上投摩根中小盘股票型证券投资基金

2012 第二季度 报告 **励战**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:二〇一二年七月十九日 新山及山口列: 一〇一一年七月十九日 第3 重要提示 基金管理人的董事会及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还带责任。 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,于圆螺虾、炙り速田复核了本报告中的财务指标、净值 表现和投资组合报台等内容,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。 基金的过程业绩并不尽差其未来表现。 投资有风险,投资者在作出投资决策前应任细阅读本基金的招募说明书。 本报告申财务资料未经审计。 本报告申财务资料未经审计。 其中臟票 怨魔 猿 金融衍生品投 本报告期自 團體作 源月 员日起至 远月 独田止。 。 「羯」基金产品概况 上投摩根中小盘股票 银行存款和结算备付金合计 思料可能總統 機能時间 注: 裁至 图48年 远月 独归,上投库根中小盘股票型证券投资基金资产净值为 總數 屬較 屬486元,基金份额净值为 現實統元,累计基金份额净值为 現實統元。 **编则**报告期末按行业分类的股票投资组合 **随い** 別別 报告期末基金份额总 农熱熱強 投资目标 选择减少享中国经济尚速增长给优势中小印阻工印公司和不由200 战略和战术资产配置策略或功态优化投资组合或功求实现基金资 采掘业 食品激料 通訊館網網廳 纺织翘数剂 投资策略 木材擦具 石油、批学、塑胶、塑 上投摩根基金管理有限公司 油酸 机械激备激剂 **沙斯里尼拉克亚市 80**0 基金托管人 医药产物制品 **克里的祖对达德 独脱**主要财务指标 其他制造业 电力蒸气及水的生 局部的通過 **残**期已实现收益 交通运输舱值 员搬, 质量的建筑 **測** 末基金资产净值 金融海保险业 施城四级城 / 通應本基金份額净值 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, 你含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本即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, 紅利再投资费, 基金转换费等), 计入费用言实际收益水平要低于两列数字。 / 通關基金份額净值录现 / 通關基金份額净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 社会服务业 传播与文化》 1943'92'88'd 544'48 (SH) 净值增长率淤 净值增长率 业绩比较基准 业绩比较基准 收益率标 准差榆 双鹭药业 **记报验**原 康美药业 细胞 独随 远臟恕 山西汾酒 员姆姆 源特利敦磁機 **用品加坡** 亚厦股份 用網玩 东方园林 源6途88 WHILE SERVICE SHEET 188 用脑板层 苏宁环球 是对此转回槽 长盈精密 广田股份 级型 透離緩緩 全地集团 獨称體鍵線 阴原种環 鐵礦报告期末技術房品种分类的债券投资组合 本基金本报告期末末持有债券。 鐵鐵报台期末接次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 本基金和报告期末未持有资产。 鐵廠报台期末接次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 本基金和报告期末末持有资产支持证券。 鐵廠报台期末接次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 本基金和报告期末接次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 本基金本报告期末接次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 本基金和报告期末持有权证。 注:本基金合同生效日为 陽陽評 奶月 剛和,图示时向段为 陽陽聲 奶月 剛和至 陽陽聲 超月 獲和 陽陽聲 奶月 陽和至 陽陽聲 現月 陳和,是仓期给束时资产程是创新合本基金基金合同规定。 海鄉 管理人报告 任职日期 离任日期 起担任上投摩根中小盘股票型证券投资 金基金经理查目 **图整**即即起时时处 变基金经理查目 **图整**即即起时时处 投摩根健康品质生活股票型证券投资 基金经理通 **國際經濟** 缘 应收申购款 其他应收款 苑 待摊费用 本基金本报告期末前十名股票甲不分吐瓜。 3個歷投發指各报告附注的其他文字描述部分 因四含五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。 每6 开放式基金份额变动 交易结果进行公平分配。 报告期内,通过对不同投资组合之间的收益率差异比较,对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析,监察 积核部未发现继续处乎交易执行出现异常的情况。 本报告期基金总申购份额 **建筑 100 100 000 000** k pk 报告期基金总赎回份额 列展备查文件目录 初期期的中国证监会批准上投摩根中小盘股票型证券投资基金设立的文件; 2000度(中国正正等40年上以序室中の温度宗皇正等大安を並及 海側震度・世界集中小金原東電声券投資基金金合同)。 海側震・世界県中・金原東電声投資基金基金托管协议)。 海側震性・世界県中・金原理有限公司开放式基金业务規則)。 海側震性・管理人业务資格批作者皆東無。 海側震球金託管人业务資格批作者出東無。 司规规设好,刚则类板块跌幅较大。 报告则内本基金对一季度持仓组合做了较大幅度调整,重点增加了地产、券商、电子、建筑装饰等行业的配置,对原组合 中食品饮料,信息服务等行业的特色结构做了较大幅度调整。努力提高对公司研究的深度,并对所有特色公司进行了反复筛 透和调整、形成了后期较理想的组合结构。通过调整、基金业绩有了较大幅度提升。 毫未来市场而言,我们仍然持值低环境的态度,我们认为。自商经济下帮的趋势将在三季度得到改善,而流动性的宽松、 通胀的下降,政党对于证券市场的支持以及目前市场整体较低的估值水平将对未来市场形成较强支持。 基金管理人或基金托管人处。 报言列內華並的近級來現 片期本基金份額净值增长率为 房攤繳。同期业绩比较基准收益率为 房攤繳。 异緣 投资组合报告

