上投摩根中国优势证券投资基金

招募说明书(更新)摘要

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.本招募说明书摘要所载内容截止日为2010年9月14日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2010年6月30日。

二零一零年十月

一、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:上海市浦东富城路99号震旦国际大楼20层

办公地址:上海市浦东富城路99号震旦国际大楼20层

法定代表人:陈开元

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%和摩根富林明资产管理(英国)有限公司33%变更为目前的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。

2007年10月8日,基金管理人股东"上海国际信托投资有限公司"更名为"上海国际信托有限公司"。

2009年3月31日,基金管理人的注册资本金由一亿五千万元人民币增加到二亿五千万元人民币,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:

陈开元先生,董事长

大学本科学历。

先后任职于上海市财政局第三分局,共青团上海市财政局委员会,英国伦敦Coopers & Lybrand咨询公司等,曾任上海市财政局对外经济财务处处长、上海国际集团有限公司副总经理,现任上投摩根基金管理有限公司董事长。

独立董事4名:

独立董事:周道炯

大学专科学历,曾就学于安徽省委马列夜大学、中共安徽省委中级党校进修班、中共中央高级党校培训班。

曾任中国证监会主席、中国建设银行行长、九届全国人大财经委委员。

现任PECC中国金融市场发展委员会主席。周道炯先生长期从事证券金融市场监管工作,目前作为高级顾问为证券市场改革提供顾问咨询意见。

独立董事:姜波克

博士学历,自1985年起任职于复旦大学。现任复旦大学教授,复旦大学国际金融研究中心主任。

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。

历任台湾财政部常务次长。

现任台湾东吴大学专任客座副教授。

独立董事:周文耀

获香港大学工商管理学硕士学位。

曾任香港联合交易所行政总裁、汇丰资产管理(香港)有限公司亚太区行政总裁。

董事6名:

董事:Clive Brown

获布里斯托大学理学学士学位。

历任JF资产管理亚太区(不包括日本)首席执行官。

现任摩根富林明资产管理国际首席执行官,主管欧洲、亚洲及日本投资管理业务。

董事:许立庆

获台湾政治大学工商管理硕士学位。

历任摩根富林明台湾业务董事长。

现任摩根资产管理亚太区首席执行官。

董事:邵自力

获澳大利亚墨尔本大学法学硕士学位。

曾任年利达律师事务所亚洲管理合伙人。

现任摩根大通银行中国区主席及首席执行官

董事:杨德红

获复旦大学经济学学士,中欧工商管理学院MBA。

现任上海国际集团有限公司副总经理。

董事:林彬

获中欧工商管理学院MBA。

曾任香港沪光国际投资管理有限公司副总经理。

现任上海国际信托有限公司副总经理。

董事:刘啊东

获上海财经大学硕士学位。

历任上海国际信托有限公司部门经理。

现任上海国际信托有限公司副总经理。

2. 监事会成员基本情况:

监事长:郭平

法律专业,本科学历,高级职称。

曾任黄浦区人民检察院检察长、浦东新区人民检察院代检察长、上海市人民检察院第二分院检察长。

现任上海国际集团有限公司党委副书记、副董事长、纪委书记。

监事:谭伟明

曾任JF资产管理北亚业务及营运总监。

现任摩根资产管理香港及中国(不包括合资企业)业务总监。

监事:张军

曾任上投摩根基金管理有限公司交易部总监。

现任上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金经理。

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。

曾任怡富证券投资顾问股份有限公司协理、摩根大通证券副总经理、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:

胡志强先生,副总经理。

毕业于香港中文大学,获得工商管理学院学士学位。

曾任职于中国银行香港分行、JF资产管理有限公司。

侯明甫先生,副总经理。

毕业于台湾中国文化大学,获企业管理硕士。曾任职于台湾金鼎证券公司、摩根富林明(台湾)证券投资顾问股份有限公司、摩根富林明(台湾)证券股份有限公司、摩根富林明证券投资信托股份有限公司,主要负责证券投资研究、公司管理兼投资相关业务管理。

童威先生,副总经理。

获复旦大学金融学博士学位。

曾负责上海证券有限责任公司研究发展中心证券研究管理工作,曾任上海国际集团有限公司发展研究总部副总经理。

陈星德先生,督察长。

毕业于中国政法大学,获法学博士学位。

历任国投瑞银基金管理有限公司监察稽核部总监。

5、本基金基金经理

基金经理杨安乐先生,上海交通大学博士。8年以上证券从业经历,曾任兴业证券研究发展中心研究员,大成基金管理有限公司高级研究员。2004年加入上投摩根基金管理有限公司,担任研究部总监助理、行业专家、上投摩根中国优势证券投资基金基金经理助理、上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金经理助理,自2007年8月10日起担任本基金基金经理。

