（上接B30版）

传真：021-3135 8600
经办律师：秦悦民
（四）会计师事务所：
名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址：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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人：吴港平
联系电话：8621-61233277
联系人：汪棣
经办注册会计师：汪棣、王灵

四、基金概况

基金名称：上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金
基金类型：契约型开放式

五、基金的投资

（一）投资目标
本基金主要投资于新兴市场以及在其他证券市场交易的新兴市场企业，通过深入挖掘新兴市场企业的投资价值，努力实现基金资产稳健增值。
（二）投资范围
本基金拟投资的新兴市场主要根据摩根斯坦利新兴市场指数所包含的国家或地区进行界定，主要包括：中国、巴西、韩国、台湾、印度、南非、俄罗斯、墨西哥、以色列、马来西亚、印度尼西亚、智利、土耳其、泰国、波兰、哥伦比亚、匈牙利、秘鲁、埃及、捷克、菲律宾、摩洛哥等国家或地区。如果摩根斯坦利新兴市场指数所包含的国家或地区增加、减少或变更，本基金投资的主要证券市场将相应调整。本基金主要投资于与中国证监会签署备忘录的新兴国家或地区的证券。
本基金投资组合中股票及其它权益类证券市值占基金资产的60%-95%，现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具市值占基金资产的5%-40%，并保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。股票及其他权益类证券包括中国证监会允许投资的普通股、优先股、存托凭证、公募股票基金等。现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品等。
（三）投资理念
一般而言，全球新兴市场存在信息不对称、投资者非理性、套利成本和风险较高以及投资策略等问题，新兴市场表现出非有效性特征，而为全球理性投资者带来投资契机。本基金在投资过程中注重寻求并确定证券定价偏差，采取价值与动量兼顾的投资策略，合理利用偏差捕捉多重获利机会，实现非有效市场中的有效管理。
(四)投资策略
新兴市场所属国家和地区经济发展多处于转型阶段，劳动力成本低，自然资源丰富，与发达国家与地区比较，其经济发展速度一般相对较高。本基金将充分分享新兴市场经济高增长成果，审慎把握新兴市场的投资机会，争取为投资者带来长期稳健回报。
总体上本基金将采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。首先通过考察不同国家的发展趋势及不同行业的景气程度，决定地区与板块的基本布局；其次采取自下而上的选股策略，在对股票进行基本面分析的同时，通过深入研究股票的价值与动量特性，选取目标投资对象。在固定收益类投资部分，本基金将综合考虑资产布局的安全性、流动性与收益性，并结合现金管理要求等来制订具体策略。
1、股票投资策略
1）国家与行业分析
本基金将对新兴市场所处的国家和地区进行分析，重点考察不同国家和地区的宏观经济发展趋势、经济结构、行业景气、劳动力水平等指标，同时比较不同国家和地区股票市场的整体估值，为估值水平进行排序，选取出具备明显国际比较优势和投资价值的国家和地区。在行业层面，针对在全球经济一体化的条件下，不同行业周期、各国家与地区行业政策以及不同行业当前发展趋势，加强配置发展前景良好或景气程度上升的行业。
2）价值与动量分析
基于本基金投资理念，主要利用价值及动量指标对初选股票进行排序，精选出同时具备投资价值和趋势明确的个股。具体来说，本基金首先基于公司财务数据，运用价值型股票选股模型，选取具有估值优势的股票。价值型股票的研判指标主要包括：市净率（P/B ratio）、市盈率（P/E ratio）、市值与现金盈利率(P/CE ratio)及股利收益率（Dividend Yield）等。利用估值指标对个股排序，精选出预期未来具备长期投资价值的股票。同时，本基金将深入研究股票的历史走势，通过分析股票的长期、中期及短期价格变动（Price yield），结合对股价未来走势的预测，筛选出具备明确上升惯性趋势的股票。
3）基本面分析
本基金将利用基本面分析研判市场结构性变化与长期趋势，进一步改善投资策略模型的选股结果。国家/地区行业分析师将从区域角度甄别企业经营特质、企业财务质量、企业管理能力等，结合具体市场特征优化股票选择。企业经营特质的分析要点包括公司的经营模式、市场地位及发展前景等；企业财务质量分析要点包括公司的盈利能力及资产质量等；企业管理能力分析要点包括管理团队的领导能力、计划实施能力及资金管理能力等。
4）股票组合构建
股票组合构建将进一步体现本基金投资理念，利用价值与动量择股策略，挖掘多重独立超额收益来源，同时综合考虑市场流动性、汇率风险、组合集中度等，优化组合风险收益特征，构建出能够持续创造超额回报的股票投资组合。
2、固定收益类投资策略
本基金将根据风险防御及现金替代性管理的需要，适度进行债券投资。本基金在对新兴市场中不同国家和地区宏观经济发展情况、财政政策、货币政策、以及利率走势进行分析的基础上，综合考查利率风险、信用和流动性风险对债券内在价值的影响，构建固定收益类投资组合，以追求长期低波动率的稳健回报。
3、衍生品投资策略
本基金将以组合避险或有效管理为目标，本着谨慎原则，进行风险识别，适度参与衍生品投资。本基金的衍生品投资方向主要包括以下：
汇率衍生品：本基金将在宏观经济、货币政策、市场环境分析的基础上，结合专业判断从事远期合约、外汇期货、外汇互换等操作，以控制外汇汇兑风险。
指数衍生品：通过分析各市场走势，结合量化模型预测，参与指数期货或指数期权的投资，主要目的用于套期保值及有效组合管理。
