

# 上投摩根中国优势证券投资基金

## 招募说明书（更新）

核准文号：中国证监会证监基金字[2004]83 号文

核准日期：[2004 年 6 月 11 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

### 重要提示：

1. 基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整；
2. 本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险；
3. 投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应当认真阅读本招募说明书；

- 
4. 基金的过往业绩并不预示其未来表现；
  5. 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。
  6. 本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 3 月 14 日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为 2016 年 12 月 31 日。

二零一七年四月

# 上投摩根中国优势证券投资基金招募说明书

## 目录

一、绪言.....	1
二、释义.....	1
三、基金管理人.....	6
四、基金托管人.....	15
五、相关服务机构.....	18
六、基金的募集.....	35
七、基金份额的申购、赎回和转换.....	35
八、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押.....	42
九、基金的投资.....	43
十、基金的业绩.....	54
十一、基金的财产.....	55
十二、基金资产的估值.....	56
十三、基金的收益分配.....	60
十四、基金的费用与税收.....	62
十五、基金的会计与审计.....	63
十六、基金的信息披露.....	64
十七、风险揭示.....	68
十八、基金的终止与清算.....	70
十九、基金合同的内容摘要.....	72
二十、基金托管协议的内容摘要.....	81
二十一、对基金份额持有人的服务.....	85
二十二、其他应披露事项.....	86
二十三、招募说明书的存放及查阅方式.....	87
二十四、备查文件.....	87

# 上投摩根中国优势证券投资基金

## 招募说明书

### 一、绪言

招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》和其他有关法律法规的规定，以及《上投摩根中国优势证券投资基金基金合同》（以下简称“合同”或“基金合同”）编写。

招募说明书阐述了上投摩根中国优势证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人的投资决策有关的全部必要事项，投资者在做投资决策前应仔细阅读招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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，也不保证最低收益。基金根据招募说明书所载明资料发行。

本招募说明书依据基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利义务的法律文件。招募说明书主要向投资者披露与本基金相关事项的信息，是投资者据以选择及决定是否投资于本基金的要约邀请文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其它有关规定享有权利，承担义务。

基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

### 二、释义

在招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

本基金或基金：指上投摩根中国优势证券投资基金；

招募说明书或本招募说明书：指本《上投摩根中国优势证券投资基金招募说明书》及其任何有效修订与更新；

---

基金合同：	指《上投摩根中国优势证券投资基金基金合同》及对该基金合同任何有效修订和补充；
托管协议：	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《上投摩根中国优势证券投资基金托管协议》及对该协议的任何有效修订和补充；
投资基金法：	指《中华人民共和国证券投资基金法》；
元：	指人民币元；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
银行业监督管理机构：	指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会；
基金合同当事人：	指受基金合同约定，根据基金合同享有权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；
基金管理人：	指上投摩根基金管理有限公司；
基金托管人：	指中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）；
基金销售业务：	指基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务；
基金销售代理人：	指具有开放式基金销售代理资格，依据有关销售代理协议办理基金申购、赎回和其它基金业务的代理机构；
基金销售机构：	指基金管理人及基金销售代理人；

---

基金销售网点：	指基金管理人的直销中心及基金销售代理人的代销网点；
基金注册登记机构：	指基金管理人。在符合法律法规有关规定的情况下，基金管理人可以委托第三方代为办理基金注册与过户登记业务，在此情况下接受该委托的第三方为基金注册登记机构；
基金账户：	指基金注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户；
基金份额持有人：	指根据基金合同及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者；
个人投资者：	指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人；
机构投资者：	指在中国境内依法设立的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织(法律法规及其它有关规定禁止投资于开放式证券投资基金的除外)；
合格境外机构投资者：	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件，经监管部门批准投资于中国证券市场的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其它资产管理机构；
基金投资者：	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者及法律法规允许的其它所有投资者的合称；
基金合同生效日：	指本基金依基金合同规定的条件募集，达到成立条件，并由基金管理人依照《基金法》的规定向中国证监会办理基金备案手续，并获得中国证监会书面确认之日；

---

基金合同终止日：	指基金合同规定的终止事由出现后按照基金合同规定的程序并经中国证监会批准终止基金合同的日期；
基金募集期：	指自基金份额发售之日起到基金合同生效日止的时间段，最长不超过 3 个月；
存续期：	指基金合同生效日至基金合同终止日之间的不定期期限；
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
T 日：	指基金管理人在基金认购、申购和赎回等业务办理时间内收到申请的当日；
T + n 日：	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）；
开放日：	指基金投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
认购：	指在基金募集期内，基金投资者购买本基金基金份额的行为；
申购：	指基金合同生效后，基金投资者购买本基金基金份额的行为；
赎回：	指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件，要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及基金的其它合法收入；

---

基金资产总值：	指基金所购买各类证券价值、银行存款本息和基金应收的申购款项和其他应收款项以及其它投资所形成资产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值：	基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算得出的数值，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定；
基金资产估值：	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定该基金资产净值和基金份额净值的过程；
指定媒体：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报纸、互联网网站或其它媒体；
法律法规：	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、行政规章、地方法规、地方规章及规范性文件；
不可抗力：	指基金合同当事人无法预见、无法克服、无法避免且在基金合同由基金托管人、基金管理人签署之日后发生的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其它自然灾害，战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止或其它突发事件，证券交易所非正常暂停或停止交易等；
基金信息披露义务人：	指基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。



---

定期定额业务：指投资者按照与基金销售机构预先约定的方式、时间和金额申购本基金的业务。

### 三、基金管理人

#### (一)基金管理人概况

本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基本信息如下：

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼

法定代表人：穆矢

总经理：章硕麟

成立日期：2004 年 5 月 12 日

实缴注册资本：2.5 亿元人民币

股东名称、股权结构及持股比例：

上海国际信托有限公司	51%
JPMorgan Asset Management (UK) Limited	49%

上投摩根基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[2004]56 号文批准，于 2004 年 5 月 12 日成立的合资基金管理公司。2005 年 8 月 12 日，基金管理人完成了股东之间的股权变更事项。公司注册资本保持不变，股东及出资比例分别由上海国际信托有限公司 67%和摩根资产管理（英国）有限公司 33%变更为目的的 51%和 49%。

2006 年 6 月 6 日，基金管理人的名称由“上投摩根富林明基金管理有限公司”变更为“上投摩根基金管理有限公司”，该更名申请于 2006 年 4 月 29 日获得中国证监会的批准，并于 2006 年 6 月 2 日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

2009 年 3 月 31 日，基金管理人的注册资本由一亿五千万人民币增加到二亿五千万人民币，公司股东的出资比例不变。该变更事项于 2009 年 3 月 31 日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

基金管理人无任何受处罚记录。

#### (二)主要人员情况

---

1. 董事会成员基本情况：

董事长：穆矢

硕士研究生学历、高级经济师职称。

曾任天津市人大财经委办公室副主任、天津信托投资公司总裁助理、上海浦东发展银行天津分行副行长、行长、党委书记、总行风险管理总部总监、上海浦东发展银行党委委员、副行长。

现任上海浦东发展银行董事会秘书、上投摩根基金管理有限公司董事长。

董事：

董事：Paul Bateman

毕业于英国 Leicester 大学。

历任 Chase Fleming Asset Management Limited 全球总监，摩根资产管理全球投资管理业务 CEO。

现任摩根资产管理全球主席、摩根资产管理委员会主席及投资委员会会员。同时也是摩根大通高管委员会资深成员。

董事：Jed Laskowitz

美国伊萨卡学院学士学位（主修政治）及布鲁克林法学院荣誉法学博士学位。

曾任摩根资产管理亚太区行政总裁。

现任摩根资产管理环球投资管理方案联席总监。

董事：Michael I. Falcon

学士学位（主修金融）。

曾任摩根资产退休业务总监。

现任摩根资产管理环球投资管理的亚太区行政总裁、亚太区基金业务总监、环球投资管理营运委员会成员、集团亚太管理团队、集团投资管理亚太区营运委员会主席。

董事：潘卫东

硕士研究生，高级经济师。

曾任上海市金融服务办公室金融机构处处长（挂职）、上海国际集团有限公司副总裁。

现任上海浦东发展银行股份有限公司副行长、上海国际信托有限公司党委书记、董事长。

董事：陈兵

博士研究生，高级经济师。

---

曾任浦发银行总行个人银行总部财富管理部总经理、上海国际信托有限公司副总经理兼董事会秘书。

现任上海国际信托有限公司党委副书记、副董事长、总经理。

董事：陈海宁

研究生学历、经济师。

曾任上海浦东发展银行金融部总经理助理、公投总部贸易融资部总经理、武汉分行副行长、武汉分行党委书记、行长。

现任上海浦东发展银行总行资产负债管理部总经理。

董事：章硕麟

获台湾大学商学硕士学位。

曾任怡富证券股份有限公司副总经理（现名摩根大通证券）、摩根富林明证券股份有限公司董事长。

现任上投摩根基金管理有限公司总经理。

独立董事：

独立董事：俞樵

经济学博士。

现任清华大学公共管理学院经济与金融学教授及公共政策研究所所长。曾经在加利伯利大学经济系、新加坡国立大学经济系、复旦大学金融系等单位任教。

独立董事：刘红忠

国际金融系经济学博士

现任复旦大学经济学院教授，复旦大学金融研究中心副主任。

独立董事：戴立宁

获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长，东吴大学法学院副教授。

现任北京大学法学院及光华管理学院兼职教授。

独立董事：李存修

获美国加州大学柏克利校区企管博士(主修财务)、企管硕士、经济硕士等学位。

现任台湾大学财务金融学系专任特聘教授。

## 2. 监事会成员基本情况：

监事会主席：赵峥嵘

---

硕士学位，高级经济师。

历任工商银行温州分行副行长、浦发银行温州分行副行长、行长及杭州分行行长等职务。  
现任上海国际信托有限公司监事长、党委副书记。

监事：石恬华

台湾大学财务金融系学士及芝加哥大学布斯商学院硕士。

历任摩根资产管理集团台湾区摩根投顾总经理、摩根投信总经理等职务；现任摩根资产管理集团台湾区负责人暨摩根投信董事长，负责台湾区的资产管理业务。

监事：张军

曾任上投摩根基金管理有限公司交易部总监。

现任上投摩根基金管理有限公司国际投资部总监兼基金经理，管理上投摩根亚太优势混合型证券投资基金和上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金。

