

上投摩根成长先锋股票型证券投资基金

2011 年半年度报告

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。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
5	托管人报告.....	11
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
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.....	11
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1	资产负债表.....	12
6.2	利润表.....	13
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4	报表附注.....	15
7	投资组合报告.....	28
7.1	期末基金资产组合情况.....	28
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	29
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	30
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
7.6	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.....	35
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	36
7.8	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.....	36
7.9	投资组合报告附注.....	36
8	基金份额持有人信息.....	37
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	37

9	开放式基金份额变动.....	37
10	重大事件揭示.....	38
10.1	基金份额持有人大会决议.....	38
10.2	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.....	38
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4	基金投资策略的改变.....	38
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	38
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	38
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8	其他重大事件.....	40
11	备查文件目录.....	40
11.1	备查文件目录.....	40
11.2	存放地点.....	41
11.3	查阅方式.....	41

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根成长先锋股票型证券投资基金
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	2,337,125,169.59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	<p>(1) 股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>(2) 固定收益类投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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@ccb.cn
客户服务电话		400-889-4888	010-67595096
传真		021-68881170	010-66275853
注册地址		上海市富城路 99 号 20 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市富城路 99 号 20 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		陈开元	郭树清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》 《中国证券报》 《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上投摩根基金管理有限公司	上海市富城路 99 号 20 楼

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）
本期已实现收益	-124,049,803.17
本期利润	-508,630,011.70

加权平均基金份额本期利润	-0.2079
本期加权平均净值利润率	-14.40%
本期基金份额净值增长率	-13.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	868,046,397.34
期末可供分配基金份额利润	0.3714
期末基金资产净值	3,205,171,566.93
期末基金份额净值	1.3714
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	91.59%

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
过去一个月	3.28%	0.98%	2.42%	0.98%	0.86%	0.00%
过去三个月	-5.36%	0.96%	-4.55%	0.90%	-0.81%	0.06%
过去六个月	-13.11%	1.16%	-4.92%	1.02%	-8.19%	0.14%
过去一年	-2.84%	1.31%	20.49%	1.15%	-23.33%	0.16%
过去三年	-4.98%	1.53%	11.67%	1.65%	-16.65%	-0.12%
自基金合同生效起至今	91.59%	1.77%	86.54%	1.75%	5.05%	0.02%

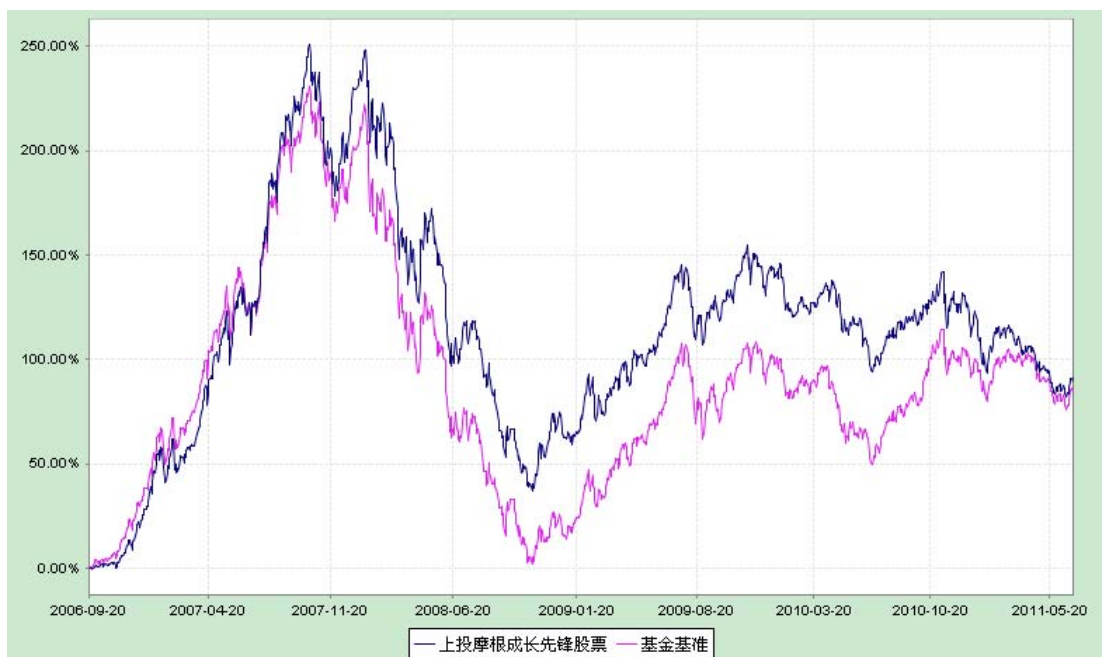
注：本基金的业绩比较基准为：富时中国 A600 成长指数×80%+同业存款利率×20%

