上投摩根成长先锋股票型证券投资基金

2011 年度报告摘要

2011年12月31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:二〇一二年三月二十六日

§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2012年3月23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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2011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	上投摩根成长先锋股票
基金主代码	378010
交易代码	378010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月20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	2,254,719,322.31份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于国内市场上展现最佳成长特质的股票,积极捕捉高成长性上市公司所带来的投资机会,努力实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	(1)股票投资策略 本基金采取定量分析与定性分析相结合方式,挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司,主动出击、积极管理将是本基金运作的重要特色。 (2)固定收益类投资策略 本基金以股票投资为主,一般市场情况下,基金管理人不会积极追求大类资产配置,但为进一步控制投资风险,优化组合流动性管理,本基金将适度防御性资产配置,进行债券、货币市场工具等品种投资。 在券种选择上,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。
业绩比较基准	富时中国A600成长指数×80%+同业存款利率×20%
风险收益特征	本基金是主动型股票基金,属于证券投资基金的高风险品种,预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

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.zh@ccb.com
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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.51fund.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

§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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	-447,387,946.25	-3,636,676.98	1,742,625,818.05
本期利润	-893,818,907.17	-556,259,202.34	2,895,688,949.18
加权平均基金份额本期利润	-0.3779	-0.1851	0.8768
本期基金份额净值增长率	-23.84%	-9.84%	51.09%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	0.2021	0.5784	0.7507
期末基金资产净值	2,710,401,794.53	4,057,844,456.48	5,987,419,605.18
期末基金份额净值	1.2021	1.5784	1.7507

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,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

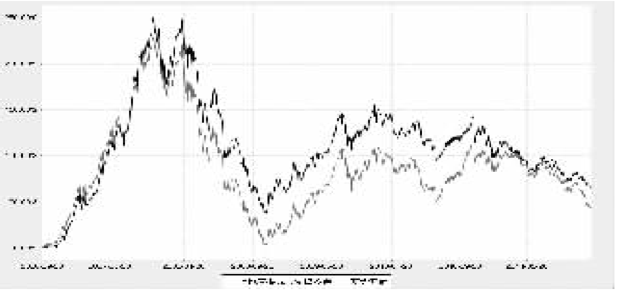
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-2.61%	0.96%	-9.53%	1.20%	6.92%	-0.24%
过去六个月	-12.35%	0.96%	-19.77%	1.12%	7.42%	-0.16%
过去一年	-23.84%	1.06%	-23.45%	1.07%	-0.39%	-0.01%
过去三年	3.74%	1.34%	27.37%	1.37%	-23.63%	-0.03%
过去五年	31.02%	1.74%	5.22%	1.72%	25.80%	0.02%
自基金合同生效起至今	67.94%	1.71%	45.51%	1.70%	22.43%	0.01%

注:本基金的业绩比较基准为:富时中国A600成长指数×80%+同业存款利率×20%

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

上投摩根成长先锋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
(2006年9月20日至2011年12月31日)

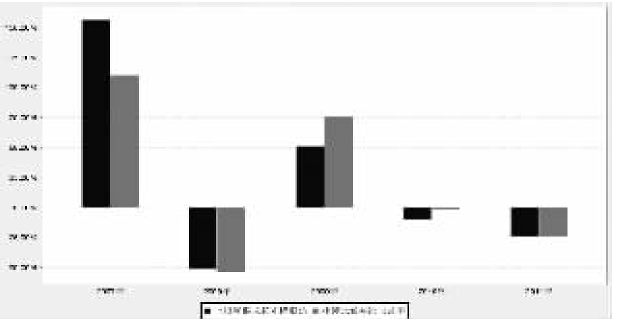


注:1.本基金合同生效日为2006年9月20日,图示时间段为2006年9月20日至2011年12月31日。

2. 本基金建仓期自2006年9月20日至2007年3月19日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根成长先锋股票型证券投资基金
过去五年净值增长率图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011年	-	-	-	-	-
2010年	-	-	-	-	-
2009年	6.800	775,887,220.19	1,158,277,935.45	1,934,165,155.64	-
合计	6.800	775,887,220.19	1,158,277,935.45	1,934,165,155.64	-