监事：万隽宸

曾任上海国际集团有限公司高级法务经理。

现任上投摩根基金管理有限公司首席风险官；尚腾资本管理有限公司董事。

### 3. 总经理基本情况：

章硕麟先生，总经理。

获台湾大学商学硕士学位。

曾任怡富证券股份有限公司副总经理（现名摩根大通证券）、摩根富林明证券股份有限公司董事长。

### 4. 其他高级管理人员情况：

张军先生，副总经理

毕业于同济大学，获管理工程硕士学位。

历任中国建设银行上海市分行办公室秘书、公司业务部业务科科长，徐汇支行副行长、个人金融部副总经理，并曾担任上投摩根基金管理有限公司总经理助理一职。

杜猛先生，副总经理

毕业于南京大学，获经济学硕士学位。

历任天同证券、中原证券、国信证券、中银国际研究员；上投摩根基金管理有限公司行业专家、基金经理助理、基金经理、总经理助理/国内权益投资一部总监兼资深基金经理。

孙芳女士，副总经理

毕业于华东师范大学，获世界经济硕士学位。

---

历任华宝兴业基金研究员；上投摩根基金管理有限公司行业专家、基金经理助理、研究部副总监、基金经理、总经理助理/国内权益投资二部总监兼资深基金经理。

郭鹏先生，副总经理

毕业于上海财经大学，获企业管理硕士学位。

历任上投摩根基金管理有限公司市场经理、市场部副总监，产品及客户营销部总监、市场部总监兼互联网金融部总监、总经理助理。

杨红女士，副总经理

毕业于同济大学，获技术经济与管理博士

曾任招商银行上海分行稽核监督部业务副经理、营业部副经理兼工会主席、零售银行部副经理、消费信贷中心总经理；曾任上海浦东发展银行上海分行个人信贷部总经理、个人银行发展管理部总经理、零售业务管理部总经理。

刘万方先生，督察长。

获经济学博士学位。

曾任职于中国普天信息产业集团公司、美国 MBP 咨询公司、中国证监会。

#### 5、本基金基金经理

杨景喻先生,2009年07月至2011年03月在广发基金管理有限公司担任研究员,自2011年3月起加入上投摩根基金管理有限公司,担任我公司国内权益投资一部基金经理助理,自2015年8月起担任上投摩根中国优势证券投资基金基金经理,2015年12月起同时担任上投摩根新兴服务股票型证券投资基金基金经理,2016年4月起同时担任上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

孟亮先生自2005年9月至2010年4月在上投摩根基金管理有限公司担任研究员,2010年4月至2015年3月在国投瑞银基金管理有限公司担任研究员、基金经理、基金投资部副总监,自2015年3月起加入上投摩根基金管理有限公司,现担任我司国内权益投资一部副总监兼高级基金经理一职。自2015年9月起担任上投摩根智选30混合型证券投资基金基金经理,自2016年4月起同时担任上投摩根中国优势证券投资基金基金经理,自2016年10月起同时担任上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

本基金的历任基金经理为吕俊先生,任职时间为2004年9月15日至2007年8月10日;张英辉先生,任职时间为2004年9月15日至2005年10月11日;梁钧先生,任职时间为2007年8月10日至2008年11月29日;王振州先生,任职时间为2008年11月29日至2011年12月8日;杨安乐先生,任职时间为2007年8月至2013年6月;董红波先生,

---

任职时间为 2013 年 5 月 27 日至 2015 年 2 月 16 日；乐琪先生，任职时间为 2015 年 2 月至 2016 年 4 月。

6. 基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

侯明甫，投资董事；杜猛，副总经理兼投资总监；孙芳，副总经理兼投资副总监；朱晓龙，研究总监；孟晨波，总经理助理兼货币市场投资部总监；赵峰，债券投资部总监；张军，国际投资部总监；黄栋，量化投资部总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

(三) 基金管理人的职责

- 1、 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、 办理基金备案手续；
- 3、 对所管理的不同基金资产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、 编制中期和年度基金报告；
- 7、 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、 办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、 召集基金份额持有人大会；
- 10、 保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、 国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

(四) 基金管理人承诺

- 1、 基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。
- 2、 基金管理人不得从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称“证券法”）及其他有关法律法规的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反证券法及其他有关法律法规行为的发生。
- 3、 基金管理人不得从事下列违反投资基金法的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止法律法规规定的禁止行为的发生：

- (1) 投资于其它基金；

- 
- (2) 以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
  - (3) 动用银行信贷资金从事证券买卖；
  - (4) 违反基金份额持有人的利益，将基金资产用于向第三人抵押、担保、资金拆借或者贷款，按照国家有关规定进行融资担保的除外；
  - (5) 从事证券信用交易，按照国家有关规定进行融资的除外；
  - (6) 以基金资产进行房地产投资；
  - (7) 从事有可能使基金承担无限责任的投资；
  - (8) 从事证券承销行为；
  - (9) 将基金资产投资于与基金托管人或基金管理人具有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
  - (10) 违反证券交易业务规则，操纵和扰乱市场价格；
  - (11) 违反法律法规而损害基金份额持有人利益的行为；
  - (12) 通过股票投资取得对上市公司的控制权；
  - (13) 法律、法规及监管机关规定禁止从事的其它行为。

4、基金管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或基金托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其它基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的材料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，扰乱市场秩序；
- (9) 在公开信息披露中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (10) 其它法律法规以及中国证监会禁止的行为。

5、基金经理承诺

---

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其它第三人谋取不当利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不得以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

#### (五) 内部控制制度：

##### 1、内部控制的原则：

基金管理人内部控制遵循以下原则：

(1) 健全性原则。内部控制应当包括基金管理人的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

(3) 独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，基金管理人基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。基金管理人运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

##### 2、制订内部控制制度应当遵循以下原则：

(1) 合法合规性原则。基金管理人内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。

(2) 全面性原则。内部控制制度应当涵盖基金管理人经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。

(3) 审慎性原则。制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(4) 适时性原则。内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和基金管理人经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

##### 3、基金管理人关于内部合规控制声明书：

(1) 基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；



(2) 基金管理人承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善内部合规控制。

4、风险管理体系：

(1) 董事会下设风险控制委员会，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。

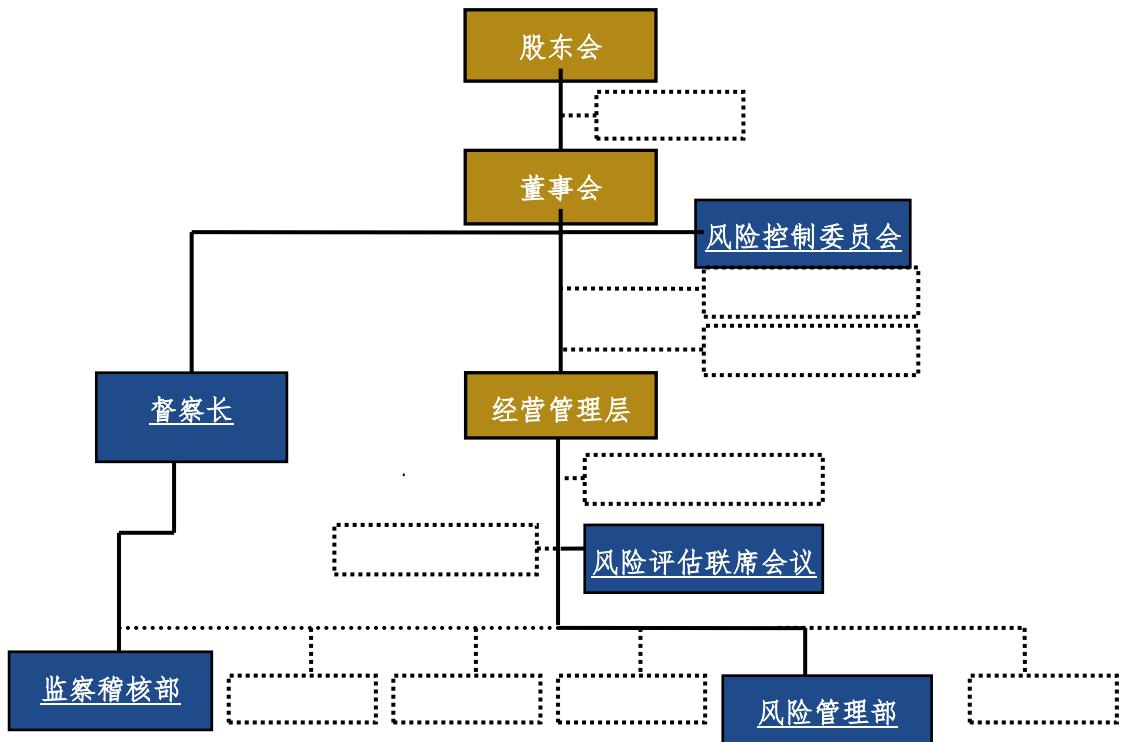
(2) 董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。

(3) 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，评估成员包括经营管理层、督察长、稽核、风险管理、基金投资、基金运作等各部门主管。风险评估联席会议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。

(4) 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。

(5) 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。

(6) 风险管理部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。



---

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2015 年末，本集团资产总额 18.35 万亿元，较上年增长 9.59%；客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元，增长 10.67%；客户存款总额 13.67 万亿元，增长 5.96%。净利润 2,289 亿元，增长 0.28%；营业收入 6,052 亿元，增长 6.09%，其中，利息净收入增长 4.65%，手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%，加权平均净资产收益率 17.27%，成本收入比 26.98%，资本充足率 15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达 1.45 万个，综合营销团队 2.15 万个，综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%，较上年提升 7.55 个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现