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6月30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 6 月 30 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。

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		

许运凯	本基金 基金经 理、投 资副总 监	2008-12-27	-	10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月起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月起同时担任上投摩根行业轮动股票型证券投资基金基金经理。
唐倩	本基金 基金经 理	2011-4-28	-	11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。
赵梓峰	本基金 基金经 理	2007-3-20	2011-5-25	17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	-	6年	华东师范大学经济学硕士，2003年至2006年任华宝兴业基金管理公司行业研究员，从事房地产、商业零售、纺织服装等行业研究，2006年12月加入上投摩根基金管

					理有限公司，曾任职行业专家，负责地产、纺织服装行业研究。
--	--	--	--	--	------------------------------

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。

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合规守信情况的说明

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。

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

一季度，本基金的持股结构相对集中于机械、医药和消费品，而市场的强势板块集中于金融、地产、水泥等周期股，因此表现相对落后于市场。二季度开始，本基金进行了较大程度的调仓。一方面，增加了部分业绩表现良好的汽车、家电以及金融地产的配置，另一方面，对于基本面得不到支持的海工等板块给予减持。因此，在二季度初有一定的调整压力。但四月份以来，一方面对于汽车地产等低估值的周期股把握了阶段性的机会，另一方面，增持的商业、电力设备、航空和食品饮料等板块和个股表现较好。整体业绩有所提升。

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-13.11%，同期业绩比较基准收益率为-4.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，市场整体呈现出政策偏紧、流动性受限的特点。下半年，预计三季度仍然为高通胀、紧流动性的特点，股票市场的整体运行空间有限。在企业盈利方面，由于周期品的价格存在下行空间，预计周期行行业的企业盈利也有下调的可能；消费品而言，目前的趋势尚好，大多呈现稳定增长的态势；另外，未来的产业发展重点包括新能源、节能环保、水利等也会存在投资机会。

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投资基金行业从业经验。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关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：上投摩根成长先锋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	475,390,155.98	216,179,526.48
结算备付金		4,694,387.98	13,334,710.51
存出保证金		4,436,738.08	2,329,937.24
交易性金融资产	6.4.7.2	2,725,452,199.96	3,881,937,637.46
其中：股票投资		2,575,502,199.96	3,679,047,316.26
基金投资		-	-
债券投资		149,950,000.00	202,890,321.20
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	-	9,500,214.25
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	4,998,570.45	7,303,978.05
应收股利		2,658,012.92	-
应收申购款		55,560.11	326,430.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,217,685,625.48	4,130,912,434.84
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		-	54,420,908.58
应付赎回款		1,976,612.68	2,519,731.04
应付管理人报酬		3,853,066.22	5,294,421.76
应付托管费		642,177.70	882,403.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,157,206.43	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	6.4.7.8	1,258,995.52	1,422,580.79
负债合计		12,514,058.55	73,067,978.36
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,337,125,169.59	2,570,812,569.64
未分配利润	6.4.7.10	868,046,397.34	1,487,031,886.84
所有者权益合计		3,205,171,566.93	4,057,844,456.48
负债和所有者权益总计		3,217,685,625.48	4,130,912,434.84

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3714 元，基金份额总额 2,337,125,169.59 份。

