

上投摩根阿尔法股票型证券投资基金

招募说明书（更新）

核准文号：中国证监会证监基金字[2005]155号文

核准日期：[2005年9月7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。

二零零七年五月

上投摩根阿尔法股票型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	5
四、基金托管人	13
五、相关服务机构	16
六、基金的募集	23
七、基金份额的申购、赎回和转换	24
八、基金的投资	31
九、基金的业绩	42
十、基金的财产	42
十一、基金资产的估值	43
十二、基金的收益与分配	46
十三、基金的费用与税收	47
十四、基金的会计与审计	49
十五、基金的信息披露	49
十六、风险揭示	53
十七、基金的终止与清算	55
十八、基金合同的内容摘要	56
十九、基金托管协议的内容摘要	64
二十、对基金份额持有人的服务	67
二十一、招募说明书的存放及查阅方式	68
二十二、备查文件	68

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《上投摩根阿尔法股票型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阿尔法股票型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出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

在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1. 基金或本基金：指上投摩根阿尔法股票型证券投资基金
2. 基金管理人或本基金管理人：指上投摩根基金管理有限公司
3. 基金托管人或本基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
4. 基金合同或本基金合同：指《上投摩根阿尔法股票型证券投资基金基金合

同》及对本基金合同的任何有效修订和补充

5. 托管协议或本托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《上投摩根阿尔法股票型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6. 招募说明书：指《上投摩根阿尔法股票型证券投资基金招募说明书》，招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件，自基金合同生效之日起，每 6 个月更新 1 次，并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告，更新内容截至每 6 个月的最后 1 日

7. 基金份额发售公告：指《上投摩根阿尔法股票型证券投资基金份额发售公告》

8. 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9. 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订

10. 《销售办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》

11. 《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》

12. 《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》

13. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会

14. 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

15. 基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

16. 个人投资者：指年满 18 周岁，合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民，以及中国证监会批准的其他可以投资基金的自然人

17. 机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业

法人、社会团体或其他组织

18. 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，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构

19. 投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的合称

20. 基金份额持有人：指依基金合同或招募说明书合法取得基金份额的投资人

21. 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

22. 销售机构：指直销机构和代销机构

23. 直销机构：指上投摩根基金管理有限公司

24. 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其它条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

25. 基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

26. 注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

27. 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为上投摩根基金管理有限公司或接受上投摩根基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

28. 基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、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

29. 基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖上投摩根阿尔法股票型基金份额的变动及结余情况的账户

30. 基金合同生效日：指基金募集期结束后达到成立条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期

31. 基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期

32. 基金募集期限：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

33. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

35. T 日：指销售机构确认的投资人有效申请工作日

36. T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日 (不包含 T 日)

37. 开放日：指基金管理人办理基金份额申购、赎回或其他业务的日期

38. 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

39. 业务规则：指《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记运作方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

40. 认购：指在基金募集期间，投资人申请购买基金份额的行为

41. 申购：指在基金存续期内，投资人申请购买基金份额的行为

42. 赎回：指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基金份额的行为

43. 基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效的业务规则在本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为

44. 转托管：指基金份额持有人在同一基金的不同销售机构之间实施的所持基金份额销售机构变更的操作

45. 巨额赎回：本基金单个开放日，基金净赎回申请 (赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额) 超过上一日基金总份额的 10% 时

46. 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

47. 元：指人民币元

48. 基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

49. 基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

50. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

51. 基金份额净值：指基金份额的资产净值

52. 基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

53. 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

54. 不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

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：

住所：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：王鸿嫔

成立日期：2004 年 5 月 12 日

实缴注册资本：1.5 亿元人民币

股东名称、股权结构及持股比例：

上海国际信托投资有限公司	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投资有限公司 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。