上投摩根中国优势证券投资基金

					201	2第二	季	度振	告告				Б	振 定年 6 月 30 日	
基金管理基金托行报告送品	理人: 上投摩 管人: 中国建 出日期: 二(根基金管理有限。 设银行股份有限。)一二年七月十九	公司 公司 .日				元,累计基金	至 國城市 远月 獲日 全份额净值为 测数据 告期末按行业分类自	玩。	势证券投资基	金资产净值为	为 缘测恒源级 质酮	鏡玩,非	基金份额净值为 分數	
基金管理	里人的董事会	☆及董事保证本报	, 現 告所载资料不存	重要提示 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	代和	į.	行业类别		公允份	介值測瓦冤	_	金资产净值比例测疑	
基金管理人的董事会及董事保证本报告所教资料不存在歷史成就、误导性除述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确 性和完整作来担个别及还常往。 基金信告人中国建设银矿有限公司根据本基金合同规定,于咖啡库,每月逾四复核了本报告中的财务指标、净值表现和货组合报告等内容。保证更换内容不存在虚核应数、误导性陈述或者重、遗漏。 基金管理人难试以或实在用,题就是资助规则管理是应用基金管,但不仅能试验量。						了本报告中的财务指标、净值	粤 农 港 漵 滟 业 月 采掘业				5万克联基3名联联制:			(40)	
表現和投資: 基金管:	Ⅱ台报告等ト 理人承诺以前	以安信用、勤勉尽 以实信用、勤勉尽	6个仔住庭饭记载 贵的原则管理和逗	译在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。 長则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。 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。								列黎拉拉拉姆	_	浮機	
本报告。	中財务资料۶	、八衣共木木衣巩 长经审计。 源月 別日起至 远		(質有性肝面仅質	伏泉削壓打细園區	平	悦		1)	京	原	
	ALTERNATION OF THE PROPERTY OF	湖口 贝口尼土 地	月 園 基	列 基金产品概况			悦员 纺织搬装被毛				***************************************		E	140 <u>8</u>	
基金简称 基金主代码			上投摩根中国优生 發酵 婦	學混合							原原			原	
交易代码			Western -				(A)原 石油光学灌胶灌料				原. 过速度顺致维制 数			原 玩機	
基金运作方	式		契约型开放式				(線 电子				SHAPE MERCENSON			1885	
基金合同生			開闢解 怨月 強妇				悦远 金属洲金属				元和成立对相对象种唯 立			海搬	
报告期末基	金份额总额		[陳撰] [陳撰] [陳撰] [陳撰] [陳撰] [陳撰] [陳撰] [陳撰]					悦范 机械 淞 备 湫 表 悅戀 医药 港 物 制品			(明朝)对女医师 食品糖品。			沙娃	
投资目标			不整查在以下例改與內無本原則的基础上,2000年作的改數化件的來和內區官理再投辦被格較資产配置中投資的相有效結合辦心基本在經濟之業在經濟之業在經濟之時, 有国际比較优勢的中国企业;通过精选证券和透度主动投资或为国内投资者提供 国际水平的理财服务;減款基金资产的长期稳定增值返					75			/東南省/東京東京東京 原			5 被	
								阅 电力凝气及水的生产和供应业			为				
			本基金充分借鉴所 野宙视中国经济5	▼根资产管理集团 分展 3件国内行业:	全球行之有效的技 发展趋势与上市公	と 安理念和技术表 以国际视 司价值判断纳入全球经济	耘					员家经验家还能被	_	四極	
			综合考量的范畴	P国经济发展 辦国内行业发展趋势与上市公司价值判断纳入全球经济 提的范畴强通过定性 號量严谨分析的有机结合 避婚犯甚固家 辦区与上 9比较优势凝终实现上市公司内在价值的合理评估,独资组合资产配置				云 交通运输剂6储业				建设设设计模		· 國際	
			与风险管理的正确	角实施遥本基金以	、股票投资为主体或	在股票选择和资产配置上	脚 信息技术业 匀 批发和零售貿易							連線	