---

绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量8,074万张，消费交易额2.22万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产1,000万以上的私人银行客户数量增长23.08%，客户金融资产总量增长32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销5,316亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模7.17万亿元，增长67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计122项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志2015年“世界银行品牌1000强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志2015年度全球企业2000强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常态化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

---

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2016 年一季度末，中国建设银行已托管 584 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自

---

行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## （二）监督流程

1. 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3. 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价，报送中国证监会。

4. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金销售机构：

1. 直销机构：上投摩根基金管理有限公司（同上）

2. 代销机构：

(1) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

传真：010-66275654

(2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

---

客户服务统一咨询电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(3) 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

(4) 中国银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号客户服务电话：95566

法定代表人：田国立

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(5) 招商银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

法人代表：李建红

客户服务中心电话：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(6) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客户服务热线：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(7) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系人：虞谷云

---

联系电话：021-61618888

客户服务热线：95528

网址：www.spdb.com.cn

(8) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路154号

法定代表人：高建平

电话：(021) 52629999

传真：(021) 62569070 客服电话：95561

网址：www.cib.com.cn

(9) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路168号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人：范一飞

联系电话：021-68475888

传真：021-68476111

客户服务热线：021-962888

网址：www.bankofshanghai.com

(10) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人：唐双宁

电话：(010) 63636153

传真：(010) 63639709

客服电话：95595

联系人：李伟

网址：www.cebbank.com

(11) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：孔丹

24小时客户服务热线：95558

网址：bank.ecitic.com

---

(12) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

24小时客户服务热线：95568

网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(13) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

客户咨询电话：95577

网址：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

(14) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：闫冰竹

电话：010-66223584

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

公司网站：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

(15) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人：陆华裕

客户服务统一咨询电话：96528（上海、北京地区962528）

网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

(16) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

客户服务统一咨询电话：40066-99999

网址：[bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

(17) 广发银行股份有限公司



---

住所：广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址：广州市农林下路 83 号

法定代表人：董建岳

电话：020-3832256

传真：020-87310955

客服电话：400-830-8003

网址：<http://www.gdb.com.cn>

(18) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：东莞市南城路 2 号

办公地址：东莞市南城路 2 号

法定代表人：何沛良

客服电话：961122

网址：[www.drcbank.com](http://www.drcbank.com)

(19) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：中国上海市浦东新区浦东大道 981 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-20 21-23 层

法定代表人：冀光恒

门户网站：[www.srcb.com](http://www.srcb.com)

客户服务电话：021-962999

(20) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层（邮编：200031）

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

国际互联网网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

联系人：黄莹

(21) 申万宏源西部证券有限公司

---

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室  
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室（邮编：830002）

法定代表人：李季

电话：010-88085858

传真：010-88085195 客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

联系人：李巍

(22) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

电话：(021) 53686888

传真：(021) 53686100

客户服务电话：021-962518

网址：www.962518.com

(23) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

电话：(021) 38676666 转 6161

传真：(021) 38670161

客户服务咨询电话：95521

网址：www.gtja.com

(24) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

---

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：<http://www.gf.com.cn>

(25) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(26) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(27) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：田薇

电话：010-66568430

传真：010-66568536

客服电话：4008888888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(28) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

电话：(010)65186758

传真：(010)65182261

---

联系人：魏明

客户服务咨询电话：400-8888-108；

网址：www.csc108.com

(29) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

联系人：谢高得

客户服务热线：95562

公司网站：www.xyzq.com.cn

(30) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

联系人：李笑鸣

客服电话：95553

公司网址：www.htsec.com

(31) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：周杨

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(32) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：常喆

---

联系人：李航

客户服务电话：4008188118

网址：www.guodu.com

(33) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

客户咨询电话：95597

联系电话：0755-82492193

网址：www.htsc.com.cn

(34) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

传真：010-60833739

客户服务热线：010-95558

(35) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客户服务热线：95503

东方证券网站：www.dfzq.com.cn

(36) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

法定代表人：周晖

电话：0731-4403343

联系人：郭磊

公司网址：www.cfzq.com

(37) 湘财证券有限责任公司

---

地址：长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

法定代表人：林俊波

电话：021-68634518

传真：021-68865680

联系人：钟康莺

开放式基金客服电话：400-888-1551

公司网址：www.xcsc.com

(38) 中信证券（山东）有限责任公司

注册和办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

(39) 中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：唐新宇

开放式基金咨询电话：4006208888或各地营业网点咨询电话

开放式基金业务传真：021-50372474

网址：www.bocichina.com

(40) 长城证券有限责任公司

住所、办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

电话：0755-83516289

传真：0755-83516199

客户服务热线：400 6666 888

网址：www.cgws.com

(41) 德邦证券股份有限公司

办公地址：上海浦东新区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

---

法定代表人：姚文平

电话：021-68761616

客服电话：4008888128

网址：www.tebon.com.cn

(42) 中国中投证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层  
01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

联系人：刘毅

客户服务热线：95532

网址：www.china-invs.cn

(43) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

联系人：张腾

客户服务热线：0591-96326

公司网址：www.hfzq.com.cn

(44) 中国国际金融有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：金立群

电话：010-65051166

传真：010-65058065

公司网址：www.cicc.com.cn

---

电话：021-58881690

(45) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

客服电话：4008001001

公司网址：www.essence.com.cn

(46) 上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 环球金融中心 9 楼

法定代表人：罗浩

电话：021-38784818

传真：021-68775878

联系人：倪丹

客户服务电话：68777877

公司网站：www.shhxzq.com

(47) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

长江证券客户服务网站：www.95579.com

(48) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层（518048）

法定代表人：詹露阳

电话：021-38631117

传真：021-58991896

客服电话：95511-8



---

网址：<http://stock.pingan.com>

联系人：石静武

(49) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋 2 楼

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

公司网站：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(50) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

公司网站：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(51) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

公司网站：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(52) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

办公地址：杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6 楼

法定代表人：陈柏青

客服电话：400-0766-123

公司网站：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(53) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

---

客服电话：400-1818-188

网站： [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(54) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼

法定代表人：凌顺平

客服电话：4008-773-772

公司网站：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(55) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服电话：4009200022，021-20835588

网站：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

(56) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

客服电话：400-001-1566

网站：[www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

(57) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

客服电话：400-921-7755

网站：[www.leadbank.com.cn](http://www.leadbank.com.cn)

(58) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

---

客服电话：400-820-2819

网站：fund.bundtrade.com

(59) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

客服电话：400-821-9031

网站：www.lufunds.com

(60) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：周斌

客服电话：400-898-0618

网站：www.chtfund.com

(61) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

法定代表人：董浩

客服电话：400-628-1176

网站：www.hongdianfund.com

(62) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

网站：www.yingmi.cn

(63) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：杨懿

---

客服电话：400-166-1188

网站：<http://8.jrj.com.cn/>

(64) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

客服电话：010-62675369

网站：[www.xincai.com](http://www.xincai.com)

(65) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部

法定代表人：江卉

客服电话：4000988511/4000888816

网址：<http://fund.jd.com/>

(64) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：单丙焯

联系电话：021-20691832

传真：021-20691861

客服电话：400-820-2899

公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(65) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

---

联系电话：010-62020088

传真：010-62020035

客服电话：4008886661

公司网址：www.myfund.com

(66) 上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：李一梅

客户服务电话：400-817-5666

传真：010-88066552

(67) 上海万得投资顾问有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号建工大厦 8 楼

法定代表人：王廷富

客户服务电话：400-821-0203

网址：www.520fund.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）基金注册登记机构：

上投摩根基金管理有限公司（同上）

（三）律师事务所与经办律师：

名称：通力律师事务所

注册地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

联系电话：021-3135 8666

传真：021-3135 8600

经办律师：韩炯、秦悦民

（四）会计师事务所：

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

---

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：曹阳

经办注册会计师：陈玲、曹阳

## 六、基金的募集

本基金自 2004 年 8 月 9 日至 9 月 10 日为募集期，本次募集的净销售额为 1,668,842,672.60 元人民币，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 462,362.28 元人民币。

本次募集有效认购总户数为 22,812 户，按照每份基金份额 1.00 元人民币计算，设立募集期募集的有效份额为 1,668,842,672.60 份基金份额，利息结转的基金份额为 462,362.28 份基金份额，两项合计共 1,669,305,034.88 份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

经中国证券监督管理委员会核准，本基金的基金合同于 2004 年 9 月 15 日生效。

## 七、基金份额的申购、赎回和转换

### （一）办理申购、赎回和转换的场所

本基金的基金销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的基金销售代理人。

投资者可以在基金销售机构办理开放式基金业务的营业场所或按基金销售机构提供的其他方式办理基金的申购、赎回和转换。

条件成熟时，基金投资者可通过上投摩根基金管理有限公司或者指定的基金销售代理人以电话或互联网等形式进行申购、赎回和转换。

### （二）申购、赎回和转换的办理时间

本基金在基金合同规定的开放日办理申购、赎回和转换。具体业务办理时间由基金管理人与代销机构约定。

---

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其它特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整并公告。

### （三）申购、赎回和转换的原则

- 1、“未知价”原则，即基金的申购、赎回和转换价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
- 2、基金采用金额申购、份额赎回和份额转出的方式，即申购以金额申请，赎回和转换以份额申请；
- 3、当日的申购、赎回和转换申请应当在当日下午三时之前或基金管理人规定的其它时间之前提出；
- 4、基金的申购、赎回和转换以书面方式或经基金管理人认可的其它方式进行；
- 5、基金管理人在不损害基金份额持有人实质性权益的情况下可更改上述原则，但应最迟在新的原则实施前三个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体予以公告。

