

# 上投摩根内需动力股票型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

**重要提示:**

1. 投资者有风险,投资人在申购基金时应认真阅读招募说明书;
2. 基金的过往业绩并不预示其未来表现;
3. 基金投资者的买卖基金并不等于将资金作为存款存入银行或者存款类金融机构,基金管理人不在保证基金一定盈利,也不保证最低收益;
4. 本招募说明书所载基金合同和基金招募说明书,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。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为即表明其对本基金合同的承认和接受,并承认《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及所有有关文件的效力。除基金合同另有约定外,基金份额持有人对本基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构均无法律上的约束力。本基金招募说明书所载内容截止日为2010年10月12日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2010年9月30日。

二一零一零年十一月

**一、基金管理人**

(一)基金管理人简介

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:上海市浦东新区城路99号世纪国际大楼20层  
 办公地址:上海市浦东新区城路99号世纪国际大楼20层  
 法定代表人:陈开元  
 总经理:章晓颖  
 成立日期:2004年5月12日  
 注册资本:贰亿伍仟万元人民币  
 股东名称、股权结构及持股比例:

上海国际信托有限公司	51%
IPMorgan 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]36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改之间的股权变更事项。公司注册资本保持不变,股东出资比例仍由上海国际信托有限公司67%和摩根银行资产管理(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”,该变更事项于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,基金管理人的名称由“上投摩根林明基金管理有限公司”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仍由上海国际信托有限公司67%和摩根银行资产管理(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”,该变更事项于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。

(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:姜波义  
 博士,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:戴志宇  
 获台湾大学法学硕士学位,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:李心疆  
 获香港大学工商管理硕士学位。  
 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  
 获英国纽卡斯尔大学理学学士学位。  
 历任JP资产管理有限公司中国区(不包括日本)首席执行长。  
 现任摩根资产管理区域总监。

董事:许立民  
 获台湾交通大学工商管理硕士学位。  
 历任摩根资产管理台湾业务负责人。  
 现任摩根资产管理亚太区首席执行官。

董事:廖自功  
 获美国马里兰州大学法学硕士学位。  
 曾任年利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:陶东  
 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。  
 曾任上海人民检察院第二分院检察长,上海国际集团有限公司党委副书记,副董事长,纪委书记。  
 现任上投摩根基金管理有限公司监事长。

监事:董仲明  
 曾任摩根资产管理香港及中国(不包括合资企业)业务总监。  
 现任摩根资产管理亚太区业务总监。

监事:李金  
 曾任上投摩根基金管理有限公司交易部总监。  
 现任上投摩根亚太区债券股票型证券投资基金经理。

3. 总经理基本情况:

章晓颖先生,总经理  
 获台湾大学硕士学位。  
 曾任台湾证券期货股份有限公司任协理,摩根大通证券副经理,摩根林明证券股份有限公司董事长。

4. 其他高级管理人员情况:

财务总监:副经理  
 毕业于香港中文大学,获得工商管理硕士学位。  
 曾任任职于中国银行香港分行JP资产管理有限公司。

副经理:副经理  
 毕业于台湾中国文化大学,获企业管理硕士学位。曾任任职于台湾金鼎证券公司,摩根林明(台湾)证券投资顾问股份有限公司,摩根林明(台湾)证券投资顾问股份有限公司,摩根林明证券投资信托股份有限公司,主要负责证券投资研究工作,公司管理或投资相关业务。

副经理:副经理  
 获北大金融学硕士学位。  
 历任上海证券有限责任公司研发中心证券研究工作,并于2008年至2009年在上海国际集团有限公司发展研究总部任副经理。

陈星德先生,督察长  
 毕业于中国政法大学,获法学博士学位。  
 曾任上海证监局基金管理部监察稽核部总监。

5. 本基金基金经理

基金经理王孝德先生,毕业于浙江农业大学。历任(国泰)君安证券研究所研究员,德邦证券证券投资部副经理,银河证券研究所分析员,证券投资部基金经理助理。2007年4月至2008年4月任宝鼎消费品证券投资部基金经理。2008年5月加入上投摩根基金管理有限公司,自2008年9月起担任上投摩根基金基金经理。2009年4月非经聘任担任上投摩根阿尔法股票型证券投资基金基金经理。

