先锋股票型证券投资基金增加招商证券的公告。

34. 2007年11月28日,上投摩根基金管理有限公司关于增加广发证券并办下暂停申购基金定期定额投资业务的公告。

35. 2007年12月1日,上投摩根基金管理有限公司关于暂停基金开市的公告。

36. 2007年12月3日,上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金暂停申购期间增加上海银行办理定期定额投资业务的公告。

37. 2007年12月5日,上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金在暂停申购期间办理定期定额投资业务的提示性公告。

上述公告均可于《上海证券报》、《证券时报》和《中国证券报》上。

38. 2007年12月8日,上投摩根基金管理有限公司关于公司股东变更的公告。 本基金托管人中国建设银行股份有限公司于2007年9月25日在上海证券交易所上市及开始交易,股票代码为601939。

十一、备查文件目录

- 1. 中国证监会核准上投摩根成长先锋股票型证券投资基金设立的文件; 2. 《上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金合同》; 3. 《上投摩根成长先锋股票型证券投资基金托管协议》; 4. 《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》; 5. 基金管理人业务资格批件、营业执照; 6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。 存放地点:基金管理人或基金托管人处。 查阅方式:投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司

2008年3月29日

(上投 162 页) (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 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 持仓数量(万股), 证券市值(元), 市值占净值比例

(四) 报告期末股票投资组合的重大变动 1. 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名股票的明细如下:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计买入金额(人民币元), 占净值比例

2. 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名股票明细如下:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计卖出金额(人民币元), 占净值比例

3. 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元)

(四) 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 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 持仓数量(万股), 证券市值(元), 市值占净值比例

2. 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名股票明细如下:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计买入金额(人民币元), 占净值比例

3. 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元)

上投摩根基金管理有限公司

2008年3月29日