

## 上投摩根阿尔法股票型证券投资基金

## 2012 第一季度 报告

2012年3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  
报告期截止日:二〇一二年四月二十四日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事及董事会对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责任。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据《基金合同》的有关规定，于2012年4月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告，保证复核结果与本报告一致。  
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。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	上投摩根阿尔法股票
基金主代码	377010
交易代码	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	1,524,727,877.86份

投资目标	本基金在强调风险控制的前提下，通过“成长”与“价值”双重量化指标进行股票选择。在基于以下三个选股模块中，精选个股，纪律执行，构造出相对均衡的不同的风格资产组合。同时结合公司质地、行业布局、风格因子等多方面的分析，精选个股，纪律执行，构造出相对均衡的选股策略，从而实现对不同风格资产的配置。
投资策略	本基金分三个部分对资产配置比例进行合理的投资理念安排，依据中国资本市场的具体特征，引起海外市场成功运用的“Dynamic Fund”基金产品概念。具体而言，本基金将通过量化指标分析为基础，通过严格的证券投资选择，积极寻求在不同风格资产中寻找最佳的配置机会，结合严谨的风格监控，不断寻求超越行业平均基准的绝对收益。
业绩比较基准	当时中国A股×80%+美元存续利率×20%
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金产品。
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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)			
1.本期已实现收益	-117,029,676.07				
2.本期利润	-81,315,266.48				
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0536				
4.期末基金份额净值	3,335,938,801.80				
5.期末基金份额净值	2,1879				

注:本报告期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,本期利润为当期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)减去公公平值变动收益后的余额。

注:基金利润为本期利润与前期利润之和,基金本期利润=基金本期已实现收益+本期已分配利润。

注:上证综指是根据中国证监会规定的指数编制规则计算出来的,基点为1000点,基期为1991年12月19日,单位:点。

注:基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

注:基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

注:基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。