本基金的历任基金经理为孙延群先生,任期间自基金合同成立日起至2009年7月6日。

6. 基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

王孝德先生,副总经理;章晓颖先生,副总经理;许立民先生,投资副总监;杨德红女士,投资副总监;赵祥麟先生,基金经理;廖自功先生,基金经理;王孝德先生,基金经理;董仲明先生,基金经理;陶东先生,基金经理;陶东先生,基金经理;吴昊先生,基金经理;张军先生,基金经理;唐海女士,研究员;基金之间不存在近亲属关系。

**二、基金托管人**

(一)基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司(同上)

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号  
 成立时间:1984年1月1日  
 法定代表人:姜建清  
 注册资本:人民币334,018,850,026元  
 联系电话:010-66105799  
 联系人:蒋松云

(二)主要人员情况

截至2010年9月末,中国工商银行资产托管部共有员工121人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士以上学历或高级职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年开展托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,严格履行资产托管人职责,依托完善的风险管理内部控制体系,规范托管业务管理模式,迅速的业务运营网络和专业的托管服务团队,为广大投资者、众多资产管理机构和企事业单位提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优良业绩。建立了包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、收支账户资金、企业年金基金、QFII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、银行理财产品在内的全品种的托管产品体系。截至2010年9月,中国工商银行托管证券投资基金177只,托管理财产品8只,托管规模169.02亿元。中国工商银行在2009年国内外托管领域杰出成就和卓越影响力,先后被英国《全球托管人》、香港《财资》和美国《环球金融》评选为“2009年度中国最佳托管银行”,本属《亚洲》评选首次设立了在亚太地区投资基金和金融服务领域有突出贡献的年度行业领导卓越奖,中国工商银行资产托管部周秋忠总经理荣获“年度最佳托管银行”称号,是仅有的两位获奖人之一。自2004年以来,中国工商银行资产托管业务已经连续获得23项国内外大奖。

**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:
  - 0 中国银行股份有限公司
  - 注册地址:北京市西城区复兴门内大街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:姜建清
  - 联系电话:010-66276534
  - 联系人:王琳
  - 0 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:021-88781234
  - 联系人:曹静
  - 0 中国农业银行股份有限公司
  - 注册地址: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:李礼辉
  - 客服电话:95599
  - 网址:www.abchina.com
  - 0 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
  - 0 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:彭纯
  - 电话:021-58781234
  - 联系人:曹静
  - 0 浦发银行股份有限公司
  - 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴168号
  - 办公地址:上海市浦东新区银城中路168号

3. 固定收益类投资咨询

本基金以股票类投资为主,一般情况下,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,优化组合资产管理,本基金将适度配置债券资产,进行债券、货币市场工具等品种投资。在币种选择上,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同品种品种的收益率水平、流动性特征等因素,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。具体策略有:

- 1) 利率预期策略:本基金将首先根据对国内外经济形势的预测,分析市场投资环境的变化趋势,重点关注利率变化趋势。通过全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、物价水平变化趋势等因素,对利率走势形成预期,并据此进行资产配置。
- 2) 信用评级:建立不同品种的收益率曲线预期模型,并利用这些预期进行定价,确保价格中性的变动趋势,根据收益率、流动性、风险匹配原则以及债券的信用质量构建投资组合,合理选择不同市场中有投资价值品种。
- 3) 久期管理:本基金努力把握久期与债券价格波动之间的量化关系,根据未来利率变化预期,以久期和收益率变化趋势为基础,通过久期管理,合理配置投资组合。
- 4) 流动性管理:本基金紧密关注申购赎回现金流情况,流动性管理,未来利率预期,建立组合流动性预期模型,确保基金资产的流动性管理,以确保持续运作能力。
- 5) 风险控制:本基金

基金合同生效日期:2007年4月13日  
 基金管理人:上投摩根基金管理有限公司  
 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