本基金衍生品投资不表示组合风险得以完全规避。
（五）基金投资决策
1、投资决策模式
本基金的投资决策采用投资决策委员会集体决策与基金经理授权决策相结合的分级模式。由投资决策委员会决定资产配置、投资原则等宏观决策；由基金经理负责组合构建、品种选择、汇率管理等具体决策。投资决策委员会由公司总经理、主管投资的副总经理、投资总监、资深基金经理、研究总监等组成，投资决策委员会定期举行会议，讨论决定境外投资基金的股票、固定收益、现金的资产配置比例、地区资产配置、行业配置、金融衍生产品使用、避险保值策略和外汇管理等重大策略。基金经理向投资决策委员会汇报投资运作情况，并提出建议；基金经理可以邀请境外投资顾问的代表列席参加投资决策委员会，提供建议；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。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。
2、境外投资顾问协助
本基金境外投资顾问将提供海外市场投资建议。投资团队会不定期通过参加不同区域研讨会、亲自拜访投资标的进行投资分析以及参考券商研究成果外，也将定期通过会议与境外投资顾问交流分析所投资市场、产业与各股的投资前景，境外投资顾问藉此协助本基金投研团队检视与监督本基金组合中的投资项目。
境外投资顾问在投资流程中提供的协助以投资顾问协议为准。
3、投资管理运作
构建投资组合是基金经理职责，构建过程中有如下基本原则：
（1）遵守基金目标，基于收益预期、风险预测和可供参考的业绩比较基准的深入了解与分析；
（2）遵守投资决策委员会对资产配置、国家配置、行业配置、金融衍生品、避险保值和外汇管理方面的决议；
（3）参考来自境外投资顾问的投资观点，来自全球多资产小组的资产配置建议，来自全球货币小组的汇率管理建议，来自各个国家/地区研究专员对投资范围内的公司进行策略评级和股票评级。
（4）允许基金经理在基金风险预测允许的情况下进行判断，对于高风险承受能力的基金给予较高判断空间。允许判断对于那些积极、有创造力的基金经理很重要，但需受到投资总监严密监控。
（5）基金经理在地区权重、策略分类和股票评级的基础上决定每只股票在组合中的仓位，并在等级评定和组合要求之间出现反常因素时进行调整，以符合本基金投资组合的管理需求。
（六）投资风险管理
保护基金份额持有人利益为本基金风险管理的最高准则。本基金将采取定量风险管理模式，适时测算投资组合的跟踪误差，并且对跟踪误差进行归因分析。在计算跟踪误差指标的基础上，对跟踪误差来源按成因进行分解，为投资组合下一步的调整及跟踪目标指数偏离风险的控制提供量化决策依据。本基金将组合跟踪误差控制在一定范围之内，并根据跟踪误差的归因分析，及时对投资组合相应环节进行调整，在进行主动管理的前提下，能够有效控制组合风险，持续优化投资组合信息比率，为投资者提供合理的风险调整后回报。
(七)风险收益特征
本基金为股票型证券投资基金，基金投资风险收益水平高于债券型基金和平衡型基金。
（八）业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为：摩根斯坦利新兴市场股票指数（总回报）。
基于较长投资周期考虑，本基金股票平均仓位一般会维持在75%－95%之间（具体仓位会依据基金合同规定适时调整），所以本基金选用单一股票指数基准。如果今后有更具有代表性的、更适合用于本基金的业绩比较基准，本基金将根据实际情况予以调整，在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
(九)投资限制
1.组合限制
本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：
(1) 本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的20%，银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款不受此限制。
(2) 本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的10%；
(3) 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产市值不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产市值不得超过基金资产净值的3%；
(4) 本基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。同一境内机构投资者管理的全部基金不得持有同一机构10%以上具有投票权的证券发行总量；
前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换；
(5) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%；
前项非流动性资产是指法律或本基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；
(6) 同一境内机构投资者管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的20%；
(7) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金净值的10%，持有货币市场基金不受上述限制。
(8) 本基金投资组合中股票及其它权益类证券市值占基金资产的60%-95%，现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具市值占基金资产的5%-40%，并保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；
(9) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于本基金资产净值的100%；