投资策略 基金积 势价值 基本面			分别采取野1下到上海1野1上到下海的投资策略越根据国内市场的具体特点减补 基金积极利用摩根资产管理集团在全球市场的研究资源。提出其国际视野观的优 势价值评估体系强别个服务质源/结合本地长期深入的公司调研和严格市值的					页 金融·器险业				课就被批选银额	64	Page 1	
			基本面与市场面外	分析、輸送出重点:	关注的上市公司股		允 房地产业			分类领袖和这种政治规则 。					
			別资产配置和行业资产配置為 基金不仅在股票 減券和现金三大资产类別间实 施策略性调控 起通过对全球 纏 域行业效应进行评估后 瀕 定行业资产配置权					运 社会服务业			原及保持石建和建筑				
			重彩。体紧密监控组合风险与收益特征表以最终切实提高组合的流动性为能定性 与收益性遥					综合类	NG / 3E		及实际运动和重要点 「翻奏」 运送餐取运动柜摄像点 「翻奏				
业绩比较基	Vil:		本基金股票投资的	8分的业绩比较基 1日传比数 1日 0-1	准是富时中国购	置指数 3债券投资部分的业 越走搬牢 时中国 奥超指数	合计				沙京水市大学会区等最多機能				
3E 39 IU 4X 3E	f)t:				短伸並领比权至在 垣 黎 的同业存款利		線験 报行 序号	告期末按公允价值 l						占基金资产净值比	
风险收益特	征		本基金努力追求! 中等风险证券投;		i a在风险预算目标	在风险预算目标下使基金收益最大化载用于		股票代码	股票名称	数量;	股冤	公允价值源	冤	例測線定	
基金管理人			上投摩根基金管理				员	进程	社石化		Gerra Capa	福安城和		/400	
基金托管人			中国建设银行股份				類	7000000 7000000	苏宁环球 中粮地产		Date Black Bill			金藤	
雅戲主要	更财务指标		异酸 主要财务	旨标和基金净值表	で現	V.D. 1	源	THE STATE OF THE S	本钢板材		Rigid Hitter	- Parish and a second s		1988	
	主要財	务指标		报告期渊赋	DEF 189月 员日 原 国 教	単位:人民币元 (年 元月 編記) 策	缘	进髓酸	中华企业	ì	製切製过む	陽線減極	(排煙)	鴻巍	
別 期已实现				V.11.24	LI. W. J. St. Manage	原认的组织和对此	远苑	通關制	黎化		\$1974.18E	则使辩象这		多数	
				/走近这名号语言论范号相签行				过度最级数1 100000000000000000000000000000000000	凌钢股份 华菱钢铁		Aisidiene Caichaich	5月电影电影电 5五电影图		7895 1489	
獲 収平均 減 収平均	基金份额本具	月利润		「機能探查」 - 第2章 化电影 全球 (大田 建亚)				FEERSES	嘉凯城		AUGUSTANIA	ALCOHOLD .		福	
線 樹末基金(- NEVERENA STRUME	掘	进盟城市	包钢股份		但过超级的	分解解期	走殺機制	陳庭	
注:本期	己实现收益	指基金本期利息I	收入、投资收益、] (奪动收益	其他收入 不含公	允价值变动收益)	口除相关费用后的余额,本期 回费、红利再投资费、基金转	線原报行 序号	占期末按债券品种 分	↑类的债券投资组 债券品种	合	公介化	价值測汇冤	上非	金资产净值比例测数	
上述基3	金业绩指标プ 入费用后空間	包括持有人认购	或交易基金的各 所列数字。	项费用 例如,开	放式基金的申购赚	回费、红利再投资费、基金转	员	国家债券	1A 22 MI 11		11701	or acousts.	原	原	
程则基金 程则基金	注净值表现 报告期基金	r收益水平要低于 份额净值增长率	//// X 1 ・ 及其与同期业绩日	:轻基准收益率的	H:50		圆	央行票据				经过期证明	<u>B</u> il	残難	
7140000	阶段	净值增长	冷他地长3	E 业体比较基本 业绩比较基			猿 金融债券				原			原	
	PH EX	AT HE AR IC.	^平	收益率盂	准收益率标 准差榆	淤属 于原輸	源	其中障政策性金融 企业债券	190				原原	原原	
