

## 上投摩根阿尔法股票型证券投资基金

## [2013] 年度报告摘要

2013 年度报告摘要

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  
基金合同生效日期：2013年1月11日  
基金类型：股票型证券投资基金  
基金简称：上投摩根阿尔法股票  
基金代码：370000  
交易代码：370010  
契约型开放式  
基金的首次开放日：2006年10月11日  
基金的管理人：上投摩根基金管理有限公司  
基金的托管人：中国建设银行股份有限公司  
报告期截至基金份额总额：1,097,889,777.88份  
基金合同存续期间：不定期

§ 2 基金简介

上投摩根阿尔法股票  
370000  
370010  
契约型开放式  
2006年10月11日  
上投摩根基金管理有限公司  
中国建设银行股份有限公司  
1,097,889,777.88份  
不定期

本基金采用成长式投资技术(Barbell Approach)，同时以“成长”与“价值”双重指标进行股票选择。在基于以上两种选股风格的集中度中，精选个股、纪律执行、构造相对均衡的不风格类资产组合，同时结合公司质量、行业布局、风险因子等深入分析，对资产配置进行适度调整，努力控制投资组合的市场适应性，以求在不同环境中都创造超越业绩基准的主动管理。

本基金主要投资于具有良好基本面的股票，投资者欲了解详细情况的，请阅读基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要不替代年度报告，投资者欲了解详细情况的，请阅读年度报告全文。

报告期截至日：2013年1月11日起至2013年1月10日止

§ 3 基金基本情况

基金名称：上投摩根阿尔法股票  
基金代码：370000  
交易代码：370010  
基金运作方式：契约型开放式  
基金的首次开放日：2006年10月11日  
基金的管理人：上投摩根基金管理有限公司  
基金的托管人：中国建设银行股份有限公司  
报告期截至基金份额总额：1,097,889,777.88份  
基金合同存续期间：不定期

本基金采用成长式投资技术(Barbell Approach)，同时以“成长”与“价值”双重指标进行股票选择。在基于以上两种选股风格的集中度中，精选个股、纪律执行、构造相对均衡的不风格类资产组合，同时结合公司质量、行业布局、风险因子等深入分析，对资产配置进行适度调整，努力控制投资组合的市场适应性，以求在不同环境中都创造超越业绩基准的主动管理。

本基金主要投资于具有良好基本面的股票，投资者欲了解详细情况的，请阅读基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要不替代年度报告，投资者欲了解详细情况的，请阅读年度报告全文。

报告期截至日：2013年1月11日起至2013年1月10日止

§ 4 基金产品概况

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技术，

依据中国资本市场的真实特征，引入集海外市场成功运作的

“Dynamic Fund”基本产品概念。具体而言，本基金将指数化分析为

基础，通过严格的投资筛选，积极构造并保持优化“哑铃”资产组合，

结合智能的风险监控，不断评估和优化基于此基础的稳定性回报。

业绩比较基准：沪深300指数收益率×80%+同业存款利率×2%

风险收益特征：本基金是股票型证券投资基金，属于股票投资基金中较高风险、较高收益的基金产品。

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

信息披露义务人 胡进宇

联系电话 021-38794888 010-67595096

客户服务电话 400-889-4888 010-67595096

传真 021-20628400 010-66775853

登载基金半年报正文的管理人互联网网址 http://www.cifm.com

基金年度报告备置地点 基金管理人、基金托管人的办公场所

§ 5 主要财务数据、净值表现及利润分配情况

金额单位：人民币元

3.1 主要财务数据和财务指标

2013 年度 2012 年度 2011 年度

本期已实现收益 217,170,062.41 -683,599,706.87 -704,049,636,76

本期利润 262,066,927.75 -210,388,246.60 -1,328,653,805.67

加权平均基金份额本期利润 0.2422 -0.1463 -0.0235

本期基金份额净值增长率 10.75% -7.1% -28.71%

3.1.2 前期数据和指标

2013 年末 2012 年末 2011 年末

期末可供分配基金份额利润 0.5903 0.4036 0.8840

期末基金资产净值 2,535,980,466.89 2,884,804,423.89 3,512,682,909.22

期末基金份额净值 2.9086 2.0856 2.2467

注：1.本公司定期披露基金申购赎回情况，投资人以其申购赎回的日期计算其申购赎回的日期。

2.本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用、基金转换费、基金申购赎回费等），计算基金份额净值时不会扣除上述费用的影响。

3.2 本期份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.1 本期份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.2 本期基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.3 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.4 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.5 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.6 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.7 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.8 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.9 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.10 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.11 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.12 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.13 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.14 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.15 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.16 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.17 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.18 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.19 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.20 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.21 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.22 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.23 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.24 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.25 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.26 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.27 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.28 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.29 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.30 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.31 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.32 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.33 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.34 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.35 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.36 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.37 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.38 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.39 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.40 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.41 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.42 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.43 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.44 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.45 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.46 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.47 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.48 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.49 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.50 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.51 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.52 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.53 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.54 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.55 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.56 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.57 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.58 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.59 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.60 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.61 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.62 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.63 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.64 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.65 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.66 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.67 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.68 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.69 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.70 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.71 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.72 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.73 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.74 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.75 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.76 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.77 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.78 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.79 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.80 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.81 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.82 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.83 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.84 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.85 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.86 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.87 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.88 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.89 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明

3.2.90 本基金份额净值增长率和本期利润的简要说明