### （四）申购、赎回和转换的限制

#### 1、申请申购基金的金额

申购的单笔最低金额为 100 元人民币(含申购费)。

基金投资者将当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

基金投资者可多次申购，法律法规、中国证监会另有规定的除外。

#### 2、申请赎回基金的份额

基金投资者可将其全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，申请赎回份额精确到小数点后两位，每次赎回份额不得低于 100 份，基金账户余额不得低于 100 份，如进行一次赎回后基金账户中基金份额余额将低于 100 份，应一次性赎回。如因分红再投资、非交易过户、转托管、巨额赎回、基金转换等原因导致的账户余额少于 100 份之情况，不受此限，但再次赎回时必须一次性全部赎回。

#### 3、申请转换基金的份额

基金转换的最低份额为 100 份基金份额，基金持有人可将其全部或部分基金份额转换成其它基金，但某笔转换导致在一个代销网点的基金单位余额少于转出基金的最低持有份额时，余额部分基金份额应一同转换，否则将自动作为赎回处理。

基金管理人可根据市场情况调整上述申购、赎回和转换的程序和数额限制，但应最

迟在调整生效前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### （五）申购、赎回和转换的程序

##### 1、申购、赎回和转换的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金销售代理人规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购、赎回和转换的申请。基金销售机构如允许基金投资者进行预约或其他形式的申购、赎回和转换申请，其申请的处理方式按有关业务规定进行。

投资人申购本基金，须按基金销售机构规定的方式足额缴付申购资金。

投资人提交赎回、转换申请时，其在基金销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

##### 2、申购、赎回和转换申请的确认

基金管理人应以在基金申购、赎回和转换的业务办理时间内收到申购、赎回和转换申请的当天作为申购、赎回或转换的申请日（T 日）。一般情况下，投资者可在 T+2 日及之后通过基金管理人的客户服务电话或到其提出申购、赎回和转换申请的网点查询确认情况。

##### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金销售代理人将基金投资者已缴付的申购款项退还给基金投资者。

基金投资者赎回款按有关规定自成交确认日起在 T+7 个工作日内划往赎回人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定范围、特定地域、特定时间、特定交易方式等的基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的基金投资者调低基金申购费率、赎回费率和转换费率。

#### （六）基金的申购费、赎回费和转换费

1、本基金的申购费按申购金额采用比例费率，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。费率表如下：

申购费率：

申购金额区间	费率
--------	----



100 万元以下	1.5%
100 万元（含）以上，500 万元以下	1.0%
500 万元（含）以上	每笔 1000 元

申购费用由申购人承担，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用，费率如下：

持有基金份额期限	费率
小于一年	0.5%
大于等于一年小于两年	0.35%
大于等于两年小于三年	0.2%
大于等于三年	0%

赎回费用由赎回人承担，赎回费的 25% 归基金资产，75% 用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

申购费，赎回费按照四舍五入方法，保留到小数点后 2 位。

### 3、转换费

基金管理人将另行公告各基金之间的转换费率，具体费率及业务规则以基金管理人的业务公告为准。

4、基金管理人可以在符合基金合同规定的范围内调整申购费率、赎回费率和转换费率，最新的费率在更新的招募说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟将于新的费率开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## （七）申购份额、赎回金额和转换份额的计算方式

### 1、申购份数的计算

本基金申购份数的计算方法如下：

---

申购费用 = (申购金额 × 申购费率) / (1 + 申购费率)

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以当日基金份额净值为基准计算,保留到小数点后两位,剩余部分四舍五入,由此产生的误差在基金资产中列支。

## 2、赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中,

赎回总额 = 赎回份数 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

赎回金额保留小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此误差产生的损失由基金资产承担,产生的收益归基金资产所有。

3、T 日的基金份额净值在当天收市后计算,并在 T+1 日公告。遇特殊情况,可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。

## 4、转换份额的计算

基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成,其费率及计算公式以基金管理人的业务公告为准。基金转换费用由基金持有人承担。

### (八) 申购与赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意,基金投资者提出的申购、赎回和转换的申请,在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、基金投资者申购基金成功后,基金注册登记机构在 T+1 日为基金投资者增加权益并办理注册登记手续,基金投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

3、基金投资者赎回基金成功后,基金注册登记机构在 T+1 日为基金投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、基金注册与过户登记人将在 T+1 日对投资者 T 日的基金转换业务申请进行有效性确认。在 T+2 日后(包括该日)投资者可向销售机构查询基金转换的成交情况。

5、基金管理人可在法律法规和基金合同允许的范围内,对上述注册登记办理时间进行调整,并最迟于开始实施前 3 个工作日予以公告。

---

(九) 拒绝或暂停申购、暂停赎回和转换的情形及处理

1、本基金出现以下情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

- (1) 不可抗力；
- (2) 证券交易场所所在交易时间非正常停市；
- (3) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- (4) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- (5) 当基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；
- (6) 法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形。

如果基金投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给基金投资者。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回和转换申请：

- (1) 不可抗力；
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市；
- (3) 暂停基金资产估值或如果基金管理人认为，占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而管理人为保障投资人的利益，已决定延迟准备或采用估值或稍后进行估值；
- (4) 发生巨额赎回，基金合同规定可以暂停接受赎回申请的情形；
- (5) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- (6) 法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付，将按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分由基金管理人按照相应的处理办法在后续开放日予以兑付。

在暂停赎回和转换的情形消除后，基金管理人应及时恢复赎回和转换业务的办理。

3、发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人无正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回和转换申请的，应当报经中国证监会批准。

4、基金暂停申购、赎回和转换的，基金管理人应立即在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

5、暂停期结束，基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间为1天，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定信息披露

---

媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过 1 天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购、赎回和转换时，基金管理人应提前 1 个工作日在至少一种指定信息披露媒体刊登基金重新开放申购、赎回和转换的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购、赎回和转换时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种指定信息披露媒体连续刊登基金重新开放申购、赎回和转换的公告，并在重新开放申购、赎回和转换日公告最新的基金份额净值。

#### （十）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若单个开放日内的基金份额净赎回申请（指基金赎回份额与转出份额之和减去基金申购份额与转入份额之和后的余额）超过前一日基金的基金总份额的 10%，为巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回（即确认成交的）比例不低于本基金基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时明确作出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外，自动转为下一个开放日赎回处理。转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并将以下一个开放日的基金份额净值为准进行计算，并以此类推，直到全部赎回为止。投资者在提出赎回申请时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

（3）当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应当在两日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

---

(4) 连续两日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受本基金的赎回申请；已经接受（即确认成交的）的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

(5) 发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延。

(十一) 为了以备支付基金份额持有人的赎回款项，本基金应当保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

#### (十二) 定期定额投资计划

在各项条件成熟的情况下，本基金可为基金投资者提供定期定额投资计划服务。通过定期定额投资计划，基金投资者可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购本基金基金份额。该定期申购计划不受最低申购份额限制，具体实施方法以基金管理人届时公布的业务规则为准。

### 八、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

(一) 基金注册登记机构只受理继承、遗赠、司法执行等情况下的非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。

- 1、“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；
- 2、“遗赠”指基金份额持有人立遗嘱将其持有的基金份额赠给法定继承人以外的其他人；
- 3、“司法执行”是指根据生效法律文书，有履行义务的当事人（基金份额持有人）将其持有的基金份额依生效法律文书之规定主动过户给其他人，或法院依据生效法律文书将有履行义务的当事人（基金份额持有人）持有的基金份额强制划转给其他人。

(二) 基金投资者办理非交易过户必须到基金注册登记机构或其指定的网点办理。对于符合条件的非交易过户申请按《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》的有关规定办理。

---

(三) 符合条件的非交易过户申请由基金注册登记机构进行确认,该确认一般情况下应在非交易过户申请经审核通过之日起5个工作日内做出;申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

(四) 基金份额持有人可以以同一基金账户在多个基金销售机构申购(认购)基金份额,但必须在原申购(认购)的基金销售机构赎回该部分基金份额。

基金份额持有人可以办理其基金份额在不同基金销售机构的转托管手续。转托管在转出方进行申报,基金投资者于T日转托管基金份额转出成功后,一般情况下转托管份额可于T+1日在转入方网点办理转入手续,基金投资者可于T+3日起赎回该部分基金份额。

(五) 基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的,被冻结部分产生的权益(包括未结转部分收益和红利再投资)一并冻结。

(六) 在有关法律法规有明确规定的情况下,基金管理人将可以办理基金份额的质押业务或其他业务,并会同基金注册登记机构制定、公布和实施相应的业务规则。

## 九、基金的投资

### (一) 投资目标

本基金在以长期投资为基本原则的基础上,通过严格的投资纪律约束和风险管理手段,将战略资产配置与投资时机有效结合,精心选择在经济全球化趋势下具有国际比较优势的中国企业,通过精选证券和适度主动投资,为国内投资者提供国际水平的理财服务,最终谋求基金资产的长期稳定增值。

### (二) 投资理念

随着中国经济正在全方位的融入世界经济,“中国主题”投资概念日益引起全球投资者的密切关注。本基金借鉴摩根富林明资产管理集团150余年的资产管理经验,以国际视野审视中国经济发展,深入分析并挖掘其中行业与公司的比较优势,通过投资资产的灵活动态配置,在实现风险预算管理的基础上,最大限度争取基金投资超额回报。

