上投摩根中小盘股票型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6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：二〇一一年八月二十五日

1 重要提示及目录

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。本半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2011年8月24日复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，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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至6月30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
基金主代码	379010
交易代码	379010
基金运作方式	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	798,862,682.84份
基金合同存续期	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，通过缜密的资产配置原则和严格的行业个股选择，分享中国经济高速增长给优势中小市值上市公司带来的机遇，并积极运用战略和战术资产配置策略，动态优化投资组合，力求实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金充分借鉴摩根富林明资产管理集团全球行之有效的投资理念和技术，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，重点投资于具有行业优势、公司优势和估值优势的中小市值上市公司股票。同时结合市场研判，对相关资产类别的预期收益进行监控，动态调整股票、债券等大类资产配置。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：40%×天相中盘指数收益率+40%×天相小盘指数收益率+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	姓名	洪霞	尹东
	联系电话	021-38794999	010-67595003
	电子邮箱	xia.hong@jpmf-sitico.com	yindong@ccb.cn
客户服务电话		400-889-4888	010-67595096
传真		021-68881170	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.51fund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011年1月1日至2011年6月30日）
本期利润	-155,491,614.74
加权平均基金份额本期利润	-0.1889
本期加权平均净值利润率	-13.20%
本期基金份额净值增长率	-11.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2011年6月30日）
期末可供分配基金份额利润	0.3457
期末基金资产净值	1,096,064,208.78
期末基金份额净值	1.372

注：

1.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。对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

2.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基金净值表现

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

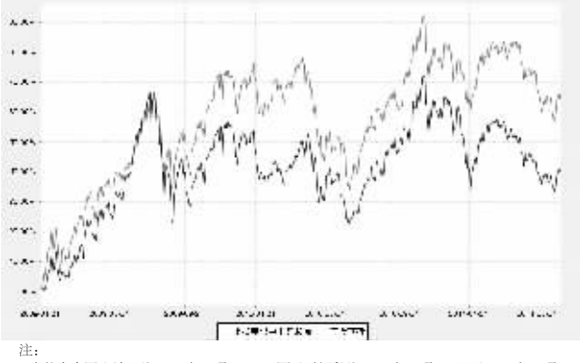
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.46%	0.99%	2.36%	1.05%	0.10%	-0.06%
过去三个月	-6.54%	1.02%	-5.45%	0.99%	-1.09%	0.03%
过去六个月	-11.65%	1.29%	-3.88%	1.06%	-7.77%	0.23%
过去一年	13.11%	1.43%	20.30%	1.19%	-7.19%	0.24%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	41.33%	1.62%	66.68%	1.44%	-25.35%	0.18%

注：

本基金的业绩比较基准为：40%×天相中盘指数收益率+40%×天相小盘指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

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

上投摩根中小盘股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2009年1月21日至2011年6月30日）



注：

1.本基金合同生效日为2009年1月21日。图示时间段为2009年1月21日至2011年6月30日。

2.本基金建仓期自2009年1月21日至2009年7月20日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

4 管理人报告

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

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于2004年5月12日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007年10月8日更名为“上海国际信托有限公司”）与摩根富林明资产管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为2.5亿元人民币，注册地上海。截至2011年6月底，公司管理的基金共有十三只，均为开放式基金，分别是：上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根阿尔法股票型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋股票型证券投资基金、上投摩根内需动力股票型证券投资基金、上投摩根亚太优势股票型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘股票型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金和上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
董红波	本基金基金经理	2009-1-21	-	8年	管理学硕士，曾任职于中华全国供销合作总社监察局及办公厅、中国平安人寿上海分公司战略发展部，2004年进入泰信基金管理公司，先后担任研究部副经理、泰信先行策略基金经理助理，2007年1月至2008年6月担任泰信先行策略基金经理，2008年7月加入上投摩根基金管理有限公司。2009年1月起担任上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金经理。
王振州	本基金基金经理	2009-1-21	-	9年	中原大学电子电机学士，企业管理硕士；2002年3月至2004年5月任宝来证券国际金融集团高级研究员；2004年5月至2007年1月，任职于日盛证券投资信托股份有限公司，担任日盛美亚高科技基金及日盛小而美基金基金经理；2007年1月至2007年9月任元大证券投资信托股份有限公司元大双盈基金基金经理。2007年9月加入上投摩根基金管理有限公司。2007年11月至2008年11月任上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金经理，自2008年11月起任上投摩根中国优势证券投资基金基金经理，自2009年1月起任上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金经理，自2009年10月起同时担任上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金经理。