王振州先生,中原大学电子电机学士,企业管理硕士;7年以上证券从业经历,2002年3月至2004年5月任宝来证券国际金融集团高级研究员;2004年5月至2007年1月,任职于日盛证券投资信托股份有限公司,担任日盛美亚高科技基金及日盛小而美基金基金经理;2007年1月至2007年9月,任元大证券投资信托股份有限公司元大双盈基金基金经理。自2007年11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并自2008年11月29日起担任本基金基金经理。

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。

6. 基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

侯明甫先生,副总经理;童威先生,副总经理;许远凯先生,投资副总监;杨逸枫女士,投资副总监;唐倩女士,研究总监;赵梓峰先生,基金经理;杨安乐先生,基金经理;王孝德先生,基金经理;董红波先生,基金经理;罗建辉先生,基金经理;王振州先生,基金经理;张军先生,基金经理;吴鹏先生,基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(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:郭树清

成立时间:2004年09月17日

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

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:尹 东

联系电话:(010)6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身"中国人民建设银行"于1954年成立,1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:233,689,084,000股(包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股)。

截至2009年12月31日,中国建设银行实现净利润1,068.36亿元,较上年增长15.32%,每股盈利为0.46元,较上年增加0.06元,盈利水平好于预期;平均资产回报率为1.24%,较上年降低0.07个百分点,加权平均净资产收益率为20.87%,较上年提高0.19个百分点,整体盈利趋势向好;总资产达到96,233.55亿元,较上年增长27.37%;资产质量在国内大银行中保持领先,不良贷款额和不良贷款率持续双降,信贷资产质量持续改善,不良贷款率为1.50%,较上年末下降0.71个百分点;拨备水平充分,拨备覆盖率为175.77%,较上年末提升44.19个百分点。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约及胡志明市设有分行,在悉尼设有代表处,拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM)36,021台,拥有员工约30万人,为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可,在2009年共获得50多个国内外奖项。中国建设银行在英国《银行家》杂志公布的"全球金融品牌500强"、"全球银行1000强"中分列第9位和第12位,被《亚洲货币》杂志评为2009年度"中国区最佳银行",被《欧洲货币》杂志评为2009年度"中国最佳银行",连续两年被香港《资本》杂志评为"中国杰出零售银行",荣获《亚洲银行家》杂志颁发的"中国风险管理成就奖",中国扶贫基金会颁发的"20年特别贡献奖"等奖项,被中国红十字基金会评为"最具责任感企业"。

中国建设银行总行设投资托管服务部,下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室,现有员工130余人。2008年,中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会(AICPA)颁布的审计准则公告第70号(SAS70)进行的内部控制审计,安永会计师事务所为此提交了"业内最干净的无保留意见的报告",中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的SAS70国际专项认证的托管银行。

(二)主要人员情况

罗中涛,投资托管服务部总经理,曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作,对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的管理经验。

李春信,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部,对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,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2010年6月30日,中国建设银行已托管158只证券投资基金,其中封闭式基金6只,开放式基金152只。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。2010年初,中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为2009年度"国内最佳托管银行"(Domestic Top Rated),并连续第三年被香港《财资》杂志评为"中国最佳次托管银行"。

三、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:郭树清

客户服务电话:95533

传真:010-66275654

联系人:王琳

(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:姜建清

电话:010-66107900

联系人:田耕

客户服务统一咨询电话:95588

网址: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:项俊波

客户服务电话:95599

网址:www.abchina.com

(4)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

客户服务中心电话:95555

网址:www.cmbchina.com

(5)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:胡怀邦

电话:(021)58781234

传真:(021)58408483

联系人:曹榕

客户服务热线:95559

网址:www.bankcomm.com

(6)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:倪苏云、虞谷云

联系电话:021-61618888

客户服务热线:95528

网址:www.spdb.com.cn

(7)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

联系人:梁曦

客服电话:95561

网址:www.cib.com.cn

(8)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:宁黎明

联系人:张萍

联系电话:021-68475888

传真:021-68476111

客户服务热线:021-962888

网址:www.bankofshanghai.com

(9)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)68098000

传真:(010)68560311

客服电话:95595

联系人:李伟

网址:www.cebbank.com

(10)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

(11)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

(12)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

(13)北京银行股份有限公司

注册地址:北京市金融大街丙17号北京银行大厦

办公地址:北京市金融大街丙17号北京银行大厦

法定代表人:闫冰竹

客户服务电话:010-96169

联系人:王曦

电话:010-66223584

传真:010-66226073

网址:www.bankofbeijing.com.cn

(14)宁波银行股份有限公司

注册地址:宁波市江东区中山东路294号

法定代表人:陆华裕

客户服务统一咨询电话:96528(上海地区962528)