§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12月底,公司管理的基金共有十五只,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、上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金和上投摩根强化回报债券型证券投资基金。

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		
唐倩	本基金基金经理	2011-4-28	-	12年	华东师范大学金融学硕士,2000年至2004年在申银万国证券研究所任分析师;2004年至2006年在中银国际有限公司任分析师;2006年至2007年在香港雷曼兄弟证券公司任研究员;2007年加入上投摩根基金管理有限公司,先后任行业专家、研究部副总监、总监,负责研究及部门管理工作。自2011年4月起担任上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金经理。
许运凯	本基金基金经理	2008-12-27	2011-12-7	11年	复旦大学经济学博士,2001至2006年任国泰君安证券研究所机械行业资深研究员,2006年4月加入上投摩根基金管理有限公司,历任投资经理、中国优势基金经理助理、投资副总监。2009年9月至2010年11月任上投摩根阿尔法股票型证券投资基金基金经理,2008年12月至2011年12月任上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金经理,2010年1月至2011年12月任上投摩根行业轮动股票型证券投资基金基金经理。
赵梓峰	本基金基金经理	2007-3-20	2011-5-25	18年	上海交通大学工学学士,历任渣打证券上海代表处研究员,法国兴业证券上海代表处研究员,元富证券上海代表处研究主管,凯基(北京)管理咨询公司研究主管,2005年加入上投摩根基金管理有限公司。2007年3月至2011年5月担任上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金经理。
孙芳	本基金基金经理助理	2010-1-1	2011-12-7	9年	华东师范大学经济学硕士,2003年7月至2006年10月任华宝兴业基金行业研究员;自2006年12月起加入上投摩根基金管理有限公司,先后担任行业专家、基金经理助理,主要负责投资研究方面的工作。自2011年12月起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.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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、《上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金合同》的规定。除以下情况外,基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求:本基金曾出现个别交易日由于市场原因造成基金股票持仓比例低于基金合同中相关规定的情形,但已在规定时间内调整完毕。

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。交易系统中缺省使用公平交易模块,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,公司根据上述分类办法组织相关业务部门及外部专业机构共同开展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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年,A股市场除了在年初有一波反弹以外,基本上是单边下跌的走势。影响市场的因素,包括通胀超预期、货币紧缩、地产政策的步步紧缩,以及欧债问题的延伸。行业配置方面,金融和食品饮料等板块较强势,而电力设备、有色、电子等大多数行业则明显跑输市场。本基金从二季度开始,组合调整基本上采取了保持低仓位,精选消费医药等个股的投资策略。该策略的效果比较显著,基金业绩在二季度后期开始有比较明显的改善,大幅跑赢了基准。

但总结2011年,仍然有不少值得改善的地方。比如说在对一线白酒等个股的配置上,没有把握好投资机会。另外,对文化传媒等板块的敏感性不够,没有进行积极配置。所持有的电力设备等相关的成长股也受到经济波动的影响,业绩未达到预期。这些方面希望在未来的投资中得到改善。

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-23.84%,同期业绩比较基准收益率为-23.45%。

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2012年,预计股市的基本面仍然有反复。从不利因素来看,国内的经济转型、去货币化和换届因素等不确定因素仍然延续,国外的欧债问题、货币环境、伊朗问题和经济增长等不确定性因素也仍然存在。而从有利方面来看,又包括估值水平偏低、国内宏观政策走向放松周期、美国经济开始略有复苏等。因此,股市可能呈现窄幅的盘整格局。

基金运作上,希望能够把握住盈利增速相对较快、受投资影响较小的个股投资机会,以消费板块为主。另外,把握住价格体制改革的机会,比如石油石化、电力等板块的定价体制改革,以及同消费、成长相关的传媒、家电、电子等板块的个股机会。

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,发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人,基金管理人在合理期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本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 审计报告