6.2 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 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		-458,537,373.15	-1,000,510,123.75
1.利息收入		5,675,792.49	7,785,695.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,351,613.19	2,921,410.16
债券利息收入		3,643,681.17	4,864,285.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		680,498.13	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-79,762,290.61	-99,064,006.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-95,874,893.05	-126,535,675.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,051,100.23	46,840.60

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	18,163,702.67	27,424,828.82
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-384,580,208.53	-909,712,307.14
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	129,333.50	480,494.23
减：二、费用		50,092,638.55	74,519,202.21
1. 管理人报酬		26,376,433.16	38,455,460.76
2. 托管费		4,396,072.24	6,409,243.53
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	19,090,784.34	29,325,238.71
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	6.4.7.19	229,348.81	239,185.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-508,630,011.70	-1,075,029,325.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-508,630,011.70	-1,075,029,325.96

6.3 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 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）	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）	-	-508,630,011.70	-508,630,011.70
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）	-233,687,400.05	-110,355,477.80	-344,042,877.85
其中：1.基金申购款	43,845,422.25	19,572,331.27	63,417,753.52

2.基金赎回款	-277,532,822.30	-129,927,809.07	-407,460,631.37
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)	2,337,125,169.59	868,046,397.34	3,205,171,566.93
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)	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)	-	-1,075,029,325.96	-1,075,029,325.96
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)	-336,576,821.33	-223,552,035.74	-560,128,857.07
其中：1.基金申购款	80,196,860.03	49,996,241.79	130,193,101.82
2.基金赎回款	-416,773,681.36	-273,548,277.53	-690,321,958.89
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)	3,083,476,699.19	1,268,784,722.96	4,352,261,422.15

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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的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 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 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告相一致。

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收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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	475,390,155.98
定期存款	-
其他存款	-
合计	475,390,155.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,553,054,506.95	2,575,502,199.96	22,447,693.01	
债券	交易所市场	9,976,000.00	9,982,000.00	6,000.00
	银行间市场	140,498,720.00	139,968,000.00	-530,720.00
	合计	150,474,720.00	149,950,000.00	-524,720.00
资产支持证券	-	-	-	

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,703,529,226.95	2,725,452,199.96	21,922,973.01

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	73,151.89
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,112.50
应收债券利息	4,923,301.37
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	4.69
其他	-
合计	4,998,570.45

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,156,287.18
银行间市场应付交易费用	919.25
合计	4,157,206.43

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	1,000,000.00
应付赎回费	2,720.63
预提费用	208,274.89

其他	48,000.00
合计	1,258,995.52

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,570,812,569.64	2,570,812,569.64
本期申购	43,845,422.25	43,845,422.25
本期赎回（以“-”号填列）	-277,532,822.30	-277,532,822.30
本期末	2,337,125,169.59	2,337,125,169.59

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,008,632,298.85	-521,600,412.01	1,487,031,886.84
本期利润	-124,049,803.17	-384,580,208.53	-508,630,011.70
本期基金份额交易产生的变动数	-181,324,817.20	70,969,339.40	-110,355,477.80
其中：基金申购款	33,917,268.03	-14,344,936.76	19,572,331.27
基金赎回款	-215,242,085.23	85,314,276.16	-129,927,809.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,703,257,678.48	-835,211,281.14	868,046,397.34

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	82,458.05
其他	125.56
合计	1,351,613.19

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	6,583,732,959.64

买卖股票差价收入	-95,874,893.05
----------	----------------

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	214,582,754.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	207,508,490.00
减：应收利息总额	9,125,364.83
债券投资收益	-2,051,100.23

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	18,163,702.67
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,163,702.67

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1.交易性金融资产	-384,580,208.53
——股票投资	-386,067,257.33
——债券投资	1,487,048.80
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-384,580,208.53

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	107,946.05
转换费收入	21,387.45
合计	129,333.50

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	19,090,134.34
银行间市场交易费用	650.00
合计	19,090,784.34

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	59,507.37
信息披露费	148,767.52
银行费用	12,073.92
债券帐户维护费	9,000.00
合计	229,348.81

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 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	26,376,433.16	38,455,460.76
其中：支付销售机构的客户维护费	3,116,336.03	4,295,334.96