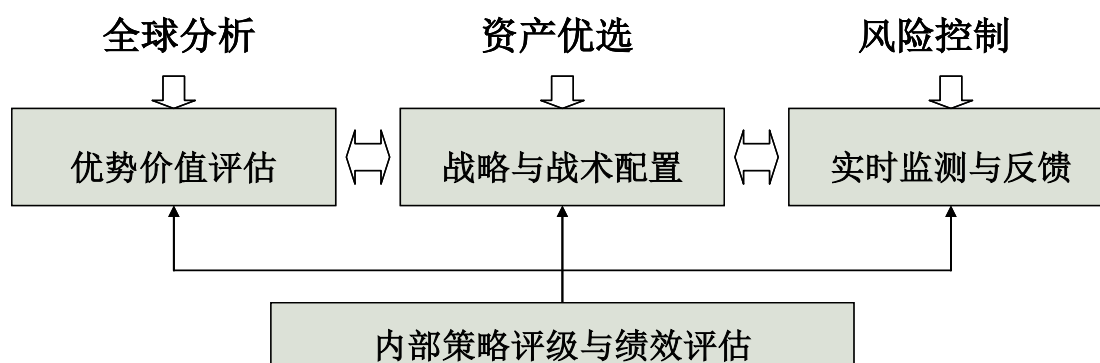
### （三）投资范围

本基金的投资范围为股票、债券及法律法规或中国证监会允许的其它投资品种。股票投资范围为所有在国内依法发行的 A 股，债券投资的主要品种包括国债、金融债、公司债、回购、短期票据和可转换债券以及证监会允许投资的其它债券类品种。在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金资产总值的 30%-95%，投资于债券的比例为基金资产总值的 0-50%，但现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的股票投资重点是那些动态发展比较优势而立基于国际竞争市场的上市公司，该部分投资比例将不低于本基金股票资产的 80%。

今后在有关法律法规许可时，除去以现金形式存在的基金资产外，其余基金资产可全部用于股票投资。

### （四）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，以国际视野审视中国经济发展，将国内行业发展趋势与上市公司价值判断纳入全球经济综合考量的范畴，通过定性/定量严谨分析的有机结合，准确把握国家/地区与上市公司的比较优势，最终实现上市公司内在价值的合理评估、投资组合资产配置与风险管理的正确实施。

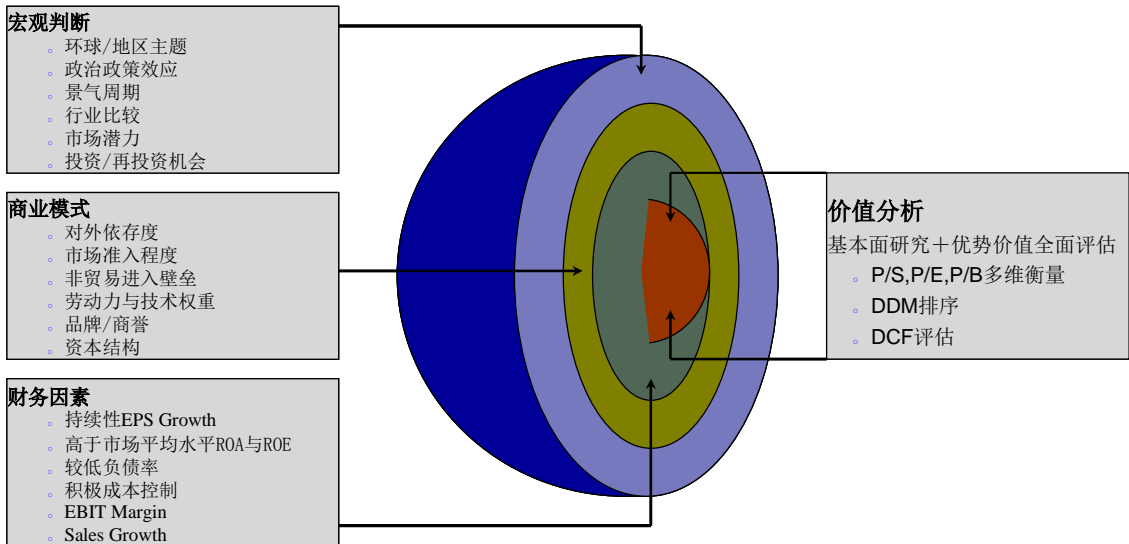


本基金以股票投资为主体，在股票选择和资产配置上分别采取“由下到上”和“由上到下”的投资策略。根据国内市场的具 体特点，本基金积极利用摩根富林明资产管理集团在全球市场的研究资源，用其国际视野观的优势价值评估体系甄别个股素质，并结合本地长期深入的公司调研和严格审慎的基本面与市场面分析，筛选出重点关注的上市公司股票。资产配

置层面包括类别资产配置和行业资产配置，本基金不仅在股票、债券和现金三大资产类别间实施策略性调控，也通过对全球/区域行业效应进行评估后，确定行业资产配置权重，总体紧密监控组合风险与收益特征，以最终切实提高组合的流动性、稳定性与收益性。

## 1. 优势价值分析

摩根富林明资产管理集团长期以来贯彻精细入微的基本面研究，逐日累积利于投资决策的信息优势，结合 DDM (DDRs)、DCF 等价值评估模型，全力辅助合理的证券资产选择。基于摩根富林明的全球性研究资源，本基金通过优势价值评估，综合考察上市公司所具备的比较优势，在对构成上市公司比较优势多方面的因素进行分解研究后，结合其当前的市场表现，来确定个股投资价值与投资时点的判断。根据重点研究的结果，本基金将最终建立明显具备投资价值的备选股票池，并构建出符合本基金投资风格的证券组合。



## 2. 关注五大优势上市公司

根据优势价值综合分析的结果，现阶段本基金将重点关注五大类优势上市公司。

### 1) 具备比较成本优势的上市公司

作为一个发展中国家，中国劳动力成本相对较低的优势将至少在今后一段时间内得到保



---

持。实际上，“全球劳动力套利”令中国成为全球制造业的外包平台之一，中国已是引人瞩目的世界性制造基地，成本优势会继续巩固上市公司市场竞争力。

#### **2) 受惠于多样化与高成长内需优势的上市公司**

中国政府一直致力于刺激内需，国内市场需求的快速增长仍然可以保持相当长时期。其中，消费升级是拉动内需的重要因素之一，住宅、轿车、传媒、娱乐、旅游等需求旺盛都是消费升级的典型表现，相关上市公司将受益匪浅。

#### **3) 具有相对垄断优势的上市公司**

具有垄断特性的上市公司多为行业领袖，它们不仅对市场价格有相对控制力，在长期市场竞争中又拥有较高的成功确定性。现阶段体制创新和结构调整为这些上市公司发展提供新动能，上市公司自身的技术进步和广泛参与深度产业整合更拓展了未来成长空间。

#### **4) 享有中国传统文化优势的上市公司**

具有中国传统文化天然特色的上市公司魅力独特，因为它们的产品是国外上市公司无法生产和替代的。品牌是上市公司独具的稀缺资源，中国的传统品牌上市公司受惠于自成一体的悠久文化，而奠定了上市公司的长期竞争优势。

#### **5) 充分发挥中国自然资源优势的上市公司**

特定地区都有其独特的资源特色，只要善加利用就可以创造出可观的财富。虽然总体而言，中国并不是一个人均资源丰富的国家，但中国在某些领域的资源具备相对优势，也就培养出相应的有投资价值的上市公司。特别是现阶段由于中国自身经济持续增长和世界经济回暖，处于上游地位的大宗原材料及资源类行业拥有良好发展环境，在中国进入重工业时代的背景下，行业运行周期决定了上述行业仍将保持上升期，这些处于产业链最上端的行业在市场中会稳健发展。

### **3. 资产配置策略**

资产配置层面包括类别资产配置和行业资产配置，本基金不仅在股票、债券和现金三大资产类别间实施策略性调控，也通过对全球/区域行业效应进行评估后，确定行业资产配置权重。

在资产配置层面上，基金管理人将首先严谨衡量各类别资产的风险收益特征，随着市场风险相对变化趋势，及时调整互补性资产的分配比例，实现投资组合动态管理最优化。在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金资产总值的 30%-95%，投资于债券的比例为基金资产总值的 0-50%，但现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

---

今后在有关法律法规许可时，除去以现金形式存在的基金资产外，其余基金资产可全部用于股票投资，从而可以在切实控制投资风险的前提下，真正发挥基金管理人主动管理能力，追求最大投资收益。

在行业资产配置层面，本基金在分析全球/区域行业效应后，依据对行业基本面和景气周期的分析预测，同时考虑上市公司的行业成长性，确定基金在一定时期内的行业布局。在此基础上，本基金管理人将实施灵活的行业轮换策略，通过跟踪不同行业的相对价值以及行业景气周期变化等因素，适时调整行业资产配置权重，积极把握行业价值演化中的投资机会。

#### 4. 债券投资管理

配置防御性资产是控制基金组合风险的策略性手段。对于债券资产的选择，本基金将以价值分析为主线，在综合研究的基础上实施积极主动的组合投资，并主要通过类属配置与债券选择两个层次进行投资管理。

在类属配置层次，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的最优权重；

在债券选择上，本基金以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、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，合理运用利率预期、久期管理、换券利差交易、凸性交易与骑乘收益率曲线等投资管理策略，实施积极主动的债券投资管理。

随着国内债券市场的深入发展和结构性变迁，更多债券新品种和交易形式将增加债券投资盈利模式，本基金会密切跟踪市场动态变化，选择合适的介入机会谋求高于市场平均水平的投资回报。

##### （五）业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×70%+中债总指数收益率×30%。

沪深 300 指数是中证指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，或者是市场

---

中出现更具有代表性的业绩比较基准，或者更科学的复合指数权重比例，本基金将根据实际情况在与基金托管人协商一致的情况下对业绩比较基准予以调整。业绩比较基准的变更应履行适当的程序，报中国证监会备案，并予以公告。

#### （六）投资风险

基于适度主动投资的原则，本基金将使用跟踪误差技术，通过投资组合表现与业绩基准表现的动态比较，在把握本基金投资组合的风险来源的基础上，按照调整资产配置比例、调整行业配置比例和调整个股配置比例的控制来控制本基金投资组合的风险。

