

上投摩根新兴动力股票型证券投资基金

[2012] 第一季度报告

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一二年四月二十四日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理人声明，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、完整性承担个别和连带的法律责任。

基金托管人和召集持有人大会的基金份额持有人声明，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 上投摩根新兴动力股票

基金主代码 377240

交易代码 377240

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2011年7月13日

报告期末基金份额总额 253,624,048.16份

投资目标 本基金在综合经济结构调整和产业升级的发展趋势基础上，在充分挖掘新兴产业中的投资机会，重点关注新兴产业的优质上市公司，并兼顾传统行业中具备新成长能力的上市公司的投资，投资于在控制风险的前提下，追求基金资产的稳定增值。

投资策略 本基金管理人认为，从经济发展的中期趋势看，转变经济发展方式是实现经济转型已经成为我国在相当长一段时期内经济发展的主要任务，在后金融危机时期，因经济面临外需放缓，而国内经济结构矛盾突出而出现的问题，要实现经济持续健康的发展必须依靠新兴产业的崛起。

业绩比较基准 指数:2012年3月31日，上投摩根新兴动力股票型证券投资基金资产净值为224,785,887.03元，基金净值为0.8865元，累计基金份额净值为0.8865元。

§ 3 报告期末按行业分类的基金资产组合情况

序号 项目 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 199,634,471.31 87.41

其中：股票 199,634,471.31 87.41

2 固定收益投资 9,673,000.00 4.24

其中：债券 9,673,000.00 4.24

3 货币市场工具 - -

4 其他资产 - -

其中，买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 18,088,110.49 7.92

6 其他各项资产 992,875.29 0.43

7 合计 228,388,457.09 100.00

注：截至2012年3月31日，上投摩根新兴动力股票型证券投资基金资产净值为224,785,887.03元，基金净值为0.8865元，累计基金份额净值为0.8865元。

§ 2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 4,058,298.80 1.81

B 建筑业 14,130,400.00 0.62

C 制造业 139,071,400.55 61.87

D 交通运输、仓储和邮政业 3,883,254.46 1.73

E 电力、燃气及水的生产和供应业 6,699,635.45 2.98

F 建筑业 709,000.00 0.32

G 石油、化学、塑胶、塑料 4,308,575.90 1.92

H 电子 53,840,833.00 23.95

I 钢铁、有色、建材、非金属矿物制品业 1,903,126.80 0.85

J 机械、设备、仪器仪表 33,308,827.31 14.82

K 社会服务业 34,422,237.43 15.31

L 传播文化业 5,397,400.00 2.40

M 综合类 - -

7 合计 199,634,471.31 88.81

注：本部分仅披露基金本期利息收入、投资收益、其他收入（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。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用（例如：开放式基金的申购费、赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 基金报告期末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 净值增长 率① 净值增 长率 基准比 例基 准收 益率 ② 基准比 例基 准收 益率 ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦ ⑧ ⑨

过去三个月 0.68% 1.89% 1.21% -3.21% 0.21%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动幅度及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：本部分仅披露基金累计份额净值增长率变动幅度及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

上投摩根新兴动力股票型证券投资基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比如图

2011年7月13日至2012年3月31日

注：本基金成立日期为2011年7月13日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。本基金合同生效日为2011年7月13日，截至报告期末本基金合同尚未满一年。图示时间段为2011年7月13日至2012年3月31日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理小组简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

杜猛 本基金基金经理 2011-7-13 - 9年

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.杜猛先生为本基金基金经理，其自即日起担任其基金经理。

3.证券从业的定义从行业协会认可的证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

报告期内，本公司继续贯彻执行证监会及基金业协会发布的各项法律法规和行政规章，严格遵循内部制度，严格执行操作流程，严格按照公司规定的各项规章制度进行操作，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取利益。

4.3 公平交易专项说明

报告期内，本公司严格执行证监会及基金业协会发布的各项法律法规和行政规章，公平对待所有客户，严格遵守内部制度，严格执行操作流程，严格执行操作分析，确保不同投资组合之间公平对待。

对于交易所场内场外投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在场内场外同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于柜台市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在柜台市场同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于银行间同业市场的投资活动，本公司遵循公平交易原则，通过系统对不同投资组合之间的交易时机和交易价格优先，对同一时段内不同投资组合中标的的价格和数量进行数据对比，执行公平交易原则。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异进行对比，向同向交易、反向交易的交易时机和交易时机选择分析，监察稽核部未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 平等对待原则的说明

报告期内，本公司继续贯彻执行证监会及基金业协会发布的各项法律法规和行政规章，公平对待所有客户，严格遵守内部制度，严格执行操作流程，严格执行操作分析，确保不同投资组合之间公平对待。