上投摩根成长先锋股票型证券投资基金2011年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所审计、注册会计师薛竞、王灵签字出具了"无保留意见的审计报告"(编号:普华永道中天审字(2012)第20320号)。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:上投摩根成长先锋股票型证券投资基金
报告截止日:2011年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	242,048,071.79	216,179,526.48
结算备付金		6,456,872.89	13,334,710.51
存出保证金		1,447,446.74	2,329,937.24
交易性金融资产	7.4.7.2	2,039,722,438.46	3,881,937,637.46
其中:股票投资		2,019,598,438.46	3,679,047,316.26
基金投资		-	-
债券投资		20,124,000.00	202,890,321.20
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	444,401,156.60	9,500,214.25
应收证券清算款		31,218,395.77	-
应收利息	7.4.7.5	1,116,514.41	7,303,978.05
应收股利		-	-
应收申购款		19,357.39	326,430.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,766,430,254.05	4,130,912,434.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		44,091,211.53	54,420,908.58
应付赎回款		3,306,679.97	2,519,731.04
应付管理人报酬		3,534,146.38	5,294,421.76
应付托管费		589,024.39	882,403.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,469,821.55	7,901,932.57
应交税费		626,000.00	626,000.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,411,575.70	1,422,580.79
负债合计		56,028,459.52	73,067,978.36
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,254,719,322.31	2,570,812,569.64
未分配利润	7.4.7.10	455,682,472.22	1,487,031,886.84
所有者权益合计		2,710,401,794.53	4,057,844,456.48
负债和所有者权益总计		2,766,430,254.05	4,130,912,434.84

注:报告截止日2011年12月31日,基金份额净值1.2021元,基金份额总额2,254,719,322.31份。

7.2 利润表

会计主体:上投摩根成长先锋股票型证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、收入		-807,707,581.48	-418,964,812.27
1.利息收入		11,518,869.22	13,703,817.96
其中:存款利息收入	7.4.7.11	3,078,197.52	4,314,684.16
债券利息收入		5,011,792.06	9,377,314.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,428,879.64	11,819.60
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-372,969,319.49	118,960,390.85
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-392,677,142.97	75,873,774.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-2,460,428.87	-1,806,177.28
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	22,168,252.35	44,892,793.79
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	-446,430,960.92	-552,622,525.36
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	173,829.71	993,504.28
减:二、费用		86,111,325.69	137,294,390.07
1.管理人报酬		48,961,650.45	71,879,981.00
2.托管费		8,160,275.14	11,979,996.89
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	28,545,183.11	52,878,207.24
5.利息支出		-	90,073.52
其中:卖出回购金融资产支出		-	90,073.52
6.其他费用	7.4.7.19	444,216.99	466,131.42
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-893,818,907.17	-556,259,202.34
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-893,818,907.17	-556,259,202.34

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上投摩根成长先锋股票型证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31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)	2,570,812,569.64	1,487,031,886.84	4,057,844,456.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-893,818,907.17	-893,818,907.17
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)	-316,093,247.33	-137,530,507.45	-453,623,754.78
其中:1.基金申购款	76,559,813.70	29,423,997.14	105,983,810.84
2.基金赎回款	-392,653,061.03	-166,954,504.59	-559,607,565.62
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)	2,254,719,322.31	455,682,472.22	2,710,401,794.53

项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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)	3,420,053,520.52	2,567,366,084.66	5,987,419,605.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-556,259,202.34	-556,259,202.34
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)	-849,240,950.88	-524,074,995.48	-1,373,315,946.36
其中:1.基金申购款	132,802,951.66	79,941,222.31	212,744,173.97
2.基金赎回款	-982,043,902.54	-604,016,217.79	-1,586,060,120.33
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)	2,570,812,569.64	1,487,031,886.84	4,057,844,456.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,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:张璐