(10) 本基金投资货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%；
(11)本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：
(a) 所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。
(b) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。
(c) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。
(12)相关法律法规、基金合同及中国证监会的其他规定。
为有效管理投资组合和规避风险，本基金可适当投资于远期合约、期货合约、期权、掉期等衍生金融工具。金融衍生品投资应当符合法律法规及中国证监会有关规定。
法律法规或中国有关监管部门取消上述限制，本基金不受上述限制。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门调整上述限制的，履行适当程序后，基金可依据届时有效的法律法规适时合理地调整上述限制。
因证券市场波动、上市公司合并分拆、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述（1）-（8）规定的投资比例的，基金管理人应当在30个工作日内进行调整。
基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。
对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在10个工作日内增加10亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人同基金托管人协商一致并及时书面报告中国证监会后，可将调整时限从30个工作日延长到3个月。
2.禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：
（1）购买不动产。
（2）购买房地产抵押按揭。
（3）购买贵重金属或代表贵重金属的凭证。
（4）购买实物商品。
（5）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。
（6）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外。
（7）参与未持有基础资产的卖空交易。
（8）从事证券承销业务。
（9）不公平对待不同客户或不同投资组合。
（10）除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料。
（11）中国证监会禁止的其他行为。
(十)基金的融资
本基金可以按照国家的有关规定进行融资。
（十一）融券
本基金可以按照国家的有关规定进行融券。在进行交易清算时，以不卖空为基础进行融券。
（十二）证券交易
1、券商经纪人的选择标准
（1）券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与本基金管理人有互补性、在最近一年内无重大违规行为。
（2）券商经纪人有较强的综合服务能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据本基金管理人所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。
（3）券商经纪人能提供优惠合理的佣金；与其他券商经纪人相比，该券商经纪人能够提供优惠合理的佣金率。
（4）券商经纪人具有较强的交易执行能力，能够公平对待所有客户，实现最佳价格成交，及时、准确、高效。
2、券商经纪人的交易量分配程序
根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》中关于“一家基金公司通过一家券商的交易席位买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金的30%”的规定，本基金将结合各券商经纪人提供研究报告及综合服务的质量，分配基金在各席位买卖证券的交易量。每半年对各个券商经纪人进行考核和打分，并根据考核结果拟定交易量分配比例，并至少每月调整。
3、其他事项
本基金管理人将根据有关规定，在基金定期报告中按规定将所选择的证券经营机构的有关情况、支付的佣金等予以披露，同时将本着维护基金份额持有人利益的原则，对券商选择和佣金分配中存在或潜在的利益冲突进行妥善处理，并向中国证监会报告。
（十三）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。
4、代理投票权
基金管理人作为基金份额持有人的代理人，应本着维护基金份额持有人利益的原则，勤勉尽责地行使其所投资股票的投票权。基金管理人在履行代理投票职责过程中，可根据实际需要，委托境外投资顾问或其他专业机构提供代理投票的建议、委托基金托管人或其他专业机构协助完成代理投票的程序，基金管理人应对代理机构的行为进行必要的监督，保留投票记录，并承担相应责任。
（十四）基金的投资组合
（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	57,967,791.48	85.92
	其中：普通股	50,522,072.96	74.88
	存托凭证	6,835,998.40	10.13
	优先股	-	-
	房地产信托	609,720.12	0.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,385,764.90	12.43
8	其他各项资产	1,113,790.34	1.65
9	合计	67,467,346.72	100.00

