

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  
报告送出日期:二〇一三年三月二十九日  
§ 1 重要提示

1.1 重要提示  
基金管理人的董事会、董事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。并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月28日对核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，复核该报告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚信实用、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。投资有风险，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及其更新。

本年度报告摘要自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	上投摩根中小盘股票型证券投资基金
基金主代码	379010
交易代码	379010
契约型开放式	
基金合同生效日	2009年1月21日
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	764,566,270.32份
基金合同存续状态	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于中国A股市场上的中小盘股票，通过精选的资产配置策略，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金充分借鉴摩根资产管理集团全球行之有效的投资理念和经验，运用“自下而上”精选个股与“自上而下”资产配置相结合的投资策略，重点投资于具有良好收益、公司治理和估值优势的上市公司的股票，同时调整配置债券等大类资产的比例。
业绩比较基准	40%×上证中盘指数收益率+40%×上证小盘指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金，在证券投资基金中属于较高风险品种，其预期收益水平和风险高于混合型基金和债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上投摩根基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	王雷	王雷
联系电话	021-38794999	010-67590596
电子邮箱	xiaohong@pmf-sitco.com	liaoxing@lhb.cs.ecb.com
客户服务电话	400-889-4888	010-67590596
传真	021-68881170	010-66275853

### 2.4 信息披露方式

基金基本信息报告书正文的管理人互联网网址	http://www.5fund.com
基金年度报告备查文件	基金管理人、基金托管人的办公场所

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年	2010年
本期初实现收益	-105,133,191.63	-167,750,840.13	118,555,557.77
本期利润	104,207,481.95	-382,328,900.03	56,949,038.21
加权平均基金份额本期利润	0.1322	-0.4587	0.0596
本期平均基金份额净增长率为	13.67%	-28.40%	4.56%

#### 3.1.2 期末数据和指标

3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	0.0875	0.1117	0.4233
期末基金资产净值	966,445,898.14	953,318,090.00	1,391,424,010.29
期末基金份额净值	1.264	1.122	1.553

#### 3.2 基金管理费收入以来净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期实现收益指基金本期总收益、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动损益。对期初可供分配利润,采用期末资产负债表中分配利润与未实现部分的孰低数。
2.上述基金绩效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、红利再投费、基金转换费等,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。
3.基金净值表现
4.3.2.1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

#### 3.2.1 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期实现收益指基金本期总收益、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动损益。对期初可供分配利润,采用期末资产负债表中分配利润与未实现部分的孰低数。
2.上述基金绩效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、红利再投费、基金转换费等,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。
3.基金净值表现
4.3.2.1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

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期实现收益指基金本期总收益、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动损益。对期初可供分配利润,采用期末资产负债表中分配利润与未实现部分的孰低数。
2.上述基金绩效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、红利再投费、基金转换费等,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。
3.基金净值表现
4.3.2.1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

#### 3.2.3 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期实现收益指基金本期总收益、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动损益。对期初可供分配利润,采用期末资产负债表中分配利润与未实现部分的孰低数。
2.上述基金绩效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、红利再投费、基金转换费等,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。
3.基金净值表现
4.3.2.1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

#### 3.2.4 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期实现收益指基金本期总收益、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动损益。对期初可供分配利润,采用期末资产负债表中分配利润与未实现部分的孰低数。
2.上述基金绩效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、红利再投费、基金转换费等,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。
3.基金净值表现
4.3.2.1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

#### 3.2.5 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期实现收益指基金本期总收益、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动损益。对期初可供分配利润,采用期末资产负债表中分配利润与未实现部分的孰低数。
2.上述基金绩效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、红利再投费、基金转换费等,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。
3.基金净值表现
4.3.2.1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

#### 3.2.6 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期实现收益指基金本期总收益、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动损益。对期初可供分配利润,采用期末资产负债表中分配利润与未实现部分的孰低数。
2.上述基金绩效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、红利再投费、基金转换费等,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。
3.基金净值表现
4.3.2.1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

#### 3.2.7 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期实现收益指基金本期总收益、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动损益。对期初可供分配利润,采用期末资产负债表中分配利润与未实现部分的孰低数。
2.上述基金绩效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、红利再投费、基金转换费等,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。
3.基金净值表现
4.3.2.1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

#### 3.2.8 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较