注：

1.董红波先生和王振州先生为本基金首任基金经理，其任职日期均指本基金基金合同生效之日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业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遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人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求利益。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人建立了完善的公平交易制度，确保不同基金在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。交易系统中默认使用公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行委托。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

为更好的贯彻落实公平交易制度指导意见的相关精神，公司于2009年委托外部专业机构共同制定了公司投资组合投资风格分类办法，并自2009年起对旗下管理的投资组合投资风格的划分情况进行定期审阅。本年度，公司已组织相关业务部门及外部专业机构共同审阅了前述公司投资组合投资风格分类办法，并认为现阶段该方法仍旧适当，无需进一步修订。公司沿用前述分类办法，组织相关业务部门及外部专业机构共同开展了2011年度投资组合投资风格的划分工作，并将分类结果作为本年度投资组合定期报告中相关披露内容的依据。

本年度，根据公司内部和外部专业机构的评价结果，本基金管理人旗下无与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金无异常交易行为。

4.4管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年上半年，市场震荡走低，国家收缩流动性导致资金的压力以及对于宏观经济悲观的预期是主要原因，高估值板块及周期性行业等跌幅较大。

本基金一月份未能及时结构调整降低中小市值股票配置是导致亏损主要来源，后期随着对基金结构进行调整，业绩表现有所改善。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为-11.65%，同期业绩比较基准收益率为-3.88%。

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2011年下半年市场，我们认为通胀水平及运行趋势是影响国家政策乃至市场发展的最关键因素，我们对于下半年市场短期持谨慎态度，但看好市场在如此低估值水平下未来的发展空间，目前更主要是积极研究储备长期具有持续成长公司为未来投资进行准备。

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部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员，参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未实施利润分配。

5 托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1资产负债表

会计主体：上投摩根中小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2011年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	171,844,037.45	82,610,711.43
结算备付金		2,349,872.31	7,380,625.58
存出保证金		1,974,700.16	1,457,869.46
交易性金融资产	6.4.7.2	923,461,668.73	1,299,203,489.50
其中：股票投资		923,461,668.73	1,299,203,489.50
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	7,932,892.35
应收利息	6.4.7.5	48,186.26	25,188.30
应收股利		700,200.00	-
应收申购款		659,858.73	1,314,170.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,101,038,523.64	1,399,924,947.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,547,480.71
应付赎回款		1,058,419.32	843,413.62
应付管理人报酬		1,318,342.05	1,918,214.62
应付托管费		219,723.68	319,702.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,913,796.13	3,219,500.05
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	464,033.68	652,625.76
负债合计		4,974,314.86	8,500,937.21
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	798,862,682.84	895,728,944.53
未分配利润	6.4.7.10	297,201,525.94	495,695,065.76
所有者权益合计		1,096,064,208.78	1,391,424,010.29
负债和所有者权益总计		1,101,038,523.64	1,399,924,947.50