注：截至2013年6月30日，本基金资产净值为64,023,514.92元，基金份额净值为0.854元，累计基金份额净值为0.854元。
（二）报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
中国香港	10,761,175.11	16.81
中国台湾	9,991,121.38	15.61
美国	8,473,592.75	13.24
韩国	6,883,701.00	10.75
南非	3,869,737.64	6.04
印度尼西亚	3,031,615.73	4.74
印度	3,007,216.18	4.70
泰国	2,532,539.86	3.96
马来西亚	2,429,825.84	3.80
墨西哥	1,729,638.50	2.70
菲律宾	1,484,604.30	2.32
波兰	1,386,583.85	2.17
土耳其	1,363,864.49	2.13
英国	1,022,574.85	1.60
合计	57,967,791.48	90.54

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定，ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。
（三）报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
半导体产品与设备	10,903,135.46	17.03
食品	5,591,616.16	8.73
饮料	3,699,673.03	5.78
保险	3,486,586.29	5.45
石油、天然气与消费用燃料	3,342,773.76	5.22
纺织品、服装与奢侈品	2,891,518.07	4.52
商业银行	2,815,071.46	4.40
房地产管理和开发	2,717,428.09	4.24
化学制品	2,593,342.26	4.05
电子设备、仪器和元件	2,079,056.51	3.25
食品与主要用品零售	1,962,741.81	3.07
互联网软件与服务	1,910,187.48	2.98
建筑与工程	1,657,366.12	2.59
信息技术服务	1,541,543.04	2.41
休闲设备与用品	1,526,997.13	2.39
个人用品	1,413,564.78	2.21
居家用品	1,218,477.70	1.90
资本市场	1,207,484.64	1.89
多元化零售	1,011,625.94	1.58
消费信贷	783,460.21	1.22
医疗保健提供商与服务	772,459.72	1.21
综合金融服务	755,174.44	1.18
商业服务与商业用品	747,470.94	1.17
房地产投资信托(REITs)	609,720.12	0.95
交通基本设施	376,636.12	0.59
酒店、餐馆与休闲	352,680.20	0.55
合计	57,967,791.48	90.54

