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.本招募说明书所载内容截止日为2013年9月14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。

二零一三年十月

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。

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。

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:许立庆
台湾政治大学工商管理硕士学位。
曾任摩根富林明台湾业务总经理、摩根资产管理亚太区行政总裁。
现任怡和(中国)有限公司主席、怡和管理有限公司董事;香港证券及期货事务监察委员会投资产品咨询委员会委员;富时台湾交易所台湾系列指数咨询委员会主席。

董事:Jed Laskowitz
获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。
曾负责管理J.P Morgan集团的美国基金业务。
现任摩根资产管理亚洲基金行政总裁及亚太区投资管理业务总监;J.P Morgan集团投资管理及环球基金营运委员会成员;美国资金管理协会(MMI)董事会成员;纽约州大律师公会会员。

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: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总裁助理。
现任上海国际集团有限公司副总裁、上海国际信托有限公司党委书记、董事长。

董事:章硕麟
获台湾大学商学硕士学位。
曾任怡富证券(台湾)投资顾问股份有限公司协理、摩根大通(台湾)证券副总经理、摩根富林明(台湾)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: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顾问。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:刘红忠
国际金融系经济学博士,现任复旦大学国际金融系主任、复旦大学国际金融研究中心副主任、中国金融学会理事、中国国际金融学会理事和上海市金融学会理事。

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: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教授。

2. 监事会成员基本情况:

监事长:郁忠民
研究生毕业,高级经济师。
历任华东政法学院法律系副主任;上海市证券管理办公室稽查处、机构处处长;上海国际集团有限公司投资管理部经理;上海证券有限责任公司副董事长、总经理、党委副书记。
现任上海国际集团金融管理总部总经理。

监事:Simon Walls
获伦敦大学帝国理工学院的数学学士学位。
历任JPMorgan Asset Management (Japan) Ltd总裁、首席运营官;JPMorgan Trust Bank总裁、首席运营官以及基础架构总监。
现任摩根资产管理日本董事长以及投资管理亚洲首席行政官。

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和上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金基金经理。

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总经理助理、风险管理部总监。

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(台湾)投资顾问股份有限公司协理、摩根大通(台湾)证券副总经理、摩根富林明(台湾)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。

经晓云女士,副总经理。
获上海财经大学工商管理硕士学位。
历任上海证券有限责任公司总经理办公室副主任(主持工作)、市场管理部经理,经纪管理总部副总经理、总经理,负责证券经纪业务的管理和运作。

冯刚先生,副总经理。
获北京大学管理科学硕士学位。
历任华宝兴业基金,先后任基金经理、国内投资部总经理。

陈星德先生,副总经理。
毕业于中国政法大学,获法学博士学位。曾任职于江苏省人大常委会、中国证监会、瑞士银行环球资产管理(香港)、国投瑞银基金管理有限公司,并曾担任上投摩根基金管理有限公司督察长一职。

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。

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

董红波先生,管理学硕士,曾任职于中华全国供销合作总社监察局及办公厅、中国平安人寿上海分公司战略发展部,2004年进入泰信基金管理公司,先后担任研究部副经理、泰信先行策略基金经理助理,2007年1月至2008年6月担任泰信先行策略基金经理,2008年7月加入上投摩根基金管理有限公司。2009年1月起担任上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金经理,自2012年2月起同时担任上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金基金经理,自2013年5月起同时担任上投摩根中国优势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。。