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上投摩根成长先锋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")证监基金字[2006]第182号《关于同意上投摩根成长先锋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《上投摩根成长先锋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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币5,480,643,191.07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(2006)第130号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金合同》于2006年9月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,480,692,618.04份基金份额,其中认购资金利息折合49,426.97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《上投摩根成长先锋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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的70%-95%,债券及其它短期金融工具为0-30%,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。本基金投资重点是具有高成长潜力的上市公司股票,80%以上的非现金股票基金资产属于上述投资方向。本基金的业绩比较基准为:富时中国A600成长指数X80%+同业存款利率X20%。

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2012年3月23日批准报出。

7.4.2 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》、《上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2011年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 关联方关系

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
上海国际信托有限公司("上国投")	基金管理人的股东
摩根资产管理(英国)有限公司	基金管理人的股东
上信资产管理有限公司	基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司
上海国利货币经纪有限公司	基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司
J.P. Morgan Investment Management Limited	基金管理人的股东摩根资产管理(英国)有限公司控制的公司
J.P. Morgan 8CS Investments (GP) Limited	基金管理人的股东摩根资产管理(英国)有限公司控制的公司

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	48,961,650.45	71,879,981.00
其中:支付销售机构的客户维护费	5,791,471.03	8,199,702.67

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 X 1.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,160,275.14	11,979,996.89

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 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2011年1月1日至2011年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	109,444,326.03	-	-	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
期初持有的基金份额	-	2,060,423.08
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	2,060,423.08
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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	242,048,071.79	2,945,976.15	216,179,526.48	4,134,203.84

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2011年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601669	中国水电	11/09/29	12/01/18	新股网下申购	4.50	4.09	3,437,870	15,470,415.00	14,060,888.30	-
601336	新华保险	11/12/09	12/03/16	新股网下申购	23.25	27.87	52,464	1,219,788.00	1,462,171.68	-

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.9.2 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
600315	上海家化	11/12/30	筹划整体改制事宜	34.09	12/01/04	34.75	5,677,751	126,656,465.29	193,554,531.59	-
002051	中工国际	11/12/08	拟披露重大事项	27.97	12/03/19	30.00	233,856	6,815,205.53	6,540,952.32	-

注:本基金截至2011年12月31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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层次金融工具公允价值

于2011年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为1,819,502,954.55元,属于第二层级的余额为220,219,483.91元,无属于第三层级的余额(2010年12月31日:第一层级3,173,343,763.68元,第二层级708,593,873.78元,无第三层级)。

(iii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2010年12月31日:同)。本基金本期净转入/(转出)第三层级零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动零元(2010年度:无),涉及河南双汇投资发展股份有限公司("双汇发展")发行的股票。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

8 投资组合报告

8.1 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	2,019,598,438.46	73.00
	其中:股票	2,019,598,438.46	73.00
2	固定收益投资	20,124,000.00	0.73
	其中:债券	20,124,000.00	0.73
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	444,401,156.60	16.06
	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	248,504,944.68	8.98
6	其他各项资产	33,801,714.31	1.22
7	合计	2,766,430,254.05	100.00

注:截至2011年12月31日,上投摩根成长先锋股票型证券投资基金资产净值2,710,401,794.53元,基金份额净值为1.2021元,累计基金份额净值为1.8821元。

8.2 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	5,307,517.67	0.20
B	采掘业	65,584,118.54	2.42
C	制造业	961,325,231.33	35.47
C0	食品、饮料	402,570,799.31	14.85
C1	纺织、服装、皮毛	994,682.01	0.04
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	205,138,449.21	7.57
C5	电子	130,271,154.94	4.81
C6	金属、非金属	717.01	0.00
C7	机械、设备、仪表	44,522,622.16	1.64
C8	医药、生物制品	177,815,241.69	6.56
C99	其他制造业	11,565.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	60,779,321.32	2.24
E	建筑业	17,777,558.60	0.66
F	交通运输、仓储业	127,611,156.87	4.71
G	信息技术业	212,539,075.80	7.84
H	批发和零售贸易	2,075,673.61	0.08
I	金融、保险业	405,001,515.29	14.94
J	房地产业	144,132,960.51	5.32
K	社会服务业	17,053,598.92	0.63
L	传播与文化产业	410,710.00	0.02
M	综合类	-	-
	合计	2,019,598,438.46	74.51