注：行业分类标准：MSCI。
（四）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股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Micron Technology Inc	-	MU US	纳斯达克证券交易所	美国	40,000	3,541,630.84	5.53
2	SK Hynix Inc	-	000660 KS	韩国证券交易所	韩国	18,000	3,038,359.02	4.75
3	Companhia de Bebidas das Americas	-	ABV US	纽约证券交易所	美国	12,200	2,815,448.23	4.40
4	Elite Semiconductor Memory Technology Inc	晶豪科技股份有限公司	3006 TT	台湾证券交易所	中国台湾	280,000	2,447,483.45	3.82
5	Shoprite Holdings Ltd	-	SHP SJ	约翰内斯堡证券交易所	南非	17,000	1,962,741.81	3.07
6	Sasol Ltd	-	SOL SJ	约翰内斯堡证券交易所	南非	7,100	1,906,995.83	2.98
7	Tingyi (Cayman Islands) Holdings Corp	康师傅控股有限公司	322 HK	香港交易所	中国香港	116,000	1,866,590.58	2.92
8	IJM Corp Bhd	-	IJM MK	吉隆坡证券交易所	马来西亚	150,000	1,657,366.12	2.59
9	Samsung Life Insurance Co Ltd	-	032830 KS	韩国证券交易所	韩国	2,700	1,577,609.49	2.46
10	Johnson Health Tech Co Ltd	乔山健康科技股份有限公司	1736 TT	台湾证券交易所	中国台湾	90,000	1,526,997.13	2.39

注：1. 所用证券代码采用Ticker代码。
2. 所属国家（地区）列示证券挂牌的证券交易所所在国家（地区）。
（五）报告期末按券种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券
（六）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
本基金本报告期末未持有债券
（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细：
本基金本报告期末未持有资产支持证券
（八）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金融衍生品投资明细：
本基金本报告期末未持有金融衍生品
（九）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金明细
本基金本报告期末未持有基金
（十）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、其他各项资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	526,693.95
3	应收股利	153,805.04
4	应收利息	659.97
5	应收申购款	115,191.65
6	其他应收款	317,439.73
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,113,790.34

4、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
5、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
6、投资组合报告附注的其他文字描述部分：
因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

七、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
基金成立日-2011/12/31	-20.80%	1.08%	-22.24%	1.49%	1.44%	-0.41%
2012/1/1-2012/12/31	20.33%	0.81%	14.87%	0.90%	5.46%	-0.09%
2013/1/1-2013/6/30	-10.39%	0.78%	-12.40%	0.92%	2.01%	-0.14%

八、基金费用概览

(一)基金费用的种类
1.基金管理人的管理费（其中包含投资顾问费）；
2.基金托管人托管费（其中包含境外托管人托管费及其他相关费用）；
3.基金财产拨划支付的银行费用；
4.基金合同生效后的信息披露费用；
5.基金份额持有人大会费用；
6.基金合同生效后的会计师费，律师费和其他为基金利益而产生的中介机构费用(包括税务咨询顾问服务费用)；
7.基金的证券交易费用及在境外市场的交易，清算，登记等各项费用；
8.代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用；
9.基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）(简称“税收”)；
10.更换基金管理人，更换基金托管人及基金资产由原基金托管人转移新托管人所引起的费用；
11.按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。
(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。
(三)基金主要费用计提方法、计提标准和支付方式
1.基金管理人的管理费
在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值1.8%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为前一日的基金资产净值。
基金于每日计提管理费，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财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.基金托管人的托管费
在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.35%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为前一日的基金资产净值。
基金于每日计提托管费，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，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财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.上述(一)中3到11项费用由基金管理人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。
(四)不列入基金费用的项目
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财产的损失，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。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。
(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况、根据法律法规及基金合同的相关规定适当调整基金管理费率和基金托管费率。
(六)基金税收
基金和基金合同各方当事人根据国家法律法规和有关境外投资市场的规定，履行纳税义务。

九、招募说明书更新部分说明

上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金于2011年1月30日成立，至2013年7月29日运作满两年半。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2013年3月15日公告的《上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金招募说明书（更新）》进行内容补充和更新，主要更新的内容如下：
1、在重要提示中，更新内容截止日为2013年7月29日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2013年6月30日。
2、在“二、释义”中对“《基金法》”的定义进行了更新。
3、在“四、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“五、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“六、基金管理人”的“主要人员情况”中，对董事、独立董事、监事、总经理、高级管理人员及投资决策委员会等信息进行了更新。
6、在“十八、基金托管人”中对基金托管人的相关信息及制度进行了更新。
7、在“十九、相关服务机构”中，更新了代销机构的相关信息。
特此说明。
8、在“二十二、对基金份额持有人的服务”中，更新了基金电子交易服务的相关信息。
9、在“二十三、其他应披露事项”中列示了本披露期间内的重大公告。