过去三个月	北 公公同生	図	. 別機 酸	対象数	漫画像 ボドヤスはJRJがおった。	が	缘	企业短期融资券					原	馬	
788886111 T	SESEN PLIC		上投摩根中国	智长率变动及其与同别业缩比较基准收益率变动的比较 转根中国优势证券投资基金 与业绩比较基准收益率的历史走势对比图				远 中期票据					原	原	
		2000	個個新年 怨月 身份	日至 陳原年 远月	独日)		売 - 歴	苑 可转债 郎 其他			河南 東北京東西町 原 原 2号 河東東京大阪西町				
			A.	4		-	怨 合计								
	7. **		' الن	My North State of			维	占期末按公允价值占	基金资产净值比	例大小排名的	前五名债券技				
	* • •		<i>,</i> ".					债券代码	玩味有票据 應		数量測% 冤 公允价		值渊汇冤	占基金资产净 值比例渊繁	
			1 11/2					分质磷酸铝			186	*\$64566 NESESSEEE		建	
		1	4	" be the second	6	- Nr-	圆	员被叛乱	玩 快行票据 版				COMPANDED BY		
		m 18	201.01.01	20411 1 8		- 25030 4	猿 细粒报名	质糖酸 吉期末按公允价值占	重工转债 基金资产净值比	例大小排名的		麻飲 支持证券投资明细	源飽料盤	ᇓ	
		时间为 閱聞解 名 關年 怨月 婚日至 金经理小组)简介	別 別日,图示时 図画解年 猿月 別明 月期	可段为 團體解年 怨 日,建仓期结束时 管理人报告	月 強紅至 隨城群 资产配置比例符合	远月 獲田。 远月 獲田。 本基金基金合同規定。	本基金 線施报(本基金	本报告期末未持有 占期末按公允价值占 本报告期末未持有 资组合报告附注	资产支持证券。 i基金资产净值比						
姓名	职务		基金经理期限	证券从业年限		说明	金銀旗形 オ	《基金投资的苏宁环	球股份有限公司 (01书))主要内容为[下称: 苏宁环5 对公司涉嫌信息	k,股票代码:	: 随时题于 随机 根据 (矿券法))有关	年则月	 	
		任职日期	离任日期		上海交通大学博	士 灣 任兴业证券研究发展	立案调查。 總潭合作开	随后, 苏宁环球于 圆 发项目信息未及时。	同切年 別明 図8日 い告,渉嫌信息披き	又对被中国证	监会立案调	查的情况进行公告	·说明: 2	公司因为广州荔湾区	
					中心研究员款及	(基金管理有限公司高级研 人上投摩根基金管理有限公	对上述	股票投资决策程序的	的说明:本基金管理 上述即更相求的	里人在投资苏宁	字环球前严格 洪λ * 其令	执行了对上市公	司的调研	开、内部研究推荐、投 分析。上述事件发生后	
杨安乐	本 基 金 基 金经理	则能够远	原	员年	司建任研究部总	监助理剂T业专家巡曾任上 证券投资基金基金经理助	本基金管理	人对上市公司进行 响,因此,没有改变;	了进一步了解和分	ト析,认为上述?	事项对上市么	公司财务状况、经	营成果和	和现金流量未产生重	
					理光投摩根成七基金经理助理遥	: 先锋股票型证券投资基金	其余九	名证券的发行主体》	父有被监管部门立	案调查或在本	报告编制日言	前一年内受到公开	·谴责、处	上罚的情况。	
注: 頻觀	职日期和离	王日期均指根据 2	公司决定确定的聘 於业从业人员资格	任日期和解聘日			190000111 19000011	设告期内本基金投资 其他各项资产构成	的刑丁名股景汉1	月超出基金管門	月規疋的金达	放崇件。			
関語 券 / 海膜 管理	人业的含义遗 是人对报告期	从行业协会 证券 内本基金运作遵	F业从业人员资格 规守信情况的说明	管理办法》的相关 月	规定。		序号		名称			金额海	 £ 笼		
人遵守了 証	与期内, 基金 券投资基金	官埋人不存任预 法》及其他有关法	5基金份额持有人 :律法规、企投摩	、利益的行为, 奶鬼 根中国优势证券出	20尺页地为基金份	顺持有人谋求利益。基金管理 的规定。基金经理对个股和 要求。	员圆	存出保证金 应收证券清算款						5年20年2年2月1日 2年2月1日 - 12年2月1日 2年2月1日 - 12年2月1日	
温製公子	"父勿专项协	AND ACTION				猿	应收股利						TRADERAGIO		
海域 公 报告期	十父易制度 丸,本公司继	时执行情况 续贯彻落实 证券	投资基金管理公	司公平交易制度指	旨导意见》等相关法	律法规和公司内部公平交易	源	应收利息						回视结结像	