##### 1、本基金投资组合的风险监控：

本基金投资组合风险将主要来源于资产配置决策、行业配置决策和个股配置决策。因此，本基金相对于业绩基准的跟踪误差可分解如下：

$$TE = TE_{\text{资产配置}} + TE_{\text{行业配置}} + TE_{\text{个股配置}}$$

##### 2、本基金投资组合的风险管理：

在对投资组合表现和业绩基准表现进行动态比较的基础上，本基金将通过层层分解的方式把握投资组合的风险来源，确定资产配置调整策略、行业配置调整策略和个股配置调整策略。

在分解跟踪误差的过程中，本基金将首先确定需要调整的资产类别，再确定需要调整的行业类别，并最终通过个股配置的调整来达到风险控制的目标。

**资产配置调整策略：**在投资组合层面，本基金将基于股票、债券和现金对投资组合跟踪误差的边际贡献，调整本基金在股票、债券和现金之间配置比例。

**行业配置调整策略：**在股票组合层面，本基金将基于不同行业对股票组合跟踪误差的边际贡献，调整本基金股票组合中不同行业的配置权重相对于基准指数行业权重的偏离度。

**个股配置调整策略：**在行业组合的层面，本基金将基于单一行业中不同股票对行业组合跟踪误差的边际贡献，调整本基金在单一行业中的不同个股之间的配置比例。

#### （七）投资决策程序

---

投资决策基本原则是依据基金合同所制定投资基本方针、投资范围及投资限制等，拟订基金投资策略及执行投资计划。适度控制风险及资产安全，并追求投资利得的合理增长，最大限度地保障基金持有人的利益。

公司投资决策采用集体决策模式，并以投资决策会议的形式加以体现。

1. 为提高投资决策效率和专业性水平，公司在经营管理层下设投资决策委员会，作为公司投资管理的核心决策机构。

2. 投资决策委员会以投资管理部核心成员为主体组建，并由投资总监担任主席，其它成员包括部分资深基金经理和研究总监。

3. 投资决策委员会的主要职责是：定期或不定期召开投资决策会议，在依照有关法律法规与基金合同所确定的投资限制纲领的范围内，分析评价投资操作绩效，并在对现有资产配置进行总结的基础上，作出资产配置决议，确定证券评级模式，决定投资对象备选库，作为基金经理进行投资操作的依据。

4. 投资决策委员会对所议内容在成员间达成共识后形成决议，无法达成共识时，由投资决策委员会主席做最后裁定。

5. 投资决策委员会应就每次会议决议情况制作书面报告，向总经理提交，并为监察稽核提供查核依据。

#### （八） 基金的禁止行为

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5、向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6、买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

如法律法规有关规定发生变更，上述禁止行为应相应变更。

#### (九) 基金投资组合比例限制

- 1、 本基金持有一家公司的股票，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；
- 2、 本基金与由基金管理人管理的其它基金持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- 3、 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 4、 股票、债券和现金的投资比例应符合基金合同规定的投资比例限制。

法律法规或中国证监会对上述比例限制另有规定的，应从其规定。

由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在十个交易日内进行调整，以达到标准。

虽有上述比例限制，如今后在有关法律法规许可时，除去以现金形式存在的基金资产外，其余基金资产可全部用于股票投资。

#### (十) 基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法

- 1、 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、 有利于基金资产的安全与增值；
- 3、 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。

#### (十一) 基金的融资

本基金可以按照国家的有关规定进行融资。

#### (十二) 基金的投资组合报告

##### 1、 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
----	----	-------	--------------

1	权益投资	990,810,157.95	87.03
	其中：股票	990,810,157.95	87.03
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	146,973,706.89	12.91
7	其他各项资产	644,496.78	0.06
8	合计	1,138,428,361.62	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	71,137,796.76	6.35
C	制造业	822,405,631.24	73.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	27,725,213.70	2.48
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,692.20	0.02
J	金融业	45,339,237.96	4.05
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	23,897,617.52	2.13
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	990,810,157.95	88.49

3、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002411	必康股份	3,791,763	102,567,189.15	9.16
2	002456	欧菲光	2,659,913	91,181,817.64	8.14
3	300115	长盈精密	3,395,438	88,485,114.28	7.90
4	300136	信维通信	2,155,587	61,434,229.50	5.49
5	603808	歌力思	1,075,600	34,516,004.00	3.08
6	002008	大族激光	1,504,414	33,999,756.40	3.04
7	600104	上汽集团	1,333,408	31,268,417.60	2.79
8	000630	铜陵有色	10,116,300	31,158,204.00	2.78
9	000980	金马股份	1,982,048	28,600,952.64	2.55
10	002640	跨境通	1,515,039	27,725,213.70	2.48

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告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。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 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。

11.2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。

11.3 其他资产项目包括：

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	530,423.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	33,428.39
5	应收申购款	80,644.53
6	其他应收款	-



7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	644,496.78

12 报告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。

13 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明：

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

14 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。

## 十、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

阶段	净值增长率①	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
2005/1/1-2005/12/31	11.32%	0.95%	-5.37%	0.96%	16.69%	-0.01%
2006/1/1-2006/12/31	171.56%	1.55%	85.36%	0.98%	86.20%	0.57%
2007/1/1-2007/12/31	150.25%	2.09%	109.40%	1.60%	40.85%	0.49%
2008/1/1-2008/12/31	-57.24%	2.69%	-43.25%	2.13%	-13.99%	0.56%
2009/1/1-2009/12/31	80.80%	1.45%	67.48%	1.43%	13.32%	0.02%
2010/1/1-2010/12/31	-3.47%	1.27%	-4.20%	1.09%	0.73%	0.18%
2011/1/1-2011/12/31	-25.76%	1.44%	-18.17%	0.92%	-7.59%	0.52%

2012/1/1-2012/12/31	7.13%	1.44%	5.02%	0.91%	2.11%	0.53%
2013/1/1-2013/12/31	-18.20%	1.48%	-2.80%	0.95%	-15.40%	0.53%
2014/1/1-2014/12/31	28.78%	1.31%	38.40%	0.85%	-9.62%	0.46%
2015/1/1-2015/12/31	36.02%	2.93%	5.26%	1.74%	30.76%	1.19%
2016/1/1-2016/12/31	-23.52%	1.98%	-8.44%	0.98%	-15.08%	1.00%

## 十一、基金的财产

### (一) 基金财产的构成

基金财产是由基金所购买各类证券价值、银行存款本息和基金应收的申购款项和其他应收款项以及其它投资所形成资产构成的。

### (二) 基金财产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### (三) 基金财产的账户

经基金管理人和基金托管人协商一致，由基金托管人开立基金专用银行存款账户以及证券账户。开设的基金专用账户与基金管理人和基金托管人、基金销售代理人、基金注册登记机构自有的资产账户以及其它基金的资产账户相独立。

### (四) 基金财产的保管与处分

- 1、基金资产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的固有资产，基金资产相互独立，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人和基金代销机构不得将基金资产归入其固有财产；
- 2、基金管理人、基金托管人和基金代销机构因基金资产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金资产；
- 3、基金管理人、基金托管人和基金代销机构因依法解散、被依法撤消或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金资产不属于其清算财产；
- 4、非因基金资产本身承担的债务，不得对基金资产强制执行；
- 5、基金管理人、基金托管人和基金代销机构以其自有的资产承担其自身的法律责任，其债权人不得对基金资产行使请求冻结、扣押或其它权利。除法律法规和基金合同的规定处分外，基金资产不得被处分。

---

## 十二、基金资产的估值

### (一) 估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### (二) 估值方法

#### 1. 股票估值方法：

(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易场所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

#### (2) 未上市股票的估值：

1) 首次发行未上市的股票，按成本计量；

2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；

4) 非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

(3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(2)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(2)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 2. 固定收益证券的估值方法：

(1) 证券交易所市场交易或挂牌转让的固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与托管人另行协商约定；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的固定收益品种按估值日收盘价减去固定收益品种收盘价中所含的应收利息(自固定收益品种计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交

---

易日固定收益品种收盘价减去固定收益品种收盘价中所含的固定收益品种应收利息得到的净价进行估值；

(3) 发行未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值的估值；

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

(6) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(5)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(5)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(7) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3. 权证估值方法：

(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

未上市交易的权证采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(2) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4. 如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

5. 根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计

---

算结果对外予以公布。

### (三) 估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### (四) 估值程序

1. 基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个开放日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### (五) 估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1. 差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人(“受损方”)按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

#### 2. 差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

---

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金登记结算机构交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

---

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当公告。

(3) 因基金份额净值计算错误,给基金或基金份额持有人造成损失的,应由基金管理人先行赔付,基金管理人按差错情形,有权向其他当事人追偿。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差,以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

#### (六) 暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
2. 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;
3. 如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况,会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的;
4. 中国证监会认定的其它情形。

#### (七) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值予以公布。

#### (八) 特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(6)项或权证估值方法的第(2)项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2. 由于不可抗力原因,或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十三、基金的收益分配

### (一) 收益的构成

1. 买卖证券差价;

- 
2. 基金投资所得红利、股息、债券利息；
  3. 银行存款利息；
  4. 已实现的其他合法收入；
  5. 持有期间产生的公允价值变动。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

## （二）收益分配原则

- 1、 本基金的每份基金份额享有同等分配权。
- 2、 在符合有关基金分配收益条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，至多分配四次；
- 3、 投资者可以选择现金分红方式或分红再投资的分红方式，以投资者在分红权益登记日前的最后一次选择的方式为准，投资者选择分红的默认方式为现金分红；
- 4、 如果基金投资当期出现亏损，则本基金不进行收益分配；
- 5、 全年合计的基金收益分配比例不得低于本基金年度已实现净收益的 90%；
- 6、 法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

## （三）收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

## （四）收益分配方案的确定、公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金管理人公告。

## （五）收益分配中发生的费用

- 1、 收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。
- 2、 收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，基金注



---

册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按分红实施日的基金份额净值转为相应的基金份额。

#### 十四、基金的费用与税收

(一) 与基金运作有关的费用：

与基金运作有关的费用种类如下：

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金的销售服务费；
4. 基金合同生效后的信息披露费；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 与基金相关的会计师费和律师费；
7. 基金证券交易费用；
8. 按照国家有关规定和基金合同规定可以列入的其它费用。

(二) 与基金运作有关费用的计提方法、计提标准和支付方式：

1、基金管理人的基金管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2、基金托管人的基金托管费

在通常情况下，基金的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

---

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支，可以从认购费中列支。若本基金发行失败，发行费用由基金管理人承担。基金合同生效后的各项费用按有关法规列支。