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。

6.4.10.2.2 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	4,396,072.24	6,409,243.53

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。

6.4.10.3 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6月30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6月30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	-	-	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 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	-	-

注：关联方投资本基金费率与公告一致。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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	475,390,155.98	1,269,029.58	762,997,532.76	2,826,971.32

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本报告期，本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
300240	飞力达	11/06/29	11/07/06	新股网上 认购	20.00	20.00	1,500	30,000.00	30,000.00	

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。

6.4.12.2 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	10/12/06	筹划国资改革事宜	35.60	未知	未知	5,653,551	111,569,556.48	201,266,415.60	
000876	新希望	11/06/29	资产重组	19.95	11/07/05	21.95	433,300	8,264,612.12	8,644,335.00	

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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监查和风险评估的评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管，并提出内控建议。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行,与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 6 月 30 日,本基金未持有信用类债券(2010 年 12 月 31 日:本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为 0.06%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	3个月以内	3个月至1年	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	475,390,155.98	-	-	-	-	475,390,155.98
结算备付金	4,694,387.98	-	-	-	-	4,694,387.98
存出保证金	-	-	-	-	4,436,738.08	4,436,738.08
交易性金融资产	110,122,000.00	39,828,000.00	-	-	2,575,502,199.96	2,725,452,199.96
应收利息	-	-	-	-	4,998,570.45	4,998,570.45
应收股利	-	-	-	-	2,658,012.92	2,658,012.92
应收申购款	6,216.37	-	-	-	49,343.74	55,560.11
资产总计	590,212,760.33	39,828,000.00	-	-	2,587,644,865.15	3,217,685,625.48
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	1,976,612.68	1,976,612.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,853,066.22	3,853,066.22
应付托管费	-	-	-	-	642,177.70	642,177.70
应付交易费用	-	-	-	-	4,157,206.43	4,157,206.43
应交税费	-	-	-	-	626,000.00	626,000.00
其他负债	-	-	-	-	1,258,995.52	1,258,995.52
负债总计	-	-	-	-	12,514,058.55	12,514,058.55
利率敏感度缺口	590,212,760.33	39,828,000.00	-	-	2,575,130,806.60	3,205,171,566.93
上年度末 2010年12月31日	3个月以内	3个月至1年	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	216,179,526.48	-	-	-	-	216,179,526.48
结算备付金	13,334,710.51	-	-	-	-	13,334,710.51
存出保证金	-	-	-	-	2,329,937.24	2,329,937.24
交易性金融资产	150,220,000.00	50,239,000.00	-	2,431,321.20	3,679,047,316.26	3,881,937,637.46

应收利息	-	-	-	7,303,978.05	7,303,978.05
应收申购款	16,732.00	-	-	309,698.85	326,430.85
买入返售金融资产	9,500,214.25	-	-	-	9,500,214.25
资产总计	389,251,183.24	50,239,000.00	2,431,321.20	3,688,990,930.40	4,130,912,434.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,519,731.04	2,519,731.04
应付管理人报酬	-	-	-	5,294,421.76	5,294,421.76
应付托管费	-	-	-	882,403.62	882,403.62
应付交易费用	-	-	-	7,901,932.57	7,901,932.57
应交税费	-	-	-	626,000.00	626,000.00
其他负债	-	-	-	1,422,580.79	1,422,580.79
应付证券清算款	-	-	-	54,420,908.58	54,420,908.58
负债总计				73,067,978.36	73,067,978.36
利率敏感度缺口	389,251,183.24	50,239,000.00	2,431,321.20	3,615,922,952.04	4,057,844,456.48

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.68% (2010 年 12 月 31 日：5.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2010 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 70%-95%，债券其它短期金融工具为 0-30%。此外，本基金的基金管理人每日

对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,575,502,199.96	80.35	3,679,047,316.26	90.67
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,575,502,199.96	80.35	3,679,047,316.26	90.67

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除富时中国 A600 成长指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	1.富时中国 A600 成长指 数上升 5%	上升约 11,923	上升约 19,096
	2.富时中国 A600 成长指 数下降 5%	下降约 11,923	下降约 19,096

