

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:二〇一二年十月二十四日

基金管理人及基金托管人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责任。

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2012年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、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预示其未来表现。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。

本报告中财务资料未经审计。
 本报告自2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	上投摩根强化回报债券
基金代码	377020
交易方式	377020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2011年8月10日
报告期末基金份额总额	155,709,195.03份
投资策略	本基金在“积极配置固定收益资产”和“适度参与权益资产”的基础上,通过主动管理,力争取得超越业绩比较基准的投资收益,实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金投资于可定期存款类金融工具主动管理,力争取得超越的债券投资收益。此外,本基金还将对符合估值条件的股票进行择机配置,力争取得超越的权益投资收益。本基金在严格控制风险的前提下,力争取得超越的基金投资收益。
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
上投摩根基金总部	上海浦东新区世纪大道1600号1602A室
上海地区总部	377020
报告期末前两大销售机构的名称	80,273,857.52份 75,435,337.51份

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	849,501.45
2.本期利润	-1,300,032.40
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0088
4.期末基金份额净值	84.54,212.46
5.期末基金资产净值	78,961,512.09
6.期末基金资产净值增长率	1.052
7.期末基金份额净值增长率	1.052

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不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、红利再投资费、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 本报告期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
过去三个月	-1.31%	0.30%	0.09%	0.04%	-1.40%	0.26%
过去六个月	-3.16%	0.30%	0.09%	0.04%	-3.25%	0.26%
过去一年	-1.41%	0.30%	0.09%	0.04%	-1.50%	0.26%

3.2.2 自基金合同生效以来基金基金份额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

上投摩根强化回报债券证券投资基金基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2011年8月10日至2012年9月30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
 报告送出日期:二〇一二年十月二十四日

基金管理人及基金托管人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责任。

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2012年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、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预示其未来表现。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。

本报告中财务资料未经审计。
 本报告自2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	上投摩根内需动力股票
基金代码	377020
交易方式	377020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2007年4月13日
报告期末基金份额总额	7,000,491,476.51份
投资策略	本基金重点投资于国内增长潜力具有竞争优势的上市公司,把握中国经济和行业发展周期带来的投资机会,追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-249,222,064.85
2.本期利润	-112,853,714.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0160
4.期末基金份额净值	6,115,097,589.55
5.期末基金资产净值	8,735

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不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、红利再投资费、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 本报告期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
过去三个月	-1.82%	1.02%	-5.31%	0.95%	3.49%	0.07%
过去六个月	-3.21%	1.13%	-5.70%	1.01%	3.48%	0.12%
过去一年	-2.22%	1.13%	-5.70%	1.01%	3.48%	0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金基金份额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

上投摩根内需动力股票证券投资基金基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2007年4月13日至2012年9月30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
 报告送出日期:二〇一二年十月二十四日

基金管理人及基金托管人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责任。

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2012年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、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预示其未来表现。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。

本报告中财务资料未经审计。
 本报告自2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	上投摩根健康品质生活
基金代码	377150
交易方式	377150
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2012年2月1日
报告期末基金份额总额	83,455,043.91份
投资策略	本基金主要投资于有利于提升国民健康水平和生活品质的行业及公司,力争把握经济结构调整和消费升级所带来的投资机会。在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	1,869,982.32
2.本期利润	-869,527.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0139
4.期末基金份额净值	88,249,875.59
5.期末基金资产净值	1,057

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不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、红利再投资费、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 本报告期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
过去三个月	-2.22%	1.13%	-5.70%	1.01%	3.48%	0.12%
过去六个月	-3.21%	1.13%	-5.70%	1.01%	3.48%	0.12%
过去一年	-2.22%	1.13%	-5.70%	1.01%	3.48%	0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金基金份额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

上投摩根健康品质生活股票证券投资基金基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2012年2月1日至2012年9月30日)

上投摩根强化回报债券证券投资基金



§4 管理人报告

注:本基金建仓自2011年8月10日至2012年2月9日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

本基金合同生效日为2011年8月10日,图示时段为2011年8月10日至2012年9月30日。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	23,224,517.13	10.84
1.1	其中:股票	23,224,517.13	10.84
2	固定收益投资	184,085,494.43	85.93
3	其中:债券	184,085,494.43	85.93
4	资产支持证券	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	2,131,919.47	1.00
6	其他各项资产	4,797,196.56	2.24
7	合计	214,239,127.59	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采掘业	-	-
C0	食品饮料	15,252,798.45	9.33
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	9,981,780.11	6.11
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪器	-	-
C8	医药、生物制品	5,271,018.34	3.23
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水生产和供应业	960,261.00	0.59
E	交通运输、仓储业	-	-
F	信息技术业	7,011,457.68	4.29
G	房地产业	-	-
H	公用事业	-	-
I	金融业	-	-
J	其他服务业	-	-
M	综合类	-	-
合计		23,224,517.13	14.21

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

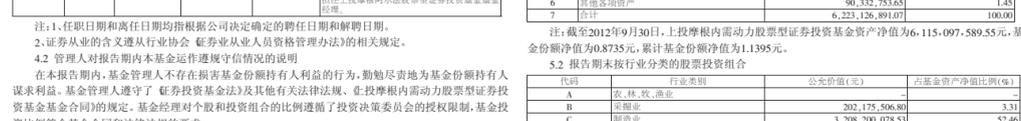
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002236	大冷股份	143,449	5,581,409.00	3.60
2	600518	康美药业	333,187	5,271,018.34	3.23
3	002241	康强药业	109,959	4,100,371.11	2.51
4	002245	安利科技	60,000	3,110,400.00	1.98
5	600406	国电南瑞	169,942	3,014,771.08	1.84
6	600111	华冠国际	151,700	960,261.00	0.59
7	002253	天富能源	33,508	886,286.60	0.54