法定代表人:姜建清  
 联系人:曹静  
 联系电话:0532-85022026  
 传真:0532-85022026  
 联系人:吴志超  
 客服电话:021-962888  
 公司网址:www.zmt.com.cn  
 客户咨询电话:0532-96577  
 0 中国工商银行股份有限公司  
 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:姜建清  
 开放式基金咨询电话:4006288888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.boicchina.com  
 0 交通银行股份有限公司  
 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:董建岳  
 电话:0755-83516289  
 传真:0755-83516199  
 联系人:王静  
 客户服务电话:400 6666 888  
 网址:www.cpic.com.cn  
 0 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  
 客服电话:95558  
 网址:bank.cmbc.com.cn  
 0 中国银行股份有限公司  
 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  
 客服电话:95513  
 客户咨询电话:95577  
 网址:www.bjbc.com.cn  
 0 北京银行股份有限公司  
 注册地址:北京市金融大街17号北京银行大厦  
 法定代表人:闫冰竹  
 客户服务热线:4008881122  
 联系人:王琳  
 客服电话:010-96169  
 联系人:王琳  
 客服电话:010-66223884  
 网址:www.bankofbeijing.com.cn  
 0 4 招商银行股份有限公司  
 注册地址:宁波市江东区中山东路294号  
 法定代表人:陆华裕  
 客户服务热线:咨询电话:96258(上海地区962582)  
 网址:www.cmbchina.com  
 0 5 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  
 客户服务热线:咨询电话:4006-99999  
 网址:bank.pingan.com  
 0 6 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:张蓉  
 电话:0755-82088888  
 客户服务热线:0755-28841098  
 客户服务热线:95501  
 公司网址:www.sdb.com.cn  
 0 7 浙江兴业银行股份有限公司  
 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  
 客户服务热线:021 962505  
 网址:www.zjxyc.com  
 0 8 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:伊志辉  
 电话:021 53519888  
 传真:021 53519888  
 联系人:王悦伟  
 电话:021-962518  
 网址:www.962518.com  
 0 9 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:顾伟  
 联系人:芮薇  
 电话:021 38676666 转 6161  
 传真:021 38676161  
 客户服务热线:400-888-666  
 网址:www.gtja.com  
 0 10 广发证券股份有限公司  
 注册地址:广州市天河区北路183号广东大都会广场43楼  
 办公地址:广州市天河区路大都会广场36、38、41和42楼  
 法定代表人:王志伟  
 联系人:黄炎  
 咨询电话:95575或020-87555888 转各营业网点  
 公司网址: http://www.gf.com.cn  
 0 11 招商银行股份有限公司  
 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:李建强  
 联系人:林生迎  
 客户服务热线:95555  
 网址:www.newone.com.cn  
 0 12 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:徐勇  
 电话:021-22169999  
 传真:021-22169134  
 联系人:刘晨  
 网址:www.easton.com.cn  
 0 13 中国银行股份有限公司  
 注册地址:北京市西城区金融大街35号国际大厦A座  
 法定代表人:姜建清  
 联系人:田海霞  
 电话:010-66568340  
 传真:010-66568536  
 客服电话:4008888888  
 网址:www.chinastock.com.cn  
 0 14 中信证券股份有限公司  
 注册地址:北京市朝阳区亮马桥路66号4楼  
 办公地址:北京市朝阳区朝内大街188号  
 法定代表人:王东明  
 电话:010 65186758  
 传真:010 65182261  
 联系人:魏明  
 客户服务咨询电话:400-888-108;  
 网址:www.citic108.com  
 0 15 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:高扬  
 客户服务热线:4008881123  
 公司网址:www.guosen.com.cn  
 0 16 渤海证券股份有限公司  
 注册地址:天津市津滨大道98号  
 法定代表人:王天国  
 电话:021-23219000  
 联系人:李奕明  
 客服电话:95553  
 公司网址:www.lhsec.com  
 0 17 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:0755-82131302  
 联系人:李尧雄  
 客户服务热线:95536  
 公司网址:www.guosen.com.cn  
 0 18 招商证券股份有限公司  
 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:李浩  
 联系人:薛静  
 客户服务电话:4008181818  
 网址:www.guodu.com  
 0 19 华泰证券股份有限公司  
 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  
 电话:025-8445777-248  
 网址:www.htsec.com.cn  
 0 20 东方财富证券股份有限公司  
 注册地址:拉萨市北京中路101号东方财富大厦  
 法定代表人:周娟  
 电话:071-4403343  
 联系人:李娟  
 网址:www.cdfj.com.cn  
 0 21 湘财证券有限责任公司  
 本基金以股票类投资为主,一般情况下,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,优化组合资产管理,本基金将适度配置债券资产,进行债券、货币市场工具等品种投资。在币种选择上,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同品种品种的收益率水平、流动性特征等因素,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。具体策略有:

1. 利率预期策略:本基金将首先根据对国内外经济形势的预测,分析市场投资环境的变化趋势,重点关注利率变化趋势。通过全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、物价水平变化趋势等因素,对利率走势形成预期,并据此进行资产配置。

2. 信用评级:建立不同品种的收益率曲线预期模型,并利用这些预期进行定价,确保价格中性的变动趋势,根据收益率、流动性、风险匹配原则以及债券的信用质量构建投资组合,合理选择不同市场中有投资价值品种。

3. 久期管理:本基金努力把握久期与债券价格波动之间的量化关系,根据未来利率变化预期,以久期和收益率变化趋势为基础,通过久期管理,合理配置投资组合。

4. 流动性管理:本基金紧密关注申购赎回现金流情况,流动性管理,未来利率预期,建立组合流动性预期模型,确保基金资产的流动性管理,以确保持续运作能力。

5. 风险控制:本基金

基金合同生效日期:2007年4月13日  
 基金管理人:上投摩根基金管理有限公司  
 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

法定代表人:姜建清  
 联系人:曹静  
 联系电话:0532-85022026  
 传真:0532-85022026  
 联系人:吴志超  
 客服电话:021-962888  
 公司网址:www.zmt.com.cn  
 客户咨询电话:0532-96577  
 0 中国工商银行股份有限公司  
 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:姜建清  
 开放式基金咨询电话:4006288888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.boicchina.com  
 0 交通银行股份有限公司  
 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:董建岳  
 电话:0755-83516289  
 传真:0755-83516199  
 联系人:王静  
 客户服务电话:400 6666 888  
 网址:www.cpic.com.cn  
 0 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  
 客服电话:95558  
 网址:bank.cmbc.com.cn  
 0 中国银行股份有限公司  
 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  
 客服电话:95513  
 客户咨询电话:95577  
 网址:www.bjbc.com.cn  
 0 北京银行股份有限公司  
 注册地址:北京市金融大街17号北京银行大厦  
 法定代表人:闫冰竹  
 客户服务热线:4008881122  
 联系人:王琳  
 客服电话:010-96169  
 联系人:王琳  
 客服电话:010-66223884  
 网址:www.bankofbeijing.com.cn  
 0 4 招商银行股份有限公司  
 注册地址:宁波市江东区中山东路294号  
 法定代表人:陆华裕  
 客户服务热线:咨询电话:96258(上海地区962582)  
 网址:www.cmbchina.com  
 0 5 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  
 客户服务热线:咨询电话:4006-99999  
 网址:bank.pingan.com  
 0 6 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:张蓉  
 电话:0755-82088888  
 客户服务热线:0755-28841098  
 客户服务热线:95501  
 公司网址:www.sdb.com.cn  
 0 7 浙江兴业银行股份有限公司  
 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  
 客户服务热线:021 962505  
 网址:www.zjxyc.com  
 0 8 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:伊志辉  
 电话:021 53519888  
 传真:021 53519888  
 联系人:王悦伟  
 电话:021-962518  
 网址:www.962518.com  
 0 9 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:顾伟  
 联系人:芮薇  
 电话:021 38676666 转 6161  
 传真:021 38676161  
 客户服务热线:400-888-666  
 网址:www.gtja.com  
 0 10 广发证券股份有限公司  
 注册地址:广州市天河区北路183号广东大都会广场43楼  
 办公地址:广州市天河区路大都会广场36、38、41和42楼  
 法定代表人:王志伟  
 联系人:黄炎  
 咨询电话:95575或020-87555888 转各营业网点  
 公司网址: http://www.gf.com.cn  
 0 11 招商银行股份有限公司  
 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:李建强  
 联系人:林生迎  
 客户服务热线:95555  
 网址:www.newone.com.cn  
 0 12 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:徐勇  
 电话:021-22169999  
 传真:021-22169134  
 联系人:刘晨  
 网址:www.easton.com.cn  
 0 13 中国银行股份有限公司  
 注册地址:北京市西城区金融大街35号国际大厦A座  
 法定代表人:姜建清  
 联系人:田海霞  
 电话:010-66568340  
 传真:010-66568536  
 客服电话:4008888888  
 网址:www.chinastock.com.cn  
 0 14 中信证券股份有限公司  
 注册地址:北京市朝阳区亮马桥路66号4楼  
 办公地址:北京市朝阳区朝内大街188号  
 法定代表人:王东明  
 电话:010 65186758  
 传真:010 65182261  
 联系人:魏明  
 客户服务咨询电话:400-888-108;  
 网址:www.citic108.com  
 0 15 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:高扬  
 客户服务热线:4008881123  
 公司网址:www.guosen.com.cn  
 0 16 渤海证券股份有限公司  
 注册地址:天津市津滨大道98号  
 法定代表人:王天国  
 电话:021-23219000  
 联系人:李奕明  
 客服电话:95553  
 公司网址:www.lhsec.com  
 0 17 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:0755-82131302  
 联系人:李尧雄  
 客户服务热线:95536  
 公司网址:www.guosen.com.cn  
 0 18 招商证券股份有限公司  
 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:李浩  
 联系人:薛静  
 客户服务电话:4008181818  
 网址:www.guodu.com  
 0 19 华泰证券股份有限公司  
 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  
 电话:025-8445777-248  
 网址:www.htsec.com.cn  
 0 20 东方财富证券股份有限公司  
 注册地址:拉萨市北京中路101号东方财富大厦  
 法定代表人:周娟  
 电话:071-4403343  
 联系人:李娟  
 网址:www.cdfj.com.cn  
 0 21 湘财证券有限责任公司  
 本基金以股票类投资为主,一般情况下,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,优化组合资产管理,本基金将适度配置债券资产,进行债券、货币市场工具等品种投资。在币种选择上,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同品种品种的收益率水平、流动性特征等因素,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。具体策略有:

1. 利率预期策略:本基金将首先根据对国内外经济形势的预测,分析市场投资环境的变化趋势,重点关注利率变化趋势。通过全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、物价水平变化趋势等因素,对利率走势形成预期,并据此进行资产配置。

2. 信用评级:建立不同品种的收益率曲线预期模型,并利用这些预期进行定价,确保价格中性的变动趋势,根据收益率、流动性、风险匹配原则以及债券的信用质量构建投资组合,合理选择不同市场中有投资价值品种。

3. 久期管理:本基金努力把握久期与债券价格波动之间的量化关系,根据未来利率变化预期,以久期和收益率变化趋势为基础,通过久期管理,合理配置投资组合。

4. 流动性管理:本基金紧密关注申购赎回现金流情况,流动性管理,未来利率预期,建立组合流动性预期模型,确保基金资产的流动性管理,以确保持续运作能力。

5. 风险控制:本基金

基金合同生效日期:2007年4月13日  
 基金管理人:上投摩根基金管理有限公司  
 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

法定代表人:姜建清  
 联系人:曹静  
 联系电话:0532-85022026  
 传真:0532-85022026  
 联系人:吴志超  
 客服电话:021-962888  
 公司网址:www.zmt.com.cn  
 客户咨询电话:0532-96577  
 0 中国工商银行股份有限公司  
 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:姜建清  
 开放式基金咨询电话:4006288888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.boicchina.com  
 0 交通银行股份有限公司  
 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:董建岳  
 电话:0755-83516289  
 传真:0755-83516199  
 联系人:王静  
 客户服务电话:400 6666 888  
 网址:www.cpic.com.cn  
 0 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  
 客服电话:95558  
 网址:bank.cmbc.com.cn  
 0 中国银行股份有限公司  
 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  
 客服电话:95513  
 客户咨询电话:95577  
 网址:www.bjbc.com.cn  
 0 北京银行股份有限公司  
 注册地址:北京市金融大街17号北京银行大厦  
 法定代表人:闫冰竹  
 客户服务热线:4008881122  
 联系人:王琳  
 客服电话:010-96169  
 联系人:王琳  
 客服电话:010-66223884  
 网址:www.bankofbeijing.com.cn  
 0 4 招商银行股份有限公司  
 注册地址:宁波市江东区中山东路294号  
 法定代表人:陆华裕  
 客户服务热线:咨询电话:96258(上海地区962582)  
 网址:www.cmbchina.com  
 0 5 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  
 客户服务热线:咨询电话:4006-99999  
 网址:bank.pingan.com  
 0 6 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:张蓉  
 电话:0755-82088888  
 客户服务热线:0755-28841098  
 客户服务热线:95501  
 公司网址:www.sdb.com.cn  
 0 7 浙江兴业银行股份有限公司  
 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  
 客户服务热线:021 962505  
 网址:www.zjxyc.com  
 0 8 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:伊志辉  
 电话:021 53519888  
 传真:021 53519888  
 联系人:王悦伟  
 电话:021-962518  
 网址:www.962518.com  
 0 9 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:顾伟  
 联系人:芮薇  
 电话:021 38676666 转 6161  
 传真:021 38676161  
 客户服务热线:400-888-666  
 网址:www.gtja.com  
 0 10 广发证券股份有限公司  
 注册地址:广州市天河区北路183号广东大都会广场43楼  
 办公地址:广州市天河区路大都会广场36、38、41和42楼  
 法定代表人:王志伟  
 联系人:黄炎  