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	2,575,502,199.96	80.04
	其中：股票	2,575,502,199.96	80.04
2	固定收益投资	149,950,000.00	4.66
	其中：债券	149,950,000.00	4.66

	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	480,084,543.96	14.92
6	其他各项资产	12,148,881.56	0.38
7	合计	3,217,685,625.48	100.00

注：截至2011年6月30日，上投摩根成长先锋股票型证券投资基金资产净值为3,205,171,566.93元，基金份额净值为1.3714元，累计基金份额净值为2.0514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	25,725,920.72	0.80
B	采掘业	93,274,651.14	2.91
C	制造业	1,448,241,275.78	45.18
C0	食品、饮料	152,894,963.01	4.77
C1	纺织、服装、皮毛	85,375,205.11	2.66
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	9,009,905.04	0.28
C4	石油、化学、塑胶、塑料	317,649,888.42	9.91
C5	电子	66,223,590.60	2.07
C6	金属、非金属	117,216,176.97	3.66
C7	机械、设备、仪表	392,268,783.43	12.24
C8	医药、生物制品	307,602,763.20	9.60
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	10,737,381.44	0.34
E	建筑业	53,281,769.79	1.66
F	交通运输、仓储业	75,253,884.80	2.35

G	信息技术业	82,370,020.72	2.57
H	批发和零售贸易	143,467,786.07	4.48
I	金融、保险业	253,399,915.43	7.91
J	房地产业	256,951,946.05	8.02
K	社会服务业	16,549,117.26	0.52
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	116,248,530.76	3.63
	合计	2,575,502,199.96	80.35

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	5,653,551	201,266,415.60	6.28
2	000650	仁和药业	10,181,002	144,875,658.46	4.52
3	600048	保利地产	8,583,041	94,327,620.59	2.94
4	600104	上海汽车	4,844,449	90,784,974.26	2.83
5	600518	康美药业	4,863,066	63,997,948.56	2.00
6	600805	悦达投资	4,203,362	63,050,430.00	1.97
7	601288	农业银行	18,348,400	51,375,520.00	1.60
8	000792	盐湖股份	827,855	48,843,445.00	1.52
9	000538	云南白药	849,953	48,515,317.24	1.51
10	600060	海信电器	3,543,820	47,558,064.40	1.48
11	600009	上海机场	3,646,341	46,673,164.80	1.46
12	600875	东方电气	1,744,923	44,495,536.50	1.39
13	601088	中国神华	1,449,409	43,685,187.26	1.36
14	000002	万科 A	5,142,257	43,452,071.65	1.36
15	600067	冠城大通	4,619,315	42,959,629.50	1.34
16	600000	浦发银行	4,194,092	41,269,865.28	1.29
17	601318	中国平安	817,667	39,468,786.09	1.23
18	000858	五粮液	987,322	35,267,141.84	1.10
19	600016	民生银行	6,101,604	34,962,190.92	1.09
20	600688	S 上石化	3,861,968	34,178,416.80	1.07
21	600036	招商银行	2,561,110	33,345,652.20	1.04
22	600362	江西铜业	925,269	32,791,533.36	1.02