8.3 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	600315	上海家化	5,677,751	193,554,531.59	7.14
2	600050	中国联通	22,234,505	116,508,806.20	4.30
3	600009	上海机场	9,236,089	113,049,729.36	4.17
4	601009	南京银行	10,008,208	92,876,170.24	3.43
5	600060	海信电器	6,764,443	80,361,582.84	2.96
6	600406	国电南瑞	2,472,505	77,142,156.00	2.85
7	600519	贵州茅台	395,961	76,539,261.30	2.82
8	600518	康美药业	6,619,292	74,268,456.24	2.74
9	000858	五 粮 液	2,178,080	71,441,024.00	2.64
10	000895	双汇发展	944,789	66,087,990.55	2.44

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http://www.51fund.com 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000858	五 粮 液	151,357,240.44	3.73
2	600009	上海机场	134,263,559.00	3.31
3	600015	华夏银行	133,646,900.11	3.29
4	600050	中国联通	130,250,036.54	3.21
5	601088	中国神华	129,392,110.33	3.19
6	600048	保利地产	125,516,562.52	3.09
7	600887	伊利股份	124,057,605.41	3.06
8	600036	招商银行	122,828,247.09	3.03
9	000002	万 科 A	117,096,279.95	2.89
10	000629	攀钢钒钛	111,609,778.26	2.75
11	601118	海南橡胶	111,264,547.53	2.74
12	600519	贵州茅台	108,981,362.45	2.69
13	601318	中国平安	104,967,143.26	2.59
14	600029	南方航空	104,535,112.62	2.58
15	600000	浦发银行	103,209,616.76	2.54
16	600060	海信电器	97,478,062.41	2.40
17	601890	亚星锚链	96,888,736.81	2.39
18	600016	民生银行	93,635,004.52	2.31
19	601009	南京银行	90,942,498.99	2.24
20	600104	上汽集团	90,098,089.43	2.22
21	002029	七 匹 狼	88,425,068.20	2.18
22	600284	浦东建设	87,301,754.79	2.15
23	600406	国电南瑞	84,313,889.92	2.08
24	600875	东方电气	83,829,778.67	2.07
25	600547	山东黄金	83,142,925.98	2.05
26	600518	康美药业	81,212,704.26	2.00

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(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	600518	康美药业	235,729,238.34	5.81
2	000650	仁和药业	175,214,654.11	4.32
3	601989	中国重工	174,838,025.08	4.31
4	601601	中国太保	168,455,715.18	4.15
5	002304	洋河股份	154,930,421.69	3.82
6	600029	南方航空	140,704,045.31	3.47
7	601808	中海油服	139,409,001.49	3.44
8	601118	海南橡胶	129,330,459.53	3.19
9	002168	深圳惠程	128,646,844.85	3.17
10	601111	中国国航	123,966,207.08	3.05
11	600499	科达机电	116,698,052.78	2.88
12	600837	海通证券	108,755,670.82	2.68
13	002106	莱宝高科	105,369,338.99	2.60
14	002029	七 匹 狼	104,125,767.08	2.57
15	000002	万 科 A	101,494,164.08	2.50
16	002273	水晶光电	101,468,018.82	2.50
17	601318	中国平安	100,517,559.42	2.48
18	000877	天山股份	98,071,516.03	2.42
19	601890	亚星锚链	96,697,151.84	2.38
20	600015	华夏银行	95,957,299.85	2.36
21	002167	东方锆业	95,121,009.47	2.34
22	600104	上汽集团	92,865,219.98	2.29
23	600000	浦发银行	90,632,218.15	2.23
24	600123	兰花科创	90,436,522.47	2.23
25	600048	保利地产	88,698,903.16	2.19
26	000629	攀钢钒钛	87,770,674.67	2.16
27	600188	兖州煤业	86,089,242.04	2.12