网址:www.nbcb.com.cn

(15)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

(16)深圳发展银行股份有限公司

地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

联系人:张青

联系电话:0755-82088888

传真电话:0755-25841098

客户服务电话:95501

公司网址:www.sdb.com.cn

(17)申银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路171号

法定代表人:丁国荣

电话:021-54033888

传真:021-54038844

客户服务电话:(021)962505

网址:www.sywg.com

(18)上海证券有限责任公司

注册地址:上海市西藏中路336号

法定代表人:郁忠民

电话:(021)53519888

传真:(021)53519888

联系人:王伟力

客户服务电话:962518

网址:www.962518.com

(19)国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路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:祝幼一

联系人:芮敏祺

电话:(021)38676666转6161

传真:(021)38670161

客户服务咨询电话:400-8888-666

网址:www.gtja.com

(20)广发证券股份有限公司

注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址:广东广州天河北路大都会广场36、38、41和42楼

法定代表人:王志伟

联系人:黄岚

咨询电话:95575或020-87555888转各营业网点

公司网站:http://www.gf.com.cn

(21)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

(22)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:徐浩明

电话:021-22169999

传真:021-22169134

联系人:刘晨

网址:www.ebscn.com

(23)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:顾伟国

联系人:田薇

电话:010-66568430

传真:010-66568536

客服电话:4008888888

网址:www.chinastock.com.cn

(24)中信建投证券有限责任公司

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:张佑君

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

(25)兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人:兰荣

电话:021-38565785

联系人:谢高得

客户服务热线:4008888123

公司网站:www.xyzq.com.cn

(26)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

(27)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:0755-82133302

联系人:齐晓燕

客户服务电话:95536

公司网址:www.guosen.com.cn

(28)国都证券有限责任公司

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:黄静

客户服务电话:4008188118

网址:www.guodu.com

(29)华泰证券有限责任公司

注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

客户咨询电话:025-84579897

联系人:张小波

联系电话:025-84457777-248

网址:www.htsc.com.cn

(30)中信证券股份有限公司

注册地址:深圳市招商银行大厦A层

办公地址:北京朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人:王东明

电话:010-84588888

传真:010-84865560

联系人:陈忠

客户服务热线:010-95558

(31)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

联系人:吴宇

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

(32)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

(33)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

(34)中信金通证券有限责任公司

办公地址:杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦19楼、20楼

法定代表人:刘军

联系人:俞会亮

电话:0571-85776115

传真:0571-85783771

客户服务热线:0571-96598

网址:www.bigsun.com.cn

(35)中信万通证券有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层

办公地址:青岛市东海西路28号

法定代表人:张智河

联系电话:0532-85022026

传真:0532-85022026

联系人:吴忠超

公司网址:www.zxwt.com.cn

客户咨询电话:0532-96577

(36)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

(37)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

联系人:匡婷

客户服务热线:400 6666 888

网址:www.cgws.com

(38)华泰联合证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层(01A、02、03、04)、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址:深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层

法定代表人:马昭明

联系人:庞晓芸

电话:0755-82492000

客服电话:95513

公司网址:www.lhzq.com

(39)德邦证券有限责任公司

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:方加春

电话:021-68761616

客服电话:4008888128

网址:www.tebon.com.cn

(40)中国建银投资证券有限责任公司

住所、办公地址:深圳市益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-20楼

法定代表人:杨小阳

电话:(0755)82026521

传真:(0755)82026539

联系人:刘权

客户服务热线:400-600-8008

网址:www.cjis.cn

(41)宏源证券股份有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦

办公地址:北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人:冯戎

联系人:李巍

电话:010-88085858

传真:010-88085344

公司客服电话:4008-000-562

公司网址:www.hysec.com

(42)广发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

电话:0591-87278701

传真:0591-87841150

联系人:张腾

公司网址:www.gfhfzq.com.cn

客户服务热线:0591-96326

网址:www.gfhfzq.com.cn

(43)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:李剑阁

电话:010-65051166

传真:010-65051156

公司网址:www.cicc.com.cn

联系人:邓力伟

电话:021-58881690

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:

办公地址:上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

法定代表人:杨绍信

联系电话:8621- 23238888

联系人:陈宇

经办注册会计师:薛竞、陈宇

四、基金概况

基金名称:中国优势证券投资基金

基金类型:契约型开放式

五、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。

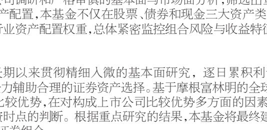
(三)投资范围

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足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)业绩标准基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准是新华富时中国A600指数,债券投资部分的业绩比较基准是上证国债指数;基金整体业绩比较基准=70%×新华富时中国A600指数收益率+25%×上证国债指数收益率+5%×同业存款利率。

(六)投资风险管理

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顺序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:

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

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)基金的投资组合报告

1、报告期末基金资产组合情况

截至2010年6月30日,上投摩根中国优势证券投资基金资产净值为5,652,062,481.45元,基金份额净值为1.9640元,累计基金份额净值为5.0340元。其资产组合情况如下:

序号	资产项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,137,304,811.35	72.34
	其中:股票	4,137,304,811.35	72.34
2	固定收益投资	712,328,000.00	12.45
	其中:债券	712,328,000.00	12.45
	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	858,479,337.73	15.01
6	其他资产	11,322,032.62	0.20
7	合计	5,719,434,181.70	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2010年6月30日

代码	行业类别	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	214,879,730.72	3.80
B	采掘业	410,573,185.19	7.26
C	制造业	1,882,951,376.59	33.31
C0	食品、饮料	815,749,711.81	14.43
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	101,766,162.24	1.80
C4	石油、化学、塑胶、塑料	517,679,499.75	9.16
C5	电子	116.75	0.00
C6	金属、非金属	440,040,406.97	7.79
C7	机械、设备、仪表	60.16	0.00
C8	医药、生物制品	7,715,418.91	0.14
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	3.51	0.00
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	11.02	0.00
H	批发和零售贸易	397.00	0.00
I	金融、保险业	1,444.60	0.00
J	房地产业	1,628,898,593.52	28.82
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	69.20	0.00
	合计	4,137,304,811.35	73.20

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

2010年6月30日

序号	证券代码	证券名称	库存数量(股)	证券市值(元)	市值占净值比例(%)
1	000729	燕京啤酒	21,742,941	430,510,231.80	7.62
2	600028	中国石化	52,499,942	410,549,546.44	7.26
3	000895	双汇发展	8,641,175	376,495,994.75	6.66
4	600688	S上石化	43,943,237	335,726,330.68	5.94
5	000031	中粮地产	47,119,803	324,184,244.64	5.74
6	000024	招商地产	21,269,899	316,496,097.12	5.60
7	600048	保利地产	29,170,881	298,418,112.63	5.28
8	600675	中华企业	39,842,944	262,565,000.96	4.65
9	600598	北大荒	18,865,648	214,879,730.72	3.80
10	600871	S仪化	24,823,079	181,953,169.07	3.22

4、报告期末按券种分类的债券投资组合

2010年6月30日

序号	债券品种	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	682,211,000.00	12.07
3	金融债券	30,117,000.00	0.53
	其中:政策性金融债	30,117,000.00	0.53
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	712,328,000.00	12.60

5、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

2010年6月30日

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1001034	10央行票据34	2,000,000	199,080,000.00	3.52
2	1001029	10央行票据29	1,500,000	149,415,000.00	2.64
3	0901046	09央行票据46	1,400,000	137,396,000.00	2.43
4	0901036	09央行票据36	1,000,000	98,170,000.00	1.74
5	0901044	09央行票据44	1,000,000	98,150,000.00	1.74

6、基金投资资产支持证券及报告期末按市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、投资组合报告附注

1)报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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。

3)截至2010年6月30日,本基金的其他资产项目包括:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,315,411.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,918,899.61
5	应收申购款	3,087,721.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,322,032.62

4)截至2010年6月30日,本基金未持有处于转股期的可转债。

5)截至2010年6月30日,本基金未持有权证。

6)报告期内基金管理人以自有资产投资本基金的情况:

无。

7)因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

六、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%
2010/1/1-2010/6/30	-16.83%	1.00%	-17.59%	1.10%	0.76%	-0.10%

七、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×年管理费率÷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×年托管费率÷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。

(四)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。

(五)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

八、其他应披露事项

1、2010年5月18日关于《上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整及对基金资产净值影响的公告》(双汇发展);

2、2010年5月21日《上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整及对基金资产净值影响的公告》(中华企业);

3、2010年6月30日《上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整及对基金资产净值影响的公告》(中华企业);

4、2010年8月5日《关于限制上投摩根中国优势证券投资基金大额申购及转换转入业务的公告》。

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。

九、招募说明书更新部分说明

本基金于2004年9月15日成立,至2010年9月15日运作满六年。现依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合基金管理人对本基金实施的投资经营活动,对2010年4月28日公告的《上投摩根中国优势证券投资基金招募说明书》进行内容补充和更新,主要更新的内容如下:

1、在"三、基金管理人"的"主要人员情况"中,对董事、独立董事、监事及投资决策委员会等信息进行了更新。

2、在"四、基金托管人"中,对基金托管人的基本情况及相关业务经营情况进行了更新。

3、在"九、基金的投资"的"基金的投资组合报告"中,根据本基金实际运作情况更新了最近一期投资组合报告的内容。

4、在"十、基金的业绩"中,根据基金的实际运作情况,对本基金成立以来的业绩进行了说明。

5、在"二十二、其他应披露事项"中,列举了本基金报告期内与基金运作有重大关系的公告。

上投摩根基金管理有限公司

2010年10月