23	601668	中国建筑	7,847,872	31,626,924.16	0.99
24	601989	中国重工	2,234,544	30,814,361.76	0.96
25	002582	好想你	559,111	29,045,816.45	0.91
26	600723	西单商场	2,299,708	28,861,335.40	0.90
27	600029	南方航空	3,645,500	28,580,720.00	0.89
28	600325	华发股份	2,542,474	28,526,558.28	0.89
29	601601	中国太保	1,257,726	28,160,485.14	0.88
30	600031	三一重工	1,515,114	27,332,656.56	0.85
31	600406	国电南瑞	699,980	25,409,274.00	0.79
32	000024	招商地产	1,350,100	24,706,830.00	0.77
33	600177	雅戈尔	2,338,028	23,076,336.36	0.72
34	000669	领先科技	756,710	22,913,178.80	0.71
35	600537	海通集团	611,169	22,381,008.78	0.70
36	601678	滨化股份	1,262,373	22,280,883.45	0.70
37	000726	鲁泰 A	1,999,953	21,899,485.35	0.68
38	002154	报喜鸟	1,618,872	21,692,884.80	0.68
39	000157	中联重科	1,312,923	20,192,755.74	0.63
40	000656	ST 东源	1,460,304	20,006,164.80	0.62
41	000651	格力电器	835,900	19,643,650.00	0.61
42	600376	首开股份	1,453,226	19,197,115.46	0.60
43	601699	潞安环能	562,616	18,459,430.96	0.58
44	600693	东百集团	2,083,231	17,999,115.84	0.56
45	600208	新湖中宝	2,808,952	17,499,770.96	0.55
46	600251	冠农股份	523,642	17,363,968.72	0.54
47	600266	北京城建	1,091,752	16,430,867.60	0.51
48	000417	合肥百货	884,781	16,103,014.20	0.50
49	600778	友好集团	1,248,888	15,311,366.88	0.48
50	002344	海宁皮城	699,741	15,289,340.85	0.48
51	600785	新华百货	562,200	14,999,496.00	0.47
52	002304	洋河股份	115,362	14,554,069.92	0.45
53	600079	人福医药	655,999	14,471,337.94	0.45
54	600690	青岛海尔	514,584	14,382,622.80	0.45
55	600309	烟台万华	741,058	13,865,195.18	0.43
56	002029	七匹狼	425,888	13,500,649.60	0.42
57	600153	建发股份	1,447,386	12,881,735.40	0.40
58	000623	吉林敖东	406,296	12,517,979.76	0.39
59	600403	大有能源	396,568	12,420,509.76	0.39
60	601398	工商银行	2,781,614	12,405,998.44	0.39
61	600859	王府井	306,890	12,266,393.30	0.38
62	300146	汤臣倍健	210,113	11,974,339.87	0.37
63	601766	中国南车	1,658,919	11,811,503.28	0.37

64	600535	天士力	285,948	11,761,041.24	0.37
65	600193	创兴资源	835,748	11,550,037.36	0.36
66	600741	华域汽车	1,030,800	11,472,804.00	0.36
67	600582	天地科技	512,936	11,356,403.04	0.35
68	600587	新华医疗	332,457	10,748,334.81	0.34
69	000422	湖北宜化	473,200	9,904,076.00	0.31
70	000861	海印股份	555,961	9,884,986.58	0.31
71	002131	利欧股份	521,262	9,382,716.00	0.29
72	600050	中国联通	1,784,100	9,366,525.00	0.29
73	600519	贵州茅台	43,178	9,180,938.14	0.29
74	000786	北新建材	573,081	9,117,718.71	0.28
75	600581	八一钢铁	616,504	9,031,783.60	0.28
76	600963	岳阳林纸	1,052,559	9,009,905.04	0.28
77	000639	西王食品	279,812	8,716,143.80	0.27
78	000039	中集集团	396,032	8,665,180.16	0.27
79	000876	新希望	433,300	8,644,335.00	0.27
80	000402	金融街	1,119,043	8,359,251.21	0.26
81	002415	海康威视	199,924	7,855,013.96	0.25
82	600030	中信证券	594,117	7,771,050.36	0.24
83	600475	华光股份	408,319	7,753,977.81	0.24
84	300025	华星创业	530,504	7,644,562.64	0.24
85	002223	鱼跃医疗	299,869	7,355,786.57	0.23
86	601117	中国化学	803,601	7,119,904.86	0.22
87	002051	中工国际	233,856	6,407,654.40	0.20
88	002038	双鹭药业	159,336	6,014,934.00	0.19
89	002236	大华股份	130,656	5,917,410.24	0.18
90	002244	滨江集团	480,499	5,910,137.70	0.18
91	600176	中国玻纤	194,012	5,863,042.64	0.18
92	600600	青岛啤酒	171,400	5,851,596.00	0.18
93	000501	鄂武商 A	339,304	5,795,312.32	0.18
94	600188	兖州煤业	159,900	5,644,470.00	0.18
95	000527	美的电器	306,349	5,633,758.11	0.18
96	000962	东方钽业	222,200	5,543,890.00	0.17
97	000937	冀中能源	218,200	5,531,370.00	0.17
98	600276	恒瑞医药	181,800	5,448,546.00	0.17
99	600795	国电电力	1,820,300	5,388,088.00	0.17
100	600823	世茂股份	367,540	5,377,110.20	0.17
101	601918	国投新集	439,909	5,349,293.44	0.17
102	600489	中金黄金	194,090	5,296,716.10	0.17
103	002001	新和成	179,000	5,271,550.00	0.16
104	000708	大冶特钢	342,791	5,248,130.21	0.16