对于交易所场内场外投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在场内场外同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于柜台市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在柜台市场同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于银行间同业市场的投资活动，本公司遵循公平交易原则，通过系统对不同投资组合之间的交易时机和交易价格优先，对同一时段内不同投资组合中标的的价格和数量进行数据对比，执行公平交易原则。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异进行对比，向同向交易、反向交易的交易时机和交易时机选择分析，监察稽核部未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.3 公平交易执行的结果

报告期内，本公司继续贯彻执行证监会及基金业协会发布的各项法律法规和行政规章，公平对待所有客户，严格遵守内部制度，严格执行操作流程，严格执行操作分析，确保不同投资组合之间公平对待。

对于交易所场内场外投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在场内场外同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于柜台市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在柜台市场同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于银行间同业市场的投资活动，本公司遵循公平交易原则，通过系统对不同投资组合之间的交易时机和交易价格优先，对同一时段内不同投资组合中标的的价格和数量进行数据对比，执行公平交易原则。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异进行对比，向同向交易、反向交易的交易时机和交易时机选择分析，监察稽核部未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻执行证监会及基金业协会发布的各项法律法规和行政规章，公平对待所有客户，严格遵守内部制度，严格执行操作流程，严格执行操作分析，确保不同投资组合之间公平对待。

对于交易所场内场外投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在场内场外同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于柜台市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在柜台市场同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于银行间同业市场的投资活动，本公司遵循公平交易原则，通过系统对不同投资组合之间的交易时机和交易价格优先，对同一时段内不同投资组合中标的的价格和数量进行数据对比，执行公平交易原则。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异进行对比，向同向交易、反向交易的交易时机和交易时机选择分析，监察稽核部未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.5 公平交易执行的结果

报告期内，本公司继续贯彻执行证监会及基金业协会发布的各项法律法规和行政规章，公平对待所有客户，严格遵守内部制度，严格执行操作流程，严格执行操作分析，确保不同投资组合之间公平对待。

对于交易所场内场外投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在场内场外同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于柜台市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在柜台市场同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于银行间同业市场的投资活动，本公司遵循公平交易原则，通过系统对不同投资组合之间的交易时机和交易价格优先，对同一时段内不同投资组合中标的的价格和数量进行数据对比，执行公平交易原则。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异进行对比，向同向交易、反向交易的交易时机和交易时机选择分析，监察稽核部未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻执行证监会及基金业协会发布的各项法律法规和行政规章，公平对待所有客户，严格遵守内部制度，严格执行操作流程，严格执行操作分析，确保不同投资组合之间公平对待。

对于交易所场内场外投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在场内场外同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于柜台市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在柜台市场同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于银行间同业市场的投资活动，本公司遵循公平交易原则，通过系统对不同投资组合之间的交易时机和交易价格优先，对同一时段内不同投资组合中标的的价格和数量进行数据对比，执行公平交易原则。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异进行对比，向同向交易、反向交易的交易时机和交易时机选择分析，监察稽核部未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.7 公平交易执行的结果

报告期内，本公司继续贯彻执行证监会及基金业协会发布的各项法律法规和行政规章，公平对待所有客户，严格遵守内部制度，严格执行操作流程，严格执行操作分析，确保不同投资组合之间公平对待。

对于交易所场内场外投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在场内场外同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于柜台市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在柜台市场同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于银行间同业市场的投资活动，本公司遵循公平交易原则，通过系统对不同投资组合之间的交易时机和交易价格优先，对同一时段内不同投资组合中标的的价格和数量进行数据对比，执行公平交易原则。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异进行对比，向同向交易、反向交易的交易时机和交易时机选择分析，监察稽核部未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.8 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻执行证监会及基金业协会发布的各项法律法规和行政规章，公平对待所有客户，严格遵守内部制度，严格执行操作流程，严格执行操作分析，确保不同投资组合之间公平对待。

对于交易所场内场外投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在场内场外同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于柜台市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在柜台市场同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于银行间同业市场的投资活动，本公司遵循公平交易原则，通过系统对不同投资组合之间的交易时机和交易价格优先，对同一时段内不同投资组合中标的的价格和数量进行数据对比，执行公平交易原则。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异进行对比，向同向交易、反向交易的交易时机和交易时机选择分析，监察稽核部未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.9 公平交易执行的结果

报告期内，本公司继续贯彻执行证监会及基金业协会发布的各项法律法规和行政规章，公平对待所有客户，严格遵守内部制度，严格执行操作流程，严格执行操作分析，确保不同投资组合之间公平对待。

对于交易所场内场外投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在场内场外同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平分配。

对于柜台市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在柜台市场同时买卖同一券种时，按照时间优先、价格优先的原则在各投资组合间公平