が、 で 易 执 行 和 と が に に に に に に に に に に に に に	g 水, 广格規 监控分析, 以	心鬼內工巾股票、 确保本公司管理[则分时一级市场 的不同投资组合在	中州和二級市场3 三授权、研究分析、	(勿守活功, 週 互系 投资决策、交易执行	律法规和公司内部公平交易 统和人工相结合的方式进行 宁、业绩评估等投资管理活动	緣	应收申购款	-					須び接続料理	
和大的外节 [‡] 对于交	の得到公平X 易所市场投資	1行。 经活动,本公司执行	行集中交易制度,	确保不同投资组	合在买卖同一证券	时,按照时间优先、比例分配	远	其他应收款						原	
相左的护力与的创到公平有停动。本公司执行集中交易制度,确保不同投资组合在买类同一证券时,按照时间优先、比例分价的原则在全投资组合间公平分配交易量。对于银行间市场投资活动,本公司通过对手库控制冲交易室油价机制,严格防范、于风险升量论格公性、以为价值的原则,根据事物处中抵的价格和数量。于风险升量论格公性、以为价值						火勿至明17f机制,严格防范对 前独立申报的价格和数量对	苑 待摊费用 膨 其他				E E				
交易结果患于汽平分配。 用专用的。进过4不同报货组分之间的收益率5异比较,对同向交易和反向交易的交易时机和交易份差监控分析,监察 相关期的。进过4不同报货组分之间的收益率5异比较,对同向交易和反向交易的交易时机和交易份差监控分析,监察 相核部末关现地核心平交易有了出现异常的情况。							怨	合计						JANS HOUSE	
1月18日本友は 瀬棚昇 お生物。	元平中公丁分 常交易行为 知 通过なか	、∞1×11 田現开吊 的专项说明 見价枚 ホロロー		样公析 此宛称+	な部本公刊 方か 巳。	党 京 县 行 书	缓骤射 太基全	设告期末持有的处于 本报告期末未持有!	转股期的可转换(处于转股期的可转	责券明细 :换债券。					
取古期 所有投す 温を担す	3, 四尺列父 资组合参与的 证由	ッリロインス あり 旧 り交易所公开竞价 pお客祭政和ルルム	い 又勿 刀 円 寺 刊 指 ・同日 反 向 交 易 成 寿 御 道 昭	ntカリー 画祭情報 交较少的単边交易	スル・ススス 任仕 年 易量超过该证券当	常交易行为。 日成交量的 線 的情形: 无。	2 8888 x H	本报告期末前十名股票 本报告期末前十名	中存在流通受限性	青况的说明					
沙瓣影报	・クリア 至亜比 告期内基金 ト 半 年 ・	及 東京市 中型領 投资策略和运作: 1883年 - 第日左市	いたがり 分析 ロ. 投资 5 治弗**	—北海神 滅後略	(帐压力组总) ************************************	货币政策转向室が 方が非々	线螺旋打	と资组合报告附注的	其他文字描述部?	}	: 民学				
金率与利率和成长股表现	工士牛, 宏观 都有所降低, 中器老标品。	。正可二马与牛出 市场流动性有所! 6枚品	11、12.	少wk珠,理妖影 「高后低,利率敏恩	·加瓜刀町並佩詮。 整性行业如非银行:	货币政策转向宽松,存款准备 金融、地产与业绩增长确定的	因四舍	五入原因,投资组合		与合计可能存在 异远 开放式基				** **	
成长版表現 展望下 构性机会。	半年,我们认	为通胀继续下降,	经济继续探底,货	市政策可能继续	宽松,股市流动性:	会有所好转,可能继续呈现结	本报告期期]初基金份额总额						单位: 位: 位	
沙龙柳柳 村長	告期内基金 期本基金份額	的业绩表现 顺净值增长率为 10	騰 騰,同期业绩比	较基准收益 家书	同應稅 。			金总申购份额						加速切削功益	
	·期末基金资		発 技	资组合报告				期基金总赎回份额		-	-			月起议的收购	
序号		项目		金額	顶湖 冤	占基金总资产的比例测氮		金拆分变动份额				_		Direction of the Control of the Cont	
员	权益投资 其中障股票				海药抗铁板或铁坑桶					异花 备查文	(件目录			CHANGE STREET,	
閱	西定收益 核	· 资			SHARAN	Figure 5	列数 各 列数数中	查文件目录 国证监会批准上投	摩根中国优势证券	·投资基金设立	的文件:				