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(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	8,843,148,759.51
卖出股票的收入(成交)总额	9,661,364,746.69

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(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,124,000.00	0.74
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	20,124,000.00	0.74

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1181087	11丝绸CP01	200,000	20,124,000.00	0.74

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的宜宾五粮液股份有限公司(下称:五粮液,股票代码:000858)于2011年5月28日公告其收到中国证监会《行政处罚决定书》([2011]17号),认定五粮液存在信息披露违法行为,并对五粮液及唐桥等八名责任人员分别给予警告、罚款等行政处罚。

对该股票投资决策程序的说明:本基金管理人在投资该股票前严格执行了对该上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。该股票根据股票池审批流程进入本基金备选库,由研究员跟踪并分析。该事件发生后,本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和分析,认为此事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对该上市公司的投资判断。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,447,446.74
2	应收证券清算款	31,218,395.77
3	应收股利	-
4	应收利息	1,116,514.41
5	应收申购款	19,357.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,801,714.31

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600315	上海家化	193,554,531.59	7.14	筹划整体改制事宜

注:本基金截至2011年12月31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,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,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。

8.9.6 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。

9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
102,765	21,940.54	20,472,469.00	0.91%	2,234,246,853.31	99.09%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	10,023.11	

10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2006年9月20日)基金份额总额	5,480,692,618.04
本报告期期初基金份额总额	2,570,812,569.64
本报告期基金总申购份额	76,559,813.70
减:本报告期基金总赎回份额	392,653,061.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,254,719,322.31

11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人:

2011年1月29日基金管理人发布《上投摩根基金管理有限公司关于聘任高级管理人员的公告》,经本公司董事会审议通过,决定聘任经晓云女士、冯刚先生为本公司副总经理。

2011年10月29日基金管理人发布《上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经本公司董事会审议通过,同意童威先生辞去本公司副总经理职务。

基金托管人:

本基金托管人2011年2月9日发布公告,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理(主持工作),其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可[2011]115号)。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。本基金托管人2011年1月31日发布任免通知,解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。本基金托管人2011年10月24日发布任免通知,聘任张军红为中国建设银行投资托管服务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。报告年度应支付给聘任普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为110,000元,目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为6年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内,管理人、托管人未受稽查或处罚,亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	4,258,056,682.92	23.10%	3,619,339.33	23.49%	-
国泰君安	2	3,117,200,442.36	16.91%	2,643,801.79	17.16%	-
兴业证券	1	3,109,370,329.06	16.87%	2,526,386.91	16.40%	-
中金公司	1	2,819,435,147.18	15.30%	2,396,516.53	15.56%	-
国金证券	1	2,111,117,640.06	11.46%	1,715,296.28	11.13%	-
高华证券	1	1,560,819,771.69	8.47%	1,268,177.09	8.23%	-
平安证券	1	1,200,788,974.66	6.52%	1,020,672.10	6.63%	-
国开证券	1	252,556,053.77	1.37%	214,671.81	1.39%	-

注:1. 上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 交易单元的选择标准:

1)资本金雄厚,信誉良好。

2)财务状况良好,经营行为规范。

3)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。

4)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

5)研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 交易单元的选择程序:

1)本基金管理人定期召开会议,组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进行评估,确定选用交易单元的券商。

2)本基金管理人与券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。

4. 2011年本基金新增国开证券一个席位,无注销席位。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	4,174,206.90	24.04%	550,000,000.00	42.64%	-	-
国泰君安	13,128,845.56	75.62%	400,000,000.00	31.01%	-	-
兴业证券	57,720.00	0.33%	-	-	-	-
中金公司	-	-	240,000,000.00	18.60%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	100,000,000.00	7.75%	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-

12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下:

1、2011年10月28日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞任的公告,根据国家金融工作的需要,郭树清先生已向中国建设银行股份有限公司("本行")董事会("董事会")提出辞呈,请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定,郭树清先生的辞任自辞呈送达本行董事会之日起生效。

2、2012年1月16日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告,自2012年1月16日起,王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一二年三月二十六日