上投摩根基金管理有限公司
2013年9月12日

证券代码：600030　证券简称：中信证券　公告编号：临2013-053

中信证券股份有限公司 关于召开2013年第二次临时股东大会的通知

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

重要内容提示
●会议召开时间：2013年10月29日（星期二）上午10时
●会议召开地点：北京市朝阳区亮马桥路50号北京燕莎中心有限公司凯宾斯基饭店3层开封厅
●会议方式：现场会议
●股权登记日：2013年10月22日（星期二）
●本次股东大会不提供网络投票
根据中信证券股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）2013年8月29日召开的第五届董事会第十六次会议决议，经王东明董事长提议，现将召开2013年第二次临时股东大会的有关事项通知如下：
一、召开会议的基本情况
（一）股东大会届次：2013年第二次临时股东大会
（二）股东大会的召集人：公司董事会
（三）会议时间：2013年10月29日（星期二）上午10时
（四）会议地点：北京市朝阳区亮马桥路50号北京燕莎中心有限公司凯宾斯基饭店3层开封厅
（五）会议表决方式：现场投票方式
二、会议审议事项
（一）特别决议案（一项）：《关于增加公司经营范围的议案》
此议案需获得出席本次股东大会的股东（包括股东代理人）所持表决权的三分之二以上通过。
（二）普通决议案（一项）：《关于增选公司第五届董事会执行董事的议案》
此议案需获得出席本次股东大会的股东（包括股东代理人）所持表决权的二分之一以上通过。
公司董事会审议上述事项的具体情况，请参见公司第五届董事会第十六次会议决议公告（2013年8月29日香港交易及结算所有限公司(以下简称“香港交易所”)披露易网站http://www.hkexnews.hk，次日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、上海证券交易所网站http://www.sse.com.cn）。
本次股东大会会议文件，将与本公告同期登载于上海证券交易所网站http://www.sse.com.cn、香港交易所披露易网站http://www.hkexnews.hk及公司网站http://www.cs.ecitic.com。
三、会议出席对象
1、截至本次股东大会股权登记日2013年10月22日（星期二）下午收市后，在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的公司A股股东（本公司的H股股东另行通知），均有权参加本次会议；股东可以书面委托代理人出席会议和参加表决，股东代理人不必是本公司股东。
2、H股股东登记及出席须知参阅公司在香港交易所披露易网站发布的本次股东大会通知及通函。
3、公司董事、监事和高级管理人员。
4、公司聘任的中介机构代表、公司聘请的见证律师及监票员等其他相关人员。
四、会议登记方法
（一）内资股股东
1、符合上述出席对象条件的内资股法人股东，法定代表人出席会议的，须持法定代表人证明文件、本人有效身份证件、股票账户卡进行登记；委托代理人出席会议的，代理人须持书面授权委托书（格式见附件一）、本人有效身份证件、股票账户卡进行登记。
符合上述条件的内资股自然人股东出席会议的，须持本人有效身份证件、股票账户卡等股权证明进行登记；委托代理人出席会议的，代理人须持书面授权委托书（格式见附件一）、本人有效身份证件、委托人股票账户卡等持股证明进行登记。
2、上述登记材料均需提供复印件一份，自然人股东登记材料复印件须股东本人签字，法人股东登记材料复印件须加盖股东单位公章。
3、拟出席本次会议的内资股股东应于2013年10月9日（星期三）或之前将拟出席会议的书面回复（格式见附件二）连同所需登记文件（授权委托书除外，其递交时间要求见下文）之复印件以专人送递、邮递或传真方式送达本公司。
4、提请各位参会股东，在股东登记材料上注明联系电话，方便会务人员及时与股东取得联系，避免股东登记材料出现错漏。发传真进行登记的股东，请在参会时携带股东登记材料原件，转交会务人员。
（二）境外上市外资股股东
详情请参见本公司于香港交易所披露易网站（http://www.hkexnews.hk）及本公司网站（http://www.cs.ecitic.com）向H股股东另行发出的2013年第二次临时股东大会通知及通函。
（三）进场登记时间
拟出席会议的股东或股东授权委托的代理人请携带登记文件原件或有效副本于2013年10月29日9时45分前至本次股东大会会议地点办理进场登记。
五、其他事项
（一）会期半天、费用自理。
（二）会议联系方式：
联系地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦（邮编：100026）
中信证券股份有限公司董事会办公室
联系人：曲先生
联系电话：（8610）60836030
传真：（8610）60836031
六、备查文件
中信证券第五届董事会第十六次会议决议
特此公告。
附件一：中信证券股份有限公司2013年第二次临时股东大会授权委托书
附件二：中信证券股份有限公司2013年第二次临时股东大会回复