是

减除报告期基金总赎回份额

3個 各直文件目录 頻中間证监会批准上投降根亚太优势股票型证券投资基金设立的文件, 関 也投降根亚太优势股票型证券投资基金基金合制。 据 也投降根亚太优势股票型证券投资基金基金合制。 据 也投降根基金管理有限公司并放式基金业务规则。 经基金管理人必要价格批件。 该基金是优管人业务资格批件和营业执照。 例期存放他。 基金管理人或基金化管人处。 微量存放。

ダ嬢

養

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。

須收職與過騰

歷教技艺教育 苑縠ӿ綠쪓쬻

绿斑脑斑鹟鹟

源较超数额

独结滨郑娜

獲協量的

用致歧数缝纫

忽擊時時時報觀

注: 行业分类标准: 配幣額 纖纖报告期末接公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

上投摩根亚太优势股票型证券投资基金

上投摩根基金管理有限。 二〇一二年七月十九日 其中院医断式回购的买入返售金融资产

基金主代码 發施弧元 開始 張川 陽川 投资策略 中国工商银行股份有限公 境外投资顾问英文名称 境外投资顾问中文名和 境外资产托管人中文名和 纽约梅隆银行 异酸 主要财务指标和基金净值表现 雅 权平均基金份额本期利润 源 末基金资产净值 1980年至20回行出 注:本期已支现收益指基金本期利息收入投资收益,其他收入 你含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利 润为本期已支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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 獲關基金净值表现 獲應數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

注,本基金合同生效日为 阿藤萨 房月 剛日- 图示时间投为 阿藤萨 房月 剛日至 阿藤萨 房月 糠日. 本基金建仓期自 阿藤萨 房月 剛日至 阿藤郎年 房月 顾日 建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。 海鄉 管理人报告

