

上投摩根阿尔法股票型证券投资基金 2009年半年度报告摘要

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
送出日期:2009年8月25日
1.1 重要提示
基金管理人及董事监事高级管理人员不存在虚假记载、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。

2.1 基金基本情况
基金名称:上投摩根阿尔法股票
基金代码:377010
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2005年10月11日
报告期末基金份额总额:1,352,046,240.64份
2.2 基金产品说明
投资目标:本基金采用相对收益投资策略(Relative Approach),即以"成长"与"价值"双维度对股票进行选择和配置。

2.3 基金管理人及基金托管人
名称:上投摩根基金管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路501号
法定代表人:陈兵
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
基金托管人住所:北京市西城区金融大街25号
基金托管人法定代表人:王洪章

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 本期数据和指标
3.1.2 期末数据和指标
3.1.3 累计期末指标
3.2 基金业绩评价
3.2.1 基金业绩评价
3.2.2 基金业绩评价

Table with 3 columns: Item, 2009年1月1日至2009年6月30日, 2008年12月31日. Rows include 净资产、总资产、负债、所有者权益等.

Table with 4 columns: 阶段, 份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, 业绩偏离度. Rows include 过去一个月, 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 过去三年, 过去五年, 成立以来.

4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
4.1.2 基金经理情况
4.2 基金投资组合
4.2.1 基金投资组合
4.2.2 基金投资组合

Table with 4 columns: 项目, 2009年1月1日至2009年6月30日, 2008年12月31日, 上年度可比期间. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, 四、净利润, 五、所有者权益.

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任期日期, 说明. Rows include 孙蔚群, 周晓文, 李季德.

注:1.在职日期和离任日期指公司作出决定后正式对外公告之日,其中孙蔚群先生于2009年7月5日因病逝世,管理于2009年7月6日发布上投摩根基金管理有限公司关于基金基金经理变更的公告;
2.证券从业的含通过行业协会《证券业从业人员资格考试》取得从业资格的相关人员;
3.管理人对报告期内本基金运作遵守信义原则的情况说明;
4.2 基金投资组合
4.2.1 基金投资组合
4.2.2 基金投资组合

配置问题,起到了一定的效果。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望下半年,我们正思考政策导向会如何,基本面有哪些可能超预期的,哪些行业被低估了,哪些行业的估值出现泡沫化了,是进一步深入的进入了解市场趋势并寻找趋势之间的背离,应该是我们下半年获取超额的机会所在。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
本公司的基金估值和会计核算由基金会计负责,根据相关的法律法规规定,基金合同的约定,制定了内部估值措施,对基金估值和会计核算的各个环节和重要流程进行风险控制,目的是保证基金估值和会计核算的准确性。

5.1 报告期内本基金托管人遵守信义原则的情况说明
5.2 基金托管人对基金管理人的投资运作行为的监督报告
5.3 托管人对本报告期内基金投资运作、净值计算、利润分配等情况的说明
5.4 基金托管人对基金管理人投资运作的监督报告

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 资产, 负债, 所有者权益, 流动资产, 非流动资产, 金融资产, 非金融资产, 应收利息, 应付利息, 其他资产, 其他负债, 资产总计, 负债和所有者权益.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期, 上年度可比期间. Rows include 当期应支付的托管费, 其中:当期已支付, 期末应付托管费, 当期应支付的基金管理费, 其中:当期已支付, 期末应付基金管理费, 当期应支付的基金托管费, 其中:当期已支付, 期末应付基金托管费, 当期应支付的基金销售服务费, 其中:当期已支付, 期末应付基金销售服务费, 当期应支付的基金赎回费, 其中:当期已支付, 期末应付基金赎回费, 当期应支付的基金申购费, 其中:当期已支付, 期末应付基金申购费, 当期应支付的基金赎回费, 其中:当期已支付, 期末应付基金赎回费, 当期应支付的基金申购费, 其中:当期已支付, 期末应付基金申购费.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期, 上年度可比期间. Rows include 当期应支付的托管费, 其中:当期已支付, 期末应付托管费, 当期应支付的基金管理费, 其中:当期已支付, 期末应付基金管理费, 当期应支付的基金托管费, 其中:当期已支付, 期末应付基金托管费, 当期应支付的基金销售服务费, 其中:当期已支付, 期末应付基金销售服务费, 当期应支付的基金赎回费, 其中:当期已支付, 期末应付基金赎回费, 当期应支付的基金申购费, 其中:当期已支付, 期末应付基金申购费.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期, 上年度可比期间. Rows include 当期应支付的托管费, 其中:当期已支付, 期末应付托管费, 当期应支付的基金管理费, 其中:当期已支付, 期末应付基金管理费, 当期应支付的基金托管费, 其中:当期已支付, 期末应付基金托管费, 当期应支付的基金销售服务费, 其中:当期已支付, 期末应付基金销售服务费, 当期应支付的基金赎回费, 其中:当期已支付, 期末应付基金赎回费, 当期应支付的基金申购费, 其中:当期已支付, 期末应付基金申购费.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期, 上年度可比期间. Rows include 当期应支付的托管费, 其中:当期已支付, 期末应付托管费, 当期应支付的基金管理费, 其中:当期已支付, 期末应付基金管理费, 当期应支付的基金托管费, 其中:当期已支付, 期末应付基金托管费, 当期应支付的基金销售服务费, 其中:当期已支付, 期末应付基金销售服务费, 当期应支付的基金赎回费, 其中:当期已支付, 期末应付基金赎回费, 当期应支付的基金申购费, 其中:当期已支付, 期末应付基金申购费.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期, 上年度可比期间. Rows include 当期应支付的托管费, 其中:当期已支付, 期末应付托管费, 当期应支付的基金管理费, 其中:当期已支付, 期末应付基金管理费, 当期应支付的基金托管费, 其中:当期已支付, 期末应付基金托管费, 当期应支付的基金销售服务费, 其中:当期已支付, 期末应付基金销售服务费, 当期应支付的基金赎回费, 其中:当期已支付, 期末应付基金赎回费, 当期应支付的基金申购费, 其中:当期已支付, 期末应付基金申购费.