4、本条第（一）款第 3 至第 7 项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

#### （三）不列入基金运作费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

#### （四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金的基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

#### （五）与基金销售有关的费用

与基金销售有关的费用为申购费、赎回费和转换费，该费用具体的计算公式，费率水平参见本招募说明书第六条。

#### （六）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十五、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、 基金管理人为基金的基金会计责任方；
- 2、 基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日，如果基金首次募集成立的当年少于 3 个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、 基金核算以人民币为记账本位币，记账单位是人民币元；
- 4、 会计制度执行国家有关的会计制度和《证券投资基金会计核算办法》；
- 5、 基金管理人应当对本基金独立建账、独立核算；

- 
- 6、 基金管理人及基金托管人各自保留完整的基金会计账目、凭证，按照有关规定编制基金会计报表；
  - 7、 基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

## （二）基金年度审计

- 1、 基金管理人聘请具有证券业从业资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立；
- 2、 会计师事务所更换经办注册会计师时，须事先征得基金管理人同意，并报中国证监会备案；
- 3、 基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，报中国证监会备案后可以更换。基金管理人应当在更换会计师事务所后在 5 个工作日内公告。

## 十六、基金的信息披露

### （一）披露原则

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### （二）基金募集信息披露

- 1、 基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的三日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。
- 2、 基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披

---

露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

- 3、基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。
- 4、基金合同生效后,基金管理人应当在每六个月结束之日起四十五日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的十五日前向中国证监会报送更新的招募说明书,并就有关更新内容提供书面说明。

### (三) 定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制,由基金托管人复核。基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告。基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

- 1、基金年度报告:基金管理人应当在每年结束之日起九十日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。
- 2、基金半年度报告:基金管理人应当在上半年结束之日起六十日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定报刊上。
- 3、基金季度报告:基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足两个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

---

#### （四）临时报告与公告

基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书,予以公告,并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件,是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件:

- 1、基金份额持有人大会的召开;
- 2、提前终止基金合同;
- 3、转换基金运作方式;
- 4、更换基金管理人、基金托管人;
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更;
- 7、基金募集期延长;
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十;
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十;

- 
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
  - 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
  - 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
  - 14、重大关联交易事项；
  - 15、基金收益分配事项；
  - 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
  - 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
  - 18、基金改聘会计师事务所；
  - 19、变更基金销售代理人；
  - 20、更换基金注册登记机构；
  - 21、基金开始办理申购、赎回；
  - 22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
  - 23、基金发生巨额赎回并延期支付；
  - 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

---

25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

26、基金份额上市交易；

27、中国证监会规定的其他事项。

#### （五）公开澄清

在基金合同期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （六）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额代销机构的住所,投资者可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金定期报告公布后,应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所,投资者可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件。

## 十七、风险揭示

### （一）投资于本基金的风险

#### 1、市场风险：

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动,将对本基金资产产生潜在风险,主要包括：

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响,可能导致市场价格波动,从而影响基金收益。

##### （2）经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响,而经济运行具有周期性的特点,而宏观经济运行状况

---

将对证券市场的收益水平产生影响，从而对基金收益产生影响。

### (3) 利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和债券回购，其收益水平可能会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。

### (4) 购买力风险

基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

## 2、信用风险：

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化。

## 3、投资风险：

本基金会受到所投资证券表现的影响。债券尤其是国债的表现相对稳定，但同样会受到诸如宏观经济、政策以及市场本身的影响而造成债券价格变动，企业债和金融债的投资还会受到债券本身信用评级变化的影响，这些都会给投资者带来收益变动的风险。

## 4、流动性风险：

开放式基金要随时应对投资者的赎回，如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值。

## 5、管理风险：

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响基金的收益水平。

## 6、操作或技术风险：

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

## 7、合规性风险：

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金



---

合同有关规定的风险。

8、投资组合剩余期限管理风险：

为了更好保障投资安全性，基金管理人可能委托国际权威的评级机构对本基金进行评级。根据最高级的国际评级标准，中国优势证券投资基金的投资组合平均剩余期限一般为60天，但这样可能导致投资组合平均收益水平下降。

9、其它风险：

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

(二)声明

- 1、 本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。基金投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。
- 2、 除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金代销机构代理销售，但是，基金资产并不是代销机构的存款或负债，也没有经基金代销机构担保收益，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

## 十八、基金的终止与清算

(一) 本基金合同终止事由

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- 1、 基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、 基金管理人职责终止，而在六个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；
- 3、 基金托管人职责终止，而六个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；
- 4、 基金合同规定的其他情况或中国证监会允许的其它情况。

---

## （二）基金财产的清算

### 1、 清算组

- （1） 自基金合同终止之日起 30 个工作日内成立清算组，清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。
- （2） 清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师、相关的中介服务机构以及中国证监会指定的人员组成。
- （3） 清算组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。

### 2、 基金财产清算程序

- （1） 基金合同终止后，由清算组统一接管基金；
- （2） 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3） 对基金财产进行估值和变现；
- （4） 清算组作出的清算报告需经会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书；
- （5） 将基金清算结果报告中国证监会备案并公告；
- （6） 公布基金清算公告；
- （7） 对基金财产进行分配。

### 3、 清算费用

清算费用是指清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算组优先从基金资产中支付。

### 4、 基金财产按下列顺序清偿：

- （1） 支付清算费用；

- 
- (2) 交纳所欠税款；
  - (3) 清偿基金债务；
  - (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按本项第(1)至(3)小项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 5、 基金财产清算的公告

清算组作出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

#### 6、 基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件按国家有关规定保存。

### 十九、基金合同的内容摘要

本上投摩根中国优势证券投资基金基金合同的主要内容如下：

#### (一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务：

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自取得依据基金合同发行的基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。

每一基金份额具有同等的合法权益。

#### 1. 基金份额持有人的权利

- 1) 按基金合同的规定出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，就审议事项行使表决权；
- 2) 按基金合同的规定取得基金收益；
- 3) 按基金合同的规定查询或复制公开披露的基金信息资料；
- 4) 按基金合同的规定赎回基金份额，并在规定的时间内取得有效赎回的款项；
- 5) 参与分配清算后的剩余基金财产；

- 
- 6) 依照法律法规和基金合同的规定, 要求召开基金份额持有人大会;
  - 7) 要求基金管理人或基金托管人及时行使法律法规、基金合同所规定的义务;
  - 8) 对基金管理人、基金托管人损害其合法权益而要求予以赔偿;
  - 9) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

## 2. 基金份额持有人的义务

- 1) 遵守有关法律法规和基金合同的规定;
- 2) 缴纳基金认购、申购和赎回等事宜涉及的款项及规定的费用;
- 3) 以其对基金的投资额为限承担本基金亏损或者终止的有限责任;
- 4) 不从事任何有损基金及本基金其他基金合同当事人合法权益的活动;
- 5) 返还其在基金投资过程中取得的不当得利;
- 6) 法律法规以用基金合同所规定的其它义务。

## 3. 基金管理人的权利

- 1) 依法申请并募集基金;
- 2) 自基金合同生效之日起, 基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金资产;
- 3) 根据法律法规和基金合同的规定, 制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则;
- 4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式, 获得基金管理费, 收取认购费、申购费及其它事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其它费用;
- 5) 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额;
- 6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人, 如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金资产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的, 应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构, 以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益;
- 7) 基金管理人可根据基金合同的规定选择适当的基金销售代理人并有权依照代销协议对基金销售代理人行为进行必要的监督和检查;
- 8) 自行担任基金注册登记代理机构或选择、更换基金注册登记代理机构, 办理基金注册与过户登记业务, 并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查;

- 
- 9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
  - 10) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
  - 11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；
  - 12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；
  - 13) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
  - 14) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
  - 15) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
  - 16) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

#### 4. 基金管理人的义务

- 1) 遵守法律法规和基金合同的规定；
- 2) 恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效管理和运用基金资产；
- 3) 充分考虑本基金的特点，设置相应的部门并配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金资产，防范和减少风险；
- 4) 设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和登记事宜或委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理；
- 5) 设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金的注册与过户登记工作或委托其它机构代理该项业务；
- 6) 建立健全内部控制制度，保证基金管理人的固有财产和基金财产相互独立，对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 7) 除依据法律法规和基金合同的规定外，不得利用基金资产为自己及任何第三方谋取利益；
- 8) 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金管理人不得委托第三人管理、运作基金资产；
- 9) 接受基金托管人依照法律法规和基金合同对基金管理人履行基金合同情况进行的监督；
- 10) 采取所有必要措施对基金托管人违反法律法规、基金合同和托管协议的行为进行纠正和补救；
- 11) 按规定计算并公告基金资产净值及基金份额净值；
- 12) 按照法律法规和基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回、分红款项；

- 
- 13) 严格按照法律法规和基金合同的规定公告招募说明书和基金份额发售公告和履行其他信息披露及报告义务；
  - 14) 保守基金的商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等；除法律法规和基金合同的规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其它监管机构的判决、裁决、决定、命令而做出的披露或为了基金审计的目的而做出的披露不应视为基金管理人违反基金合同规定的保密义务；
  - 15) 依据基金合同规定制订基金收益分配方案并向本基金的基金份额持有人分配基金收益；
  - 16) 不谋求对基金资产所投资的公司控股和直接管理；
  - 17) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
  - 18) 编制基金的财务会计报告；保存基金的会计账册、报表及其它处理有关基金事务的完整记录 15 年以上；
  - 19) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
  - 20) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
  - 21) 监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务。基金托管人因过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金利益向基金托管人追偿，除法律法规另有规定外，不承担连带责任；
  - 22) 基金管理人因违反基金合同规定的目的处分基金资产或者因违背基金合同规定的管理职责、处理基金事务中因过错致使基金资产受到损失的，应当承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
  - 23) 确保向基金份额持有人提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；
  - 24) 负责为基金聘请会计师事务所和律师；
  - 25) 不从事任何有损本基金其它当事人合法权益的活动；
  - 26) 基金不能成立时按规定退还所募集资金本息、并承担发行费用；
  - 27) 法律法规、基金合同或国务院证券监督管理机构规定的其它义务。