減緩基金经理 或基金经理小组)简介

用用器设施

杨逸枫

固定收益投资

其中随近期

愿 其他各项资

其中除斯式回购的买入返售金融资产

银行存款和结算备付金合

爭員 重要提示 基金管理人的董事会及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

缴据告期末基金资产组合情况

					2012	第二	一才	速度	报	告		踵或 年 6 月 30 日	
张军	本基金基金经理	D 服養機能多板 程感	原	遊	经验 處 可联担任父勿忌监狱的时 晚时起任权货			応,累计基金份名 類別提告期末在名 国家鴻地区 香港	顾净值为 國 教 个国家 她区		为 房洞鄉先總路 沙鄉鄉走玩,基金份 额净值为 占基金资产净值比例测数区 漳鄉縣		
関数 複数正券	风女士担任本 从业的含义这 投资顾问为	任日期均指根据 2 本基金首任基金经 整从行业协会 证券 本基金提供投资资 生境外投资顺何所	理的任职日期为; \$业从业人员资格 建议的主要成员简	k基金基金合同生管理办法》的相关	明。 效之日; 规定。	华亚 拉	韩国 泰国 印度 中国 美国				方式名称文字 使用证本 电电影起 分记标写作见证不多正在地位 正正在实现还是实现几个地位 全家企业在市市主席来概念	(基础) 注题的 注题数:	
许安庆 王浩	允 基金D	充基金区域投资 区域投资经理兼大 运作遵规守信情》	经理 中华投资总监	雅好 別能	# R			印度尼西亚 新加坡 马来西亚		海州市中亚州市 在		(明報) (注: (2) (2) (2) (2) (2) (2) (2) (2) (2) (2)	
在本报行 人遵守了 征 股和投资组行 测療公平	与期内,基金 券投资基金	管理人不存在损害 法》及其他有关法律 行投资决策委员会 明	基金份额持有人 律法规、企投摩相	是亚太优势股票型	尽责地为基金份额持有 证券投资基金基金合同 基金合同和法律法规的重]》的规定。基金经理对	^ i			票及存托凭证投资:		類	
报告期内,本公司继续贯彻落实 配券投资基金管理公司公平交易制度指导管见》等相关法律法规和公司内部公平交易 流程的各项要求,严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动,超过系统和人工相结合的支管流活动 有关的不均均到公平对待。 相关的不均均到公平对待。 对于、级市场投资活动,本公司执行集中交易制度,确保不同投资组合在实是同一证券时,按照时间依余、比例分配的版 对于、级市场投资活动,本公司执行集中交易制度,确保不同投资组合在买卖同一证券时,按照时间依余、比例分配的版								银行 体产品与设备 产管理和开发		公元明	员被诉说我能够的 员的复数的现在分词 员的复数的	日至並列 行出しの機能	
则在各投资组合间公平分配交易量。对于一级市场申购活动,本公司遵循价格优先、比例分配的原则,根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。 报告期内,通过对不同投资组合之间的交易价差和分配结果监控分析,监察稽核部未发现整体公平交易执行出现异常的情况。 "挪赐则异常交易行为的专项说明								材料			《東西日本新文文記書館》 《東西日花新文文文記書房 「後述文明文字与古書館」	《機動物 河際四 分表施物	
报告期内,通过对交易时间,交易价格,分配结果监控分析,监察稽核部未发现存在异常交易行为。 所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的/缴的情形;不适 用。 测整报告期内基金的投资策略和业绩未规说明 测整报报告期内基金的投资策略和证债未规说明 可以上,以后发现的发展。 一定一次,现价是机的产品交易的发展。 一定一次,现价是机的产品交换更仍然受到全球投资者指流的重视。远归底的欧盟峰会上出现了超市场预明的发展。虽然 成元债券与财政移转在目前政治开场中看来难度仍高,但欧元稳定基金得以直接向欧元队银行注资。避免了银行视济兑与信 使得领等规度的发生。的确有知题步稳定欧元民的金融情势。类似的宏观表现相对稳度、失业平下降以及居民格塞消险定								电信业务 集团企业			等基本的表面的 1/4年的中央 1/4年的 1/4 0/4 0/4 0/4 0/4 0/4 0/4 0/4 0/4 0/4 0	PARKET VALIDATE PARKET	
								化零售 网软件与服务 零配件			四种基本化物基层放射器 四种基本的数据后连续制度 图象数据的连续影响	12 動立 12 動成 12 動成 12 動成	
使其经济二次规定的风险降低。 但不容容认的是、全球经济复苏的确已经出现减速、幸好目前全球通胀压力也随原材料价格走低而有所减缓、让各国政 府有空间进行稳增长的政策。因此包括巴西、澳大利亚、印度与中国等国也已在年内陆续降息。预期下半年后,欧洲与美国也 有机会编述再推出稳定经济增长的政策。 就逐末心动而言。通胀上力降低与限聚合值便宜是两大亮点,目前已有包括印度、中国、香港等市场的估值回到去年四季 就逐末心动而言。通胀上力降低与限聚合值便宜是两大亮点,目前已有包括印度、中国、香港等市场的估值回到去年四季							故 也 机械 电脑	与外围设备	月燃料	图像定字如何次包括线图 图形式线像实验或电缆 图形式线像实验或电缆		 	
度水平、提供了相对稳健的投资价值。 测量服务用明结金的业绩表现 本报告期份额净值增长率为限 删 能。同期业绩比较基准收益率为限 燃 验。 维数报告期末基金资产组合情况								公司与经销商 设备与服务 与采矿			为现代保护证据的。 为现代保护证据的。 对此实行证据的。	克姆 克姆 克姆	
序号 员	权益投资 其中階通J	項目	1		金额渊人民币元冤 经减少的债事的概 原数据等现代的情報	占基金总资产的比例测疑 思趣	互助纺织	与工程 储蓄银行与抵押 品 搬装与奢侈品			資數等統立等條機的 資數等統立式立 的關係 因條條仍可容的關係。		
	存托凭证 优先股				万 克人在农业 东亚斯森	s James		零售 減額 19 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1			列克罗列克斯斯斯 列克斯斯斯斯斯斯斯 第二十四万米斯斯斯	が を を で で で で で で で で で で で で で	