注：报告截止日2011年6月30日，基金份额净值为1.372元，基金份额总额798,862,682.84份。

6.2利润表

会计主体：上投摩根中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
一、收入		-136,906,254.86	-244,148,586.99
1.利息收入		774,120.09	1,196,759.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	774,120.09	939,062.87
债券利息收入		-	257,696.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-45,669,884.99	-23,325,181.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-49,147,608.20	-27,068,745.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	547,252.44
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	3,477,723.21	3,196,311.97
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-92,366,231.63	-222,437,937.42
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	355,741.67	417,772.16
减：二、费用		18,585,359.88	20,444,555.93
1.管理人报酬		8,780,380.89	9,643,972.21
2.托管费		1,463,396.77	1,607,328.72
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	8,126,576.91	8,970,257.58
5.利息支出		-	6,930.13
其中：卖出回购金融资产支出		-	6,930.13
6.其他费用	6.4.7.19	215,005.31	216,067.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-155,491,614.74	-264,593,142.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-155,491,614.74	-264,593,142.92

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	895,728,944.53	495,695,065.76	1,391,424,010.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-155,491,614.74	-155,491,614.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-96,866,261.69	-43,001,925.08	-139,868,186.77
其中：1.基金申购款	131,430,394.47	55,806,501.76	187,236,896.23
2.基金赎回款	-228,296,656.16	-98,808,426.84	-327,105,083.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	798,862,682.84	297,201,525.94	1,096,064,208.78
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	968,883,824.64	513,143,970.39	1,482,027,795.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-264,593,142.92	-264,593,142.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	36,451,305.73	2,130,837.58	38,582,143.31
其中：1.基金申购款	281,079,036.66	102,661,869.44	383,740,906.10
2.基金赎回款	-244,627,730.93	-100,531,031.86	-345,158,762.79
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-36,576,578.71	-36,576,578.71
五、期末所有者权益（基金净值）	1,005,335,130.37	214,105,086.34	1,219,440,216.71

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：章硕麟，主管会计工作负责人：胡志强，会计机构负责人：罗嘉

6.4报表附注

6.4.1 基金基本情况

上投摩根中小盘股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2008〕1316号《关于核准上投摩根中小盘股票型证券投资基金募集的批复》核准，由上投摩根基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为2008年12月22日至2009年1月16日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集825,940,005.46元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2009）第015号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金合同》于2009年1月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为826,057,598.05份基金份额，其中认购资金利息折合117,592.59份基金份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的A股、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金投资组合中股票投资的比例范围为基金资产的60%-95%，债券、权证、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为5%-40%，并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金将不低于80%的股票资产投资于中小盘股票。本基金的业绩比较基准为：天相中盘指数收益率×40%+天相小盘指数收益率×40%+上证国债指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于2011年8月24日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告〔2010〕5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2011年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2011年6月30日的财务状况以及2011年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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的说明

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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〕107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）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。

（2）基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

（3）对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金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。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

（4）基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上投摩根基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,780,380.89	9,643,972.21
其中：支付销售机构的客户维护费	1,414,421.83	1,152,779.39

注：支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%／当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,463,396.77	1,607,328.72

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%／当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

无。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	171,844,037.45	739,829.11	437,344,379.61	895,938.37

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600021	上海电力	11/5/31	筹划再融资事宜	5.76	11/7/28	6.34	3,829,959	21,515,928.93	22,060,563.84	-
000767	漳泽电力	11/06/07	筹划再融资事宜	5.56	未知	未知	1,999,830	11,297,592.70	11,119,054.80	
000876	新希望	11/06/29	审核资产重组事宜	19.95	11/07/05	21.95	819,933	19,346,589.74	16,357,663.35	
600315	上海家化	10/12/06	筹划国资改革事宜	35.60	未知	未知	5,437	128,847.31	193,557.20	-

注：本基金截至2011年6月30日止持有以上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，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7 投资组合报告

7.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	923,461,668.73	83.87
	其中：股票	923,461,668.73	83.87
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	174,193,909.76	15.82
6	其他各项资产	3,382,945.15	0.31
7	合计	1,101,038,523.64	100.00

注：截至2011年6月30日，上投摩根中小盘股票型证券投资基金资产净值为1,096,064,208.78元，基金份额净值为1.372元，累计基金份额净值为1.412元。