105	600284	浦东建设	319,119	5,223,978.03	0.16
106	601566	九牧王	240,900	5,205,849.00	0.16
107	000718	苏宁环球	644,725	5,157,800.00	0.16
108	002353	杰瑞股份	78,188	5,074,401.20	0.16
109	600150	中国船舶	67,395	4,986,556.05	0.16
110	002155	辰州矿业	150,900	4,932,921.00	0.15
111	000998	隆平高科	189,600	4,929,600.00	0.15
112	600563	法拉电子	219,225	4,893,102.00	0.15
113	600585	海螺水泥	175,054	4,859,499.04	0.15
114	600765	中航重机	320,900	4,813,500.00	0.15
115	600720	祁连山	258,678	4,718,286.72	0.15
116	601808	中海油服	260,367	4,650,154.62	0.15
117	000562	宏源证券	277,700	4,640,367.00	0.14
118	600498	烽火通信	177,674	4,615,970.52	0.14
119	600675	中华企业	652,600	4,437,680.00	0.14
120	002013	中航精机	208,779	4,342,603.20	0.14
121	601208	东材科技	199,944	4,320,789.84	0.13
122	002419	天虹商场	199,983	4,311,633.48	0.13
123	600331	宏达股份	320,142	4,261,090.02	0.13
124	002123	荣信股份	181,629	4,137,508.62	0.13
125	000568	泸州老窖	90,900	4,101,408.00	0.13
126	600499	科达机电	245,301	3,927,269.01	0.12
127	601118	海南橡胶	278,600	3,432,352.00	0.11
128	000629	攀钢钒钛	300,800	3,329,856.00	0.10
129	000895	双汇发展	48,103	3,178,165.21	0.10
130	002082	栋梁新材	218,710	3,057,565.80	0.10
131	002269	美邦服饰	101,611	3,045,281.67	0.10
132	000530	大冷股份	269,571	2,994,933.81	0.09
133	601888	中国国旅	126,600	2,991,558.00	0.09
134	000009	中国宝安	166,255	2,862,911.10	0.09
135	601010	文峰股份	111,500	2,008,115.00	0.06
136	600895	张江高科	128,700	1,214,928.00	0.04
137	601567	三星电气	50,800	931,672.00	0.03
138	000401	冀东水泥	28,909	722,435.91	0.02
139	300240	飞力达	1,500	30,000.00	0.00
140	601798	蓝科高新	1,000	13,270.00	0.00

注：600723“西单商场”于2011年7月25日起其证券简称变更为“首商股份”。

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	601118	海南橡胶	111,264,547.53	2.74
2	600015	华夏银行	100,774,930.87	2.48
3	600000	浦发银行	98,210,312.76	2.42
4	601890	亚星锚链	96,888,736.81	2.39
5	601088	中国神华	93,806,715.35	2.31
6	600048	保利地产	92,996,469.21	2.29
7	600284	浦东建设	87,301,754.79	2.15
8	600104	上海汽车	86,304,634.44	2.13
9	000002	万科A	80,348,881.64	1.98
10	000792	盐湖股份	79,309,620.84	1.95
11	601699	潞安环能	78,557,077.63	1.94
12	002029	七匹狼	78,266,421.70	1.93
13	000755	山西三维	78,028,707.58	1.92
14	600805	悦达投资	75,599,247.85	1.86
15	600036	招商银行	74,763,689.21	1.84
16	600150	中国船舶	72,885,463.18	1.80
17	002006	精功科技	72,289,088.47	1.78
18	600537	海通集团	68,644,899.71	1.69
19	601288	农业银行	68,438,996.00	1.69
20	600547	山东黄金	68,105,309.32	1.68