6. 基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

冯刚先生,副总经理兼A股投资总监;侯明甫先生,副总经理;杨逸枫女士,投资副总监;王炫先生,研究部总监;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;张军先生,基金经理;杜猛先生,基金经理;孙芳女士,基金经理;孟晨波女士,固定收益部总监;赵峰先生,固定收益部副总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、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:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2013年6月30日,中国建设银行资产总额148,592.14亿元,较上年末增长6.34%。2013年上半年,中国建设银行实现净利润1,199.64亿元,较上年同期增长12.65%。年化资产回报率为1.66%,年化加权净资产收益率为23.90%。利息净收入1,876.60亿元,较上年同期增长10.59%。净利差为2.54%,较上年同期提高0.01个百分点。净利息收益率为2.71%,与上年同期持平。手续费及佣金净收入555.24亿元,较上年同期增长12.76%。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、台北设有10家一级海外分行,拥有建行亚洲、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建银国际等5家全资子公司,海外机构已覆盖到全球14个国家和地区,基本完成在全球主要金融中心的网络布局,24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行27家,拥有建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司,为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2013年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与社会各界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的近30个重要奖项。在英国《银行家》杂志2013年"世界银行1000强排名"中位列第5,较上年上升1位;在美国《财富》世界500强排名第50位,较上年上升27位;在美国《福布斯》2013年全球2000强上市企业排行榜中位列全球第2,较上年提升11位。此外,本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部,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、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队,现有员工225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,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况

杨新丰,投资托管业务部总经理,曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,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。

张军红,投资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。

郑绍平,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,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2013年6月30日,中国建设银行已托管311只证券投资基金。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。中国建设银行在2005年及自2009年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为"中国最佳托管银行",在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为"国内最佳托管银行"奖,并获和讯网2011年度和2012年度中国"最佳资产托管银行"奖,和境内权威经济媒体《每日经济观察》2012年度"最佳基金托管银行"奖。

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。投资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

投资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指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,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,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

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、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,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。

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: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:姜建清
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:蒋超良
客户服务电话:95599
网址: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

(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
客户服务中心电话:95555
网址: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
联系人:曹榕
客户服务热线:95559
网址: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: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

(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

(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

(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

(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

(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

(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
联系人:李晓鹏
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
联系人:黄飞燕
客服电话:961122
网址: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:胡平西
门户网站:www.srcb.com
客户服务电话:021-962999

(20)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:储晓明
电话:021-54033888
传真:021-54038844
客户服务电话:(021)962505
网址:www.sywg.com

(21)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:龚德雄
电话:(021)53519888
传真:(021)53519888
客户服务电话:4008918918(全国)、021-962518
网址:www.962518.com

(22)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:万建华
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

(23)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

(24)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

(25)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

(26)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

(27)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

(28)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
公司网址:www.xyzq.com.cn

(29)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

(30)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:齐晓燕
客户服务电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn

(31)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

(32)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
联系电话:025-84457777-248
网址:www.htsc.com.cn

(33)中信证券股份有限公司
注册地址:北京市招商银行大厦A层
办公地址:北京朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦20
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

(34)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

(35)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

(36)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

(37)中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法人代表:沈强
联系电话:0571-95548
公司网站:www.bigsun.com.cn
客户服务中心电话:0571-95548

(38)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(1507-1510室)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层(266061)
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:0532-96577
公司网址:www.zxwt.com.cn

(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:姚文平
电话:021-68761616
客服电话:4008888128
网址:www.tebon.com.cn

(42)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

(43)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
电话:010-88085858
传真:010-88085344
公司客服电话:4008-000-562
公司网址:www.hysec.com

(44)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

(45)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

(46)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

(47)财富里昂证券有限责任公司
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
公司网址:www.cf-clsa.com

(48)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

(49)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室
法定代表人:汪静波
客服电话:400-821-5399
公司网站: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

(51)深圳众禄基金销售有限公司
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 www.jjmmw.com

(52)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:敖玲
联系电话:021-58788678-8201
传真:021—58787698
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.erichfund.com

(53)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:0571-88920897
公司网站:爱基金网 www.ijijin.cn

(54)杭州数米基金销售有限公司
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
客服电话:400-0766-123
公司网站:www.fund123.cn

(55)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

(56)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

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: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。

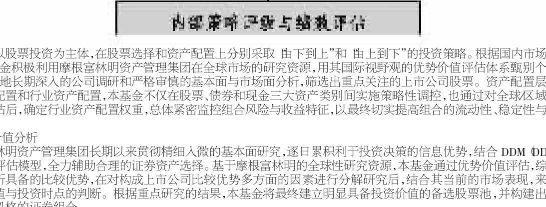
(三)投资范围

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%×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:

[illegible]

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,613,494,427.55	77.45
	其中:股票	2,613,494,427.55	77.45
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	-	-
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	758,700,659.33	22.49
7	其他各项资产	2,046,702.37	0.06
8	合计	3,374,241,789.25	100.00

注:截至2013年06月30日,上投摩根中国优势证券投资基金资产净值为3,298,359,186.01元,基金份额净值为1.5618元,累计基金份额净值为4.6318元。

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	-	-
C	制造业	1,953,088,479.83	59.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,907,490.00	0.45
E	建筑业	98,304,038.39	2.98
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	22,828,925.00	0.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	118,158,498.38	3.58
J	金融业	222,870,414.12	6.76
K	房地产业	131,724,601.45	3.99
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,784,922.15	0.24
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	43,827,058.23	1.33
S	综合	-	-
	合计	2,613,494,427.55	79.24

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	600688	S上石化	37,000,000	303,030,000.00	9.19
2	002038	双鹭药业	4,197,143	245,952,579.80	7.46
3	000800	一汽轿车	18,769,873	230,869,437.90	7.00
4	600518	康美药业	10,733,683	206,408,724.09	6.26
5	600720	祁连山	20,948,666	178,901,607.64	5.42
6	600871	S仪化	19,590,700	165,933,229.00	5.03
7	600837	海通证券	16,780,749	157,403,425.62	4.77
8	600406	国电南瑞	7,914,166	118,158,498.38	3.58
9	600519	贵州茅台	523,453	100,696,653.61	3.05
10	000718	苏宁环球	16,963,400	99,744,792.00	3.02

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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

8 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。

9、投资组合报告附注

1)本基金投资的贵州茅台酒股份有限公司(下称:贵州茅台,股票代码:600519)于2013年2月23日公告其控股子公司贵州茅台酒销售有限公司于2013年2月22日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》(黔价处[2013]1号)。该决定书认为:贵州茅台酒销售有限公司对全国经销商向第三人销售茅台酒的最低价格进行限定,违反了《中华人民共和国反垄断法》第十四条的规定。为此,根据《中华人民共和国反垄断法》第四十六条、《中华人民共和国行政处罚法》第二十七条的规定给予处罚,限贵州茅台酒销售有限公司自收到该决定书之日起十五日内将罚款二亿四千七百万元人民币上交国库。

对上述股票投资决策程序的说明:本基金管理人在投资贵州茅台前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库,由研究员跟踪并分析。上述事件发生后,本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

除上述股票外,本基金投资的其余九名证券的发行主体本期未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。

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)其他资产项目包括:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,098,608.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	125,926.21
5	应收申购款	822,167.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,046,702.37

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:

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600688	S上石化	303,030,000.00	9.19	股权分置改革
2	600871	S仪化	165,933,229.00	5.03	股权分置改革

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。

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%
2010/1/1-2010/12/31	-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%
2013/1/1-2013/6/30	-13.86%	1.57%	-7.40%	1.02%	-6.46%	0.55%

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、招募说明书更新部分说明

本基金于2004年9月15日成立,至2013年9月14日运作满九年。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2013年4月27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、在重要提示中,更新内容截止日为2013年9月14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"三、基金管理人"的"主要人员情况"中,对董事、监事、其他高级管理人员、基金经理和投资决策委员会成员等信息进行了更新。
3、在"四、基金托管人"中,根据托管人的最新情况进行了更新。
4、在"五、相关服务机构"中,变更并更新了代销机构的相关信息。
5、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。
6、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。
7、在"二十一、对基金份额持有人的服务"的"基金电子交易服务"中,对基金电子交易服务的相关情况进行了更新。
8、在"二十二、其他应披露事项"中列示了报告期内的重大事项。

上投摩根基金管理有限公司
2013年10月29日