7.2期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	51,163,298.05	4.67
B	采掘业	2,322,326.21	0.21
C	制造业	487,849,718.42	44.51
C0	食品、饮料	106,663,955.99	9.73
C1	纺织、服装、皮毛	9,063,527.84	0.83
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	29,007,174.94	2.65
C4	石油、化学、塑胶、塑料	61,960,702.36	5.65
C5	电子	25,677,673.48	2.34
C6	金属、非金属	43,965,829.43	4.01
C7	机械、设备、仪表	75,623,226.10	6.90
C8	医药、生物制品	135,887,628.28	12.40
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	57,671,925.09	5.26
E	建筑业	35,308,163.00	3.22
F	交通运输、仓储业	21,326,038.72	1.95
G	信息技术业	46,042,413.66	4.20
H	批发和零售贸易	72,268,213.26	6.59
I	金融、保险业	76,734,765.44	7.00
J	房地产业	13,171,144.92	1.20
K	社会服务业	25,189,744.91	2.30
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	34,413,917.05	3.14
	合计	923,461,668.73	84.25

7.3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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002038	双鹭药业	2,773,562	104,701,965.50	9.55
2	600537	海通集团	1,020,835	37,382,977.70	3.41
3	601678	滨化股份	1,949,797	34,413,917.05	3.14
4	000568	泸州老窖	731,142	32,989,127.04	3.01
5	000001	深发展A	1,890,000	32,262,300.00	2.94
6	600963	岳阳林纸	3,283,498	28,106,742.88	2.56
7	000792	盐湖股份	463,279	27,333,461.00	2.49
8	600773	西藏城投	1,149,793	27,135,114.80	2.48
9	600000	浦发银行	2,618,976	25,770,723.84	2.35
10	600875	东方电气	989,789	25,239,619.50	2.30

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（www.51fund.com）的半年度报告正文。

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000937	冀中能源	54,238,072.47	3.90
2	601678	滨化股份	53,379,384.42	3.84
3	600875	东方电气	51,887,658.26	3.73
4	000039	中集集团	50,908,050.02	3.66
5	600016	民生银行	46,702,281.00	3.36
6	600720	祁连山	46,127,538.16	3.32
7	000623	吉林敖东	45,718,119.06	3.29
8	600000	浦发银行	43,605,024.28	3.13
9	600362	江西铜业	41,948,200.06	3.01
10	000157	中联重科	41,731,471.06	3.00
11	601398	工商银行	39,030,346.68	2.81
12	600266	北京城建	38,299,415.64	2.75
13	600537	海通集团	37,206,175.98	2.67
14	600518	康美药业	36,604,936.78	2.63
15	600068	葛洲坝	34,759,723.12	2.50
16	002006	精功科技	34,097,896.21	2.45
17	000568	泸州老窖	34,082,159.51	2.45
18	000001	深发展A	33,768,448.22	2.43
19	600111	包钢稀土	33,662,831.48	2.42
20	600581	八一钢铁	33,043,586.17	2.37
21	000063	中兴通讯	32,127,509.95	2.31
22	600309	烟台万华	31,520,934.95	2.27
23	002155	辰州矿业	30,553,282.45	2.20
24	002422	科伦药业	30,503,483.95	2.19
25	000422	湖北宜化	29,435,704.11	2.12
26	600585	海螺水泥	28,951,276.75	2.08
27	600823	世茂股份	28,311,014.26	2.03

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（或交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000937	冀中能源	104,004,168.48	7.47
2	002013	中航精机	79,002,566.04	5.68
3	600720	祁连山	77,698,389.19	5.58
4	600518	康美药业	68,785,843.28	4.94
5	002155	辰州矿业	66,575,679.31	4.78
6	002006	精功科技	48,463,299.54	3.48
7	000039	中集集团	48,205,920.86	3.46
8	600963	岳阳林纸	47,092,162.78	3.38
9	000630	铜陵有色	45,284,539.67	3.25
10	600016	民生银行	41,820,095.46	3.01
11	600537	海通集团	41,474,026.81	2.98
12	000933	神火股份