6.1 基金基本情况
6.2 基金投资组合
6.3 基金投资组合
6.4 基金投资组合
6.5 基金投资组合
6.6 基金投资组合
6.7 基金投资组合
6.8 基金投资组合
6.9 基金投资组合
6.10 基金投资组合
6.11 基金投资组合
6.12 基金投资组合
6.13 基金投资组合
6.14 基金投资组合

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。
6.4.5.1 会计政策变更的说明
无。
6.4.5.2 会计估计变更的说明
无。
6.4.5.3 差错更正的说明
无。
6.4.6 税项
根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》,财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》,财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关法规和实务操作,主要税项列示如下:
0 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。
0 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
0 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂按减持50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。
0 基金买卖股票于2008年4月24日之前按照0.3%的税率缴纳印花税,自2008年4月24日起至2008年9月18日止按0.1%的税率缴纳,自2008年9月19日起基金卖出股票按0.1%的税率缴纳印花税,买入股票不征收印花税。
0 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

Table with 2 columns: 关联方名称, 与本公司的关系. Rows include 上投摩根基金管理有限公司, 中国建设银行股份有限公司, 摩根士丹利资产管理(美国)有限公司, 上海浦东发展银行股份有限公司, J.P. Morgan Investment Management Limited, J.P. Morgan Asset Management (London) Limited, J.P. Morgan Asset Management (Real Estate) Limited.

注:1.关联方名称"就"买入股票成本","卖出金额"就"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交价款或成交数量乘以成交金额)计算,不考虑相关交易费用。
7.1 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.1 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.2 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.3 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.4 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.6 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.7 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.8 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.9 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.10 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期, 上年度可比期间. Rows include 当期应支付的托管费, 其中:当期已支付, 期末应付托管费, 当期应支付的基金管理费, 其中:当期已支付, 期末应付基金管理费, 当期应支付的基金托管费, 其中:当期已支付, 期末应付基金托管费, 当期应支付的基金销售服务费, 其中:当期已支付, 期末应付基金销售服务费, 当期应支付的基金赎回费, 其中:当期已支付, 期末应付基金赎回费, 当期应支付的基金申购费, 其中:当期已支付, 期末应付基金申购费.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期, 上年度可比期间. Rows include 当期应支付的托管费, 其中:当期已支付, 期末应付托管费, 当期应支付的基金管理费, 其中:当期已支付, 期末应付基金管理费, 当期应支付的基金托管费, 其中:当期已支付, 期末应付基金托管费, 当期应支付的基金销售服务费, 其中:当期已支付, 期末应付基金销售服务费, 当期应支付的基金赎回费, 其中:当期已支付, 期末应付基金赎回费, 当期应支付的基金申购费, 其中:当期已支付, 期末应付基金申购费.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期, 上年度可比期间. Rows include 当期应支付的托管费, 其中:当期已支付, 期末应付托管费, 当期应支付的基金管理费, 其中:当期已支付, 期末应付基金管理费, 当期应支付的基金托管费, 其中:当期已支付, 期末应付基金托管费, 当期应支付的基金销售服务费, 其中:当期已支付, 期末应付基金销售服务费, 当期应支付的基金赎回费, 其中:当期已支付, 期末应付基金赎回费, 当期应支付的基金申购费, 其中:当期已支付, 期末应付基金申购费.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期, 上年度可比期间. Rows include 当期应支付的托管费, 其中:当期已支付, 期末应付托管费, 当期应支付的基金管理费, 其中:当期已支付, 期末应付基金管理费, 当期应支付的基金托管费, 其中:当期已支付, 期末应付基金托管费, 当期应支付的基金销售服务费, 其中:当期已支付, 期末应付基金销售服务费, 当期应支付的基金赎回费, 其中:当期已支付, 期末应付基金赎回费, 当期应支付的基金申购费, 其中:当期已支付, 期末应付基金申购费.

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期, 上年度可比期间. Rows include 当期应支付的托管费, 其中:当期已支付, 期末应付托管费, 当期应支付的基金管理费, 其中:当期已支付, 期末应付基金管理费, 当期应支付的基金托管费, 其中:当期已支付, 期末应付基金托管费, 当期应支付的基金销售服务费, 其中:当期已支付, 期末应付基金销售服务费, 当期应支付的基金赎回费, 其中:当期已支付, 期末应付基金赎回费, 当期应支付的基金申购费, 其中:当期已支付, 期末应付基金申购费.

注:1.关联方名称"就"买入股票成本","卖出金额"就"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交价款或成交数量乘以成交金额)计算,不考虑相关交易费用。
7.1 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.1 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.2 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.3 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.4 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.6 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.7 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.8 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.9 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.1.10 期末按债券品种分类的债券投资组合