## 5. 基金托管人的权利

- 1) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- 2) 监督本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律

---

法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；

- 3) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- 4) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- 5) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金资产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- 6) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

#### 6. 基金托管人的义务

- 1) 基金托管人应遵守法律法规和基金合同的规定，安全保管基金的财产；
- 2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；
- 3) 建立健全内部控制制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人固有资产相互独立，保证其托管的基金资产与其托管的其它基金资产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- 4) 除依据法律法规和基金合同的规定外，不得利用基金资产为自己及任何第三人谋取利益；
- 5) 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产；
- 6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同；
- 7) 按有关规定开立证券账户、银行存款账户等基金资产账户；
- 8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 9) 保守基金的商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等；除法律法规和基金合同的规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其它监管机构的判决、裁决、决定、命令而做出的披露或为了基金审计的目的而做出的披露不应视为基金托管人违反基金合同规定的保密义务；
- 10) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及基金份额申购、赎回价格；
- 11) 对基金财务会计报告，对半年度和年度基金报告出具意见；
- 12) 监督基金管理人的投资运作，发现基金管理人的投资指令违法、违规的，不予执行，并向中国证监会报告；

- 
- 13) 按法律法规和中国证监会的有关规定出具基金托管人报告;
  - 14) 按有关规定, 保存基金的会计账册、报表和其它有关基金托管业务的记录、账册、报表和其他相关资料;
  - 15) 参加基金清算小组, 参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配;
  - 16) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时, 及时报告中国证监会、和银行业监督管理机构, 并通知基金管理人;
  - 17) 监督基金管理人按法律法规和基金合同的规定履行自己的义务; 基金管理人因过错造成基金资产损失时, 基金托管人应为基金利益向基金管理人追偿, 除法律法规另有规定外, 不承担连带责任;
  - 18) 采取适当、合理的措施, 使本基金的认购、申购、赎回等事项符合基金合同等有关法律文件的规定;
  - 19) 采取适当、合理的措施, 使基金管理人用以计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;
  - 20) 采取适当、合理的措施, 使基金投资和融资的条件符合基金合同等法律文件的规定;
  - 21) 因过错导致基金资产的损失或因违背托管职责或者处理基金事务不当对第三人所负债务或者自己受到的损失, 应当承担赔偿责任, 其责任不因其退任而免除;
  - 22) 不从事任何有损本基金其它基金合同当事人合法权益的活动;
  - 23) 法律法规、基金合同和依据基金合同制定的其它法律文件所规定的其它义务。

## (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

### 1. 基金份额持有人大会的召集事项

有以下事由情形之一时, 应召开基金份额持有人大会:

- 1) 修改基金合同或提前终止基金合同, 但基金合同另有约定的除外;
- 2) 提前终止本基金;
- 3) 变更基金类型或转换基金运作方式;
- 4) 更换基金托管人;
- 5) 更换基金管理人;
- 6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准, 但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;



- 
- 7) 本基金与其它基金的合并;
  - 8) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

## 2. 基金份额持有人大会的召集方式

- 1) 除法律法规或基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集,开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。
- 2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起六十日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。
- 3) 代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起六十日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起六十日内召开。
- 4) 代表基金份额百分之十以上(含百分之十)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,代表基金份额百分之十以上(含百分之十)的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前三十日报国务院证券监督管理机构备案。
- 5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

---

### 3. 基金份额持有人大会的议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会批准后生效；在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 10 天公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会批准或备案后生效。

### 4. 基金份额持有大会的表决程序

1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

a) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上(不含三分之二)通过。

b) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的百分之五十以上(不含百分之五十)通过。

转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

3) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4) 采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

5) 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

6) 基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。

### (三) 基金合同解除和终止的事由、程序

有下列情形之一的，基金合同终止：

1) 基金份额持有人大会决定终止的；

2) 基金管理人职责终止，而在六个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；

3) 基金托管人职责终止，而六个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；

4) 基金合同规定的其他情况或中国证监会允许的其它情况。

---

## 基金财产的清算

### 1、清算组

(1) 自基金合同终止之日起 30 个工作日内成立清算组，清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师、相关的中介服务机构以及中国证监会指定的人员组成。

(3) 清算组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。

### 2、基金财产清算程序

(1) 基金合同终止后，由清算组统一接管基金；

(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 清算组作出的清算报告需经会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书；

(5) 将基金清算结果报告中国证监会备案并公告；

(6) 公布基金清算公告；

(7) 对基金财产进行分配。

### 3、清算费用

清算费用是指清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算组优先从基金资产中支付。

### 4、基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按本项第（1）至（3）小项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

---

## 5、基金财产清算的公告

清算组作出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

## 6、基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件按国家有关规定保存。

### （四）争议解决方式

基金合同各方当事人因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议应当通过协商或者调解解决，协商或者调解不能解决的，可向中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

本基金合同受中国法律管辖。

### （五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、基金销售代理人的办公场所和营业场所查阅，也可刊登在基金管理人指定的网站，供投资者查阅。投资者也可按工本费购买基金合同的复制件或复印件，但内容应以基金合同正本为准。

## 二十、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

1. 基金管理人：上投摩根基金管理有限公司（具体信息见本招募说明书第三条）

2. 基金托管人：

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：王洪章

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

---

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## （二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

### 1. 基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

- 1) 基金托管人根据法律法规和基金合同的规定，对本基金的投资范围、基金资产的投资组合、所托管的本基金管理人的所有基金的投资比例、基金资产净值的计算、基金管理费和基金托管费的计提和支付等事项进行监督和核查。
- 2) 基金托管人发现基金管理人的行为违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。
- 3) 基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

### 2. 基金管理人基金托管人的业务监督、核查

- 1) 根据法律法规和基金合同的规定，基金管理人基金托管人及时执行基金管理人合法合规的投资指令、妥善保管基金的全部资产、按时将赎回资金和分红收益划入专用清算账户、对基金资产实行分账管理、擅自动用基金资产等行为进行监督和核查。
- 2) 基金管理人发现基金托管人的行为违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。
- 3) 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

### 3. 基金托管人与基金管理人在业务监督、核查中的配合、协助

基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或

---

采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

### （三）基金财产的保管

#### 1、基金财产的保管原则

- 1) 基金托管人应安全保管基金财产。
- 2) 基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户和证券账户，对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 3) 基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产，如有特殊情况双方可另行协商。
- 4) 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。
- 5) 基金托管人应当设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责基金资产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险。
- 6) 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产。

#### 2、基金募集期间及募集资金的验资

- 1) 基金募集期间的资金应存于基金管理人在基金托管行的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。
- 2) 基金募集期满，基金管理人应将属于基金资产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户中，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。
- 3) 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

#### 3、基金银行账户的开立和管理

- 1) 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。
- 2) 基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

---

3) 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4) 在符合法律法规规定的条件下, 基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

#### 4、基金证券账户的开立和管理

1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2) 基金证券账户的开立和使用, 限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户, 亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责, 管理和运用由基金管理人负责。

#### 5、债券托管专户的开设和管理

1) 基金合同生效后, 由基金管理人向基金托管人提出申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定, 在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户, 并代表基金进行银行间市场债券的结算。

2) 基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议, 正本由基金托管人保管, 管理人保存副本。

#### 6、其他账户的开立和管理

1) 因业务发展而需要开立的其他账户, 可以根据法律法规和基金合同的规定, 由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

2) 法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的, 从其规定办理。

#### 7、基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库; 也可以存入中国证券登记结算有限责任公司及其他有权保管机构的代保管库中。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让, 由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

#### 8、与基金资产有关的重大合同的保管

与基金资产有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。重大合同包括基金合同、托管协议(及其附件)。

### (四) 基金资产净值计算与复核

1. 基金份额净值是按照每个开放日闭市后, 基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算, 精确到 0.0001 元, 小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的, 从其规定。

---

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个开放日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （五）基金份额持有人名册的登记与保管

基金注册登记机构负责编制和保管基金份额持有人名册。基金合同生效日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权利登记日、每月最后一个开放日的基金份额持有人名册，由基金注册登记机构负责编制。

基金管理人对其基金份额持有人名册的保管，按国家法律法规及证券监督管理部门的要求执行。

#### （六）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

#### （七）托管协议的修改与终止

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。修改后的新协议，报中国证监会备案后生效，须经证监会批准的，经其批准后生效。

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）基金或本基金基金合同终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人将根据基金份额持有



---

人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

（一）资料寄送

1. 基金投资者对账单：

基金管理人将向发生交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式定期或不定期寄送对账单。

2. 其他相关的信息资料。

（二）多种收费方式选择

基金管理人在合适时机将为基金投资者提供多种收费方式购买本基金，满足基金投资者多样化的投资需求，具体实施办法见有关公告。

（三）基金电子交易服务

基金管理人为基金投资者提供基金电子交易服务。投资人可登录基金管理人的网站(www.cifm.com)查询详情。

（四）联系方式

上投摩根基金管理有限公司

咨询电话：021-3879 4888，4008894888

网址：www.cifm.com

## 二十二、其他应披露事项

1. 2016年9月24日，上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告；
2. 2016年11月5日，上投摩根基金管理有限公司关于增聘高级管理人员的公告；

上述公告均刊登于《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》及基金管理人公司网站上。

---

### 二十三、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人和基金代销机构的办公场所和营业场所，基金投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

### 二十四、备查文件

- (一) 中国证监会批准上投摩根中国优势证券投资基金募集的文件
- (二) 上投摩根中国优势证券投资基金基金合同
- (三) 上投摩根中国优势证券投资基金托管协议
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则
- (八) 中国证监会要求的其他文件

上述备查文件存放在基金管理人和基金代销机构的办公场所和营业场所，基金投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

上投摩根基金管理有限公司

2017年4月