电力公用事业

宗合金融服务

信息技术服务

综合电信业务

交通基本设施

通信设备

电子设备剂效器和元件

居家用品

化学制品 经销商

	闭髂贼亚亚尔	分性 和 建	雅趣	三星电子 有限公司	券交易 所	韩国	堀	医动物	列列动脉致线圈	数		
圆	栽胚 哉杂	茶起攤	能 然上 就能排棄可 學到種	原	纽约证 券交易 所	美国	猿趾	NEW N	独剧和 影響相	284 1808		
猿	邓魏 华运	母麂!	即數數	友邦保险 控股有限 公司	香港交 易所	中国香港	5個網網網報通過		NEWSTYSIAL I	第三 日		
源	苑配运	栽薬植薬	検 健	腾讯控股 有限公司	香港交 易所	中国香港	员到被线到		网络1988年114	an ins		
缘	细则勾运	tsianet	和煤騰	中国移动 通信集团 公司	香港交 易所	中国香港	180 <u>00</u> 4888		[4]\$\f\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\	(E) (M)		
远	员与运	悦樂猷野河鎌厚 游·游縣		香港长江	香港交 易所	中国香港	Wildlist III		Wiskles out	(B) 月(B)		
苑	苑 總數5运		機能 機能上月排除 記載	中国建设银行股份有限公司	香港交 易所	中国香港	海绵狮山岭			趣 別線		
應	愿 粤籍税		辦外遊	原	印度尼 西亚证 券交易 所	印度尼西亚	MARIE SOLUTION		国情感的新闻的 中位着	建		
怨	同规模证法	匀魅博籠؞燥竇		韩国现代 配韵月 染	韩国证 券交易 所	韩国	列拉姆		0001041008	第 章		
煀	悦を原砸 栽月		(注册) (注册) (注册) (注册) (注册) (注册) (注册) (注册)		泰国证 券交易 所	泰国	THE STATE OF THE S		为 解注象的系统	統 成		
序号		基金名称					运作方式	管理	E 人		公允价值 队民币元冤	占基金资产
员	规함	MacARIN 社主演绎 ELVINE			粒	裁。 防線	residence and their	/ 清美中國美国五洲地區		净值比例测额		
	园投资组合报 通数报告期内: 干谴责、处罚的						開發的推翻		所能認識这些事務 。			
受到公开 網票	國 报告期内	情形。 本基金投資					监管部门		填網網接近過度 問查,或在本报告 金額渊、民币	编制日前一年		
受到公开 编辑 编辑	機(报告期内) 機(其他各项) 号]情形。 本基金投资 资产构成		1股票没有起			监管部门]查,或在本报告	编制日前一年元冤		
受到公开 编 统 将 统	原製报告期内ス 原験其他各項3 号 品 存出の 应收证	I情形。 本基金投资 资产构成 录证金 E券清算影	资的前十名	1股票没有起			监管部门		图查,或在本报告	海 編制日前一年 元 冤		
受到公开 網 網 序 ·	一個 一回 一回 一回 一回 一回 一回 一回]情形。 本基金投资 资产构成 录证金 E券清算夢 设利	资的前十名	1股票没有起			监管部门		图查,或在本报告	房籍 編制日前一年 元冤 長		
受到公开 網攤 網攤 序 5 四 数	國制报告期内2 國際其他各项3 号 存出的 应收证	1情形。 本基金投资 资产构成 是证金 E券清算器 设利	资的前十名	1股票没有起			监管部门		图查,或在本报告	海		
受到公开 網 網 序 ·	國制报告期内2 國際其他各项3 号 存出的 应收证	1情形。 本基金投资 资产构成 是证金 E券清算器 设利	资的前十名	1股票没有起			监管部门		图查,或在本报告	海		
受到公子 // / / / / / / / / / / / / / / / / / /	動物 报告期内项	1情形。 投资产格成 基正券清算基 及利 1息 以 10 以 数数	资的前十名	1股票没有起			监管部门		割查,或在本报告 金额渊\民币	方線 編制目前一名 元冤		
受到公开 编版 编版 序 页 页 图 報 過	動物 报告期内项	1情形。 投资产格成 基正券清算基 及利 1息 以 10 以 数数	资的前十名	1股票没有起			监管部门		割查,或在本报告 金额渊\民币	方線 編制目前一名 元冤		
受到公共 網 房中	胸膜状告期内对 可以 可以 可以 可以 可以 可以 可以 可以 可以 可以	1情形。 投资产格成 基正券清算基 及利 1息 以 10 以 数数	资的前十名	1股票没有起			监管部门		別查,或在本报告 金额渊、民币	元冤 長衛軍機構發現 物 後衛致國國 等學教 通等 計劃 海軍被關 國 通車電學官等的 教教 長		
受到	胸膜状告期内对 可以 可以 可以 可以 可以 可以 可以 可以 可以 可以	情形。	答的前十名 一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	,股票没有美 名称 可转转换债的可受强通告 描述之和 等	各出基金合 等明细 资券。 记入的说明 记入情况。 合计数 可移	同规定的备	选股票库		別查,或在本报告 金额渊、民币	海 制日前一年 元冤 及 養症與根據與 海球局 通球局 海球局 海球 海球局 海球 海球 海球 海球 海球 海球 海球 海球 海球 海球 海球 海球 海球		
受到 3	一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	情形。	答的前十名 一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	,股票没有美 名称 可转转换债的可受强通告 描述之和 等	各出基金合 等明细 资券。 记入的说明 记入情况。 合计数 可移	同规定的备	选股票库		別查,或在本报告 金额渊、民币	身織 制目前一年 元冤		
受到 4	一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	情形。 投资 是 正 沒 則 即 取 图 图 表 於 歌 歌 歌 歌 歌 歌 歌 歌 歌 歌 歌 歌 歌 歌 歌 歌 歌 歌	答的前十名 一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	,股票没有美 名称 可转转换债的可受强通告 描述之和 等	各出基金合 等明细 资券。 记入的说明 记入情况。 合计数 可移	同规定的备	选股票库		別查,或在本报告 金额渊\民币	分類 結制日前一年 元 定		

公司名称 所在证 所属国家 渊中文冤 券市场 渊地区冤

上投摩根基金管理有限公司 二〇一二年七月十九日

澳門建設部施