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。

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	600518	康美药业	235,729,238.34	5.81
2	601989	中国重工	145,254,826.11	3.58
3	601601	中国太保	143,051,119.66	3.53
4	002304	洋河股份	142,823,476.81	3.52
5	601808	中海油服	134,992,815.14	3.33
6	002168	深圳惠程	128,646,844.85	3.17
7	601118	海南橡胶	126,969,585.53	3.13
8	600499	科达机电	111,270,779.75	2.74
9	601111	中国国航	106,230,077.41	2.62
10	002106	莱宝高科	105,369,338.99	2.60

11	002273	水晶光电	101,468,018.82	2.50
12	000877	天山股份	98,071,516.03	2.42
13	601890	亚星锚链	96,697,151.84	2.38
14	002167	东方锆业	93,162,098.94	2.30
15	600015	华夏银行	90,503,389.85	2.23
16	600123	兰花科创	88,409,383.47	2.18
17	601318	中国平安	87,945,850.37	2.17
18	000780	平庄能源	81,113,411.14	2.00
19	600188	兖州煤业	80,494,881.25	1.98
20	002006	精功科技	80,448,819.10	1.98

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	5,866,255,100.67
卖出股票的收入（成交）总额	6,487,858,066.59

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。

7.5 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	9,982,000.00	0.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	139,968,000.00	4.37
-	其中：政策性金融债	139,968,000.00	4.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	149,950,000.00	4.68

7.6 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	080306	08 进出 06	1,000,000	100,140,000.00	3.12
2	100226	10 国开 26	400,000	39,828,000.00	1.24
3	010110	21 国债(10)	100,000	9,982,000.00	0.31

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 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	4,436,738.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	2,658,012.92
4	应收利息	4,998,570.45
5	应收申购款	55,560.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,148,881.56

7.9.4 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。

7.9.5 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	201,266,415.60	6.28	筹划国企改革事宜
---	--------	------	----------------	------	----------

注：本基金截至 2011 年 6 月 30 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。

7.9.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
106,599	21,924.46	22,236,429.31	0.95%	2,314,888,740.28	99.05%

8.2 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	56,371.54	0.0024%

9 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	43,845,422.25
减：本报告期基金总赎回份额	277,532,822.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,337,125,169.59

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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。

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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	3,676,194,739.70	29.85%	3,124,756.95	30.34%	-
兴业证券	1	2,528,973,417.91	20.54%	2,054,810.09	19.95%	-
国泰君安	2	2,324,100,500.69	18.87%	1,969,666.74	19.12%	-
国金证券	1	1,478,403,093.90	12.01%	1,201,212.49	11.66%	-
平安证券	1	1,074,474,358.58	8.73%	913,305.67	8.87%	-
中金公司	1	903,106,502.37	7.33%	767,640.85	7.45%	-
高华证券	1	329,458,952.61	2.68%	267,688.96	2.60%	-
国开证券	1	-	-	-	-	-

注：

- 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。
- 交易单元的选择标准：
 - 1) 资本雄厚,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。
 - 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。
- 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。
- 2011上半年度本基金新增国开证券席位，无注销席位。

10.7.2 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	2,469,600.00	15.77%	200,000,000.00	50.00%	-	-
兴业证券	57,720.00	0.37%	-	-	-	-

国泰君安	13,128,845.56	83.86%	200,000,000.00	50.00%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1.	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	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券时报》和《中国证券报》	2011年1月29日
2.	上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金所持双汇发展停牌股票估值调整的公告	同上	2011年3月19日
3.	上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金所持双汇发展估值调整的公告	同上	2011年4月21日
4.	上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金经理变更公告	同上	2011年4月28日
5.	上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金经理变更公告	同上	2011年5月25日

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准上投摩根成长先锋股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金托管协议》；
- 4、《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照。

11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

11.3 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。

网址：www.51fund.com

上投摩根基金管理有限公司
二〇一一年八月二十五日