中信证券股份有限公司董事会
2013年9月11日

附件一：

中信证券股份有限公司
2013年第二次临时股东大会授权委托书

兹全权委托　　先生（女士）代表本人（本股东单位）出席中信证券股份有限公司2013年第二次临时股东大会。
委托人姓名：
委托人身份证号码：
委托人股东账号：
委托人持股数：
代理人姓名：
代理人身份证号码：
委托有效期：
委托书签发日期：
投票指示：

特别决议案（一项）	同意	反对	弃权
关于增加公司经营范围的议案			
普通决议案（一项）	同意	反对	弃权
关于增选公司第五届董事会执行董事的议案			

注：①上述审议事项，委托人可以在“同意”、“反对”、“弃权”中划“√”，作出投票指示；
②如委托人未作任何投票指示，则代理人可以按自己的意愿表决。

委托人签名（盖章）：			
代理人签名：		签署日期	2013年　月　日

注：自然人股东签名；法人股东除法定代表人签名外，还需加盖公章。

填写说明：
1、请用正楷填上您的全名（须与股东名册上所载的相同）。
2、请填上持股数，如未填，则本授权委托书将被视为与依您名义登记的所有股份有关。
3、请填上代理人姓名，如未填，则大会主席将出任您的代表。股东可委派一名或多名代理人出席及投票，委派超过一位代理人的股东，其代理人只能以投票方式行使表决权。
4、本授权委托书的剪报、复印件或按以上格式自制均有效。
5、本授权委托书填妥后应于本次股东大会召开24小时前以专人、邮寄或传真方式送达本公司（北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦，邮政编码：100026）；联系人：曲先生；联系电话：（8610）60836030；传真：（8610）60836031。邮寄送达的，以邮戳日期为送达日期。

附件二：中信证券股份有限公司2013年第二次临时股东大会回复

股东姓名（法人股东名称）			
股东地址			
出席会议人员姓名		身份证号码	
法人股东之法定代表人姓名		身份证号码	
内资股持股数		股东账号	
联系电话		联系传真	
发言意向及要点：			
自然人股东签字/法人股东法定代表人签字并加盖公章： 2013年　月　日			

填表说明：
1、请用正楷填上您的全名（须与股东名册上所载的相同）及地址。
2、本回复在填妥及签署后于2013年10月9日（星期三）以前以专人、邮寄或传真方式送达本公司（北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦，邮政编码：100026）；联系人：曲先生；联系电话：（8610）60836030；传真：（8610）60836031。邮寄送达的，以邮戳日期为送达日期。
3、如股东拟在本次股东大会上发言，请于发言意向及要点栏目中表明您的发言意向和要点，并简要注明所需时间。请注意，因股东大会时间有限，股东发言由本公司按登记统筹安排，本公司不能保证在本回执上表明发言意向和要点的股东均能在本次股东大会上发言。

新华趋势领航股票型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期：2013年9月12日

1.公告基本信息