§4 管理人报告

注:本基金建仓自2011年8月10日至2012年2月9日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

本基金合同生效日为2011年8月10日,图示时段为2011年8月10日至2012年9月30日。

上投摩根内需动力股票证券投资基金



§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,298,453,989.21	85.14
1.1	其中:股票	5,298,453,989.21	85.14
2	固定收益投资	96,670,000.00	1.58
3	其中:债券	96,670,000.00	1.58
4	资产支持证券	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	370,990,848.16	5.96
6	其他各项资产	90,332,753.63	1.45
7	合计	6,223,126,891.07	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

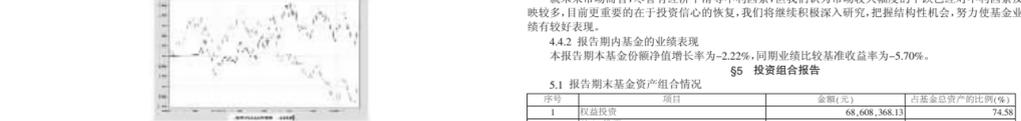
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	202,175,506.80	3.31
B	采掘业	3,208,200,078.53	52.46
C0	食品饮料	143,232,510.88	2.34
C1	纺织、服装、皮毛	186,464,311.71	3.05
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,268,373.02	0.10
C5	电子	861,785,117.48	14.09
C6	金属、非金属	70,290,000.00	1.15
C7	机械、设备、仪器	743,450,823.88	12.16
C8	医药、生物制品	1,196,709,503.08	19.57
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水生产和供应业	45,576,000.00	0.75
E	交通运输、仓储业	49,522,576.00	0.81
F	信息技术业	617,713,699.38	10.10
G	房地产业	416,519,263.17	6.81
H	公用事业	838,800.00	0.01
I	金融业	400,784,201.00	6.55
J	其他服务业	280,443,364.25	4.50
K	文化传播业	76,680,000.00	1.25
M	综合类	-	-
合计		5,298,453,989.21	86.65

§4 管理人报告

注:本基金建仓自2007年4月13日至2007年10月12日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

本基金合同生效日为2007年4月13日,图示时段为2007年4月13日至2012年9月30日。

上投摩根健康品质生活股票证券投资基金



§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	68,608,368.13	74.58
1.1	其中:股票	68,608,368.13	74.58
2	固定收益投资	-	-
3	其中:债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	20,134,179.93	21.89
6	其他各项资产	2,582,932.00	2.84
7	合计	91,295,480.06	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	45,684,155.08	51.72
B	采掘业	12,403,300.89	14.05
C0	食品饮料	6,892,115.53	7.81
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	466,900.00	0.53
C5	电子	6,270,177.00	7.11
C6	金属、非金属	421,360.00	0.48
C7	机械、设备、仪器	3,491,087.00	3.98
C8	医药、生物制品	15,740,154.18	17.84
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水生产和供应业	-	-
E	交通运输、仓储业	5,115,974.85	5.80
F	信息技术业	4,176,485.92	4.73
G	房地产业	3,620,301.96	4.10
H	公用事业	5,592,525.19	6.35
I	金融业	4,720,442.01	5.30
K	文化传播业	713,412.00	0.81
L	社会服务业	-	-
M	综合类	-	-
合计		68,608,368.13	77.74

§4 管理人报告

注:本基金建仓自2012年2月1日至2012年7月31日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

本基金合同生效日为2012年2月1日,截至报告期末本基金合同生效满一周年。

本基金建仓自2012年2月1日至2012年7月31日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	229,230	23,222,930.00	14.21
2	1101088	11央行票88	200,000	19,334,000.00	11.83
3	110018	国电转债	140,000	14,677,600.00	8.98
4	110013	国电转债	140,000	14,534,800.00	8.89
5	041161016	11央行01016	100,000	10,148,000.00	6.21

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,599.18
2	应收证券清算款	1,601,655.57
3	应收股利	-
4	应收利息	2,740,964.69
5	应收申购款	444,597.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,797,196.56

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	23,222,930.00	14.21
2	110018	国电转债	14,677,600.00	8.98
3	110013	国电转债	14,534,800.00	8.89
4	120031	中航转债	4,002,548.00	2.43
5	110016	国电转债	2,211,235.80	1.35
6	125731	汇丰转债	1,094,609.00	0.60
7	110007	国电转债	1,010,800.00	0.60
8	110015	石化转债	973.00	0.00
9	110001	中行转债	961.60	0.00
10	125887	国电转债	104.94	0.00

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	受限原因
1	600406	国电南瑞	3,014,771.08	1.84	筹划资产重组事宜

注:本基金截至2012年9月30日止持有的因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票在公布事项的严重影响消除后,经交易所批准复牌。本基金本报告期末其他前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

项目	上投摩根强化回报债券 A类	上投摩根强化回报债券 B类
本报告期初基金份额总额	91,346,141.08	88,938,177.65
本报告期间基金申购份额	19,039,047.61	15,295,332.20
本报告期间基金赎回份额	10,111,331.17	29,428,163.34
本报告期末基金份额总额	80,273,857.52	75,435,337.51

§7 备查文件目录

7.1.1 中国证监会批准上投摩根强化回报债券证券投资基金设立的文件;

7.1.2 《上投摩根强化回报债券证券投资基金合同》;

7.1.3 《上投摩根强化回报债券证券投资基金托管协议》;

7.1.4 《上投摩根开放式基金业务规则》;

7.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照;

7.1.6 基金托管人业务资格批件和营业执照;

7.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司
 二〇一二年十月二十四日