 咨询电话:95575或020-87555888 转各营业网点  
 公司网址: http://www.gf.com.cn  
 0 11 招商银行股份有限公司  
 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:李建强  
 联系人:林生迎  
 客户服务热线:95555  
 网址:www.newone.com.cn  
 0 12 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:徐勇  
 电话:021-22169999  
 传真:021-22169134  
 联系人:刘晨  
 网址:www.easton.com.cn  
 0 13 中国银行股份有限公司  
 注册地址:北京市西城区金融大街35号国际大厦A座  
 法定代表人:姜建清  
 联系人:田海霞  
 电话:010-66568340  
 传真:010-66568536  
 客服电话:4008888888  
 网址:www.chinastock.com.cn  
 0 14 中信证券股份有限公司  
 注册地址:北京市朝阳区亮马桥路66号4楼  
 办公地址:北京市朝阳区朝内大街188号  
 法定代表人:王东明  
 电话:010 65186758  
 传真:010 65182261  
 联系人:魏明  
 客户服务咨询电话:400-888-108;  
 网址:www.citic108.com  
 0 15 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:高扬  
 客户服务热线:4008881123  
 公司网址:www.guosen.com.cn  
 0 16 渤海证券股份有限公司  
 注册地址:天津市津滨大道98号  
 法定代表人:王天国  
 电话:021-23219000  
 联系人:李奕明  
 客服电话:95553  
 公司网址:www.lhsec.com  
 0 17 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:0755-82131302  
 联系人:李尧雄  
 客户服务热线:95536  
 公司网址:www.guosen.com.cn  
 0 18 招商证券股份有限公司  
 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:李浩  
 联系人:薛静  
 客户服务电话:4008181818  
 网址:www.guodu.com  
 0 19 华泰证券股份有限公司  
 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  
 电话:025-8445777-248  
 网址:www.htsec.com.cn  
 0 20 东方财富证券股份有限公司  
 注册地址:拉萨市北京中路101号东方财富大厦  
 法定代表人:周娟  
 电话:071-4403343  
 联系人:李娟  
 网址:www.cdfj.com.cn  
 0 21 湘财证券有限责任公司  
 本基金以股票类投资为主,一般情况下,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,优化组合资产管理,本基金将适度配置债券资产,进行债券、货币市场工具等品种投资。在币种选择上,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同品种品种的收益率水平、流动性特征等因素,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。具体策略有:

1. 利率预期策略:本基金将首先根据对国内外经济形势的预测,分析市场投资环境的变化趋势,重点关注利率变化趋势。通过全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、物价水平变化趋势等因素,对利率走势形成预期,并据此进行资产配置。

2. 信用评级:建立不同品种的收益率曲线预期模型,并利用这些预期进行定价,确保价格中性的变动趋势,根据收益率、流动性、风险匹配原则以及债券的信用质量构建投资组合,合理选择不同市场中有投资价值品种。

3. 久期管理:本基金努力把握久期与债券价格波动之间的量化关系,根据未来利率变化预期,以久期和收益率变化趋势为基础,通过久期管理,合理配置投资组合。

4. 流动性管理:本基金紧密关注申购赎回现金流情况,流动性管理,未来利率预期,建立组合流动性预期模型,确保基金资产的流动性管理,以确保持续运作能力。

5. 风险控制:本基金

基金合同生效日期:2007年4月13日  
 基金管理人:上投摩根基金管理有限公司  
 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

法定代表人:姜建清  
 联系人:曹静  
 联系电话:0532-85022026  
 传真:0532-85022026  
 联系人:吴志超  
 客服电话:021-962888  
 公司网址:www.zmt.com.cn  
 客户咨询电话:0532-96577  
 0