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，中共党员，高级经济师。

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，现任上海国际集团有限公司副总经理。

独立董事 3 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

获英国 Sussex University 博士学位，曾就读于上海复旦大学经济学系、上海复旦大学世界经济系。

现任复旦大学金融研究院常务副院长，国务院学位委员会学科评议组成员，博士后，教授，博士生导师。

独立董事：Robert Herries

获英国剑桥大学文学硕士学位。

历任 JF 集团有限公司董事、南非标准银行（非洲及中东第一大银行）行政总裁。

现任 Tree Line Advisors (Hong Kong) Limited 营运总监。

董事 5 名：

董事：Clive Brown

获布里斯托大学理学学士学位。

历任 JF 控股有限公司财务总监，JF 投资管理有限公司首席执行官。

现任摩根富林明资产管理国际总裁。

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有限公司董事长。

现任 JF 资产管理亚太区(不包括日本)总裁。

董事：冯忠信

获英国伦敦市理工学院学士学位。

历任 JF 资产管理有限公司基金会计董事等。

现任 JF 资产管理有限公司营运总监。

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总经理助理。

董事：林彬

获中欧工商管理学院 MBA。

曾任香港上市的沪光基金副总经理。

现任上海国际信托投资有限公司副总经理。

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

香港特许公认会计师工会资深会员，香港特许秘书公会会士，香港会计师公会会士，英国特许秘书及行政人员公会会员。

曾任怡富控股有限公司财务董事，JF 资产管理有限公司副总裁。

现任 JF 资产管理有限公司总经理。

监事：陈达

本科学历，中国注册会计师。

曾任华安基金管理有限公司基金会计，国联安基金管理有限公司基金事务部副总监。

现任上投摩根基金管理有限公司基金作业部总监。

3. 总经理基本情况：

王鸿嫔女士，总经理。

毕业于台湾清华大学经济系。

历任摩根富林明投资信托股份有限公司电子商务部副总经理，摩根富林明投资顾问股份有限公司总经理。

4. 其他高级管理人员情况：

刘樱女士，副总经理。

毕业于复旦大学法律系。

历任上海国际集团有限公司法律部总经理，上海国际集团有限公司监事。

傅帆先生，副总经理。

获伦敦城市大学工商管理学硕士学位。

历任上投实业公司副总经理，上海国际信托投资有限公司副总经理。

刘建平先生，督察长。

毕业于北京大学法律系，获法学硕士学位。

历任中国证券监督管理委员会基金监管部副处长。

5、本基金基金经理

基金经理孙延群，男，1968年出生，硕士学历，中国注册会计师，8年证券从业经验。1992年进入哈尔滨飞机制造公司；1997年至2003年间，分别在中兴信托投资有限公司上海证券管理总部及平安证券有限责任公司担任行业分析师；2003年3月进入景顺长城基金管理有限公司，任景顺长城内需增长基金的基金经理；2005年6月加入上投摩根基金管理有限公司投资管理部，从2005年11月起担任上投摩根阿尔法基金的基金经理；并从2007年4月起同时担任上投摩根内需动力股票型证券投资基金的基金经理。

6. 基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

王鸿嫔女士，总经理；吕俊先生，投资总监；孙延群先生，基金经理；芮崑

先生，基金经理；赵梓峰先生，基金经理兼研究总监。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、 计算并公告基金财产净值，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《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，但是国务院另有规定的除外；
 - （2） 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；

- (3) 从事有可能使基金承担无限责任的投资；
- (4) 从事证券承销行为；
- (5) 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；
- (6) 违反证券交易业务规则，操纵和扰乱市场价格；
- (7) 违反法律法规而损害基金份额持有人利益的；
- (8) 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权益；
- (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不断发展完善内部合规控制。

4、风险管理体系：

- （1）董事会下设风险管理委员会，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。
- （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管控，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：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：壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍万元人民币

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 5104

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的历史，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：HK0939）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。截至 2006 年 6 月 30 日止，中国建设银行总资产为人民币 51,662.42 亿元，客户存款为人民币 44,915.66 亿元，2006 年上半年实现税前利润人民币 328.14 亿元。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、东京及首尔设有分行，在伦敦、纽约设有代表处。2006 年 8 月 24 日，中国建设银行在香港与美国银行签署协定，收购美国银行在香港的全资子公司美国银行（亚洲）股份有限公司 100% 的股权。中国建设银行在《银行家》2006 年公布的全球银行按一级资本排名中，名列中国银行业榜首，在世界大银行中列第 11 位。中国建设银行在《福布斯》2006 年全球领先企业榜中为第 65 名，列中国第二位。在《亚洲周刊》2006 年 7 月公布的亚洲银行 300 强排名中，中国建设银行在“利息收入净值最高的银行”和“纯利最高的银行”两项排名中均列第一位，被誉为“亚洲最赚钱的银行”。此外，在 2006 年度《亚洲金融》亚洲最佳公司评选中，中国建设银行入选“最佳管理公司”、“最佳公司管治”、“最佳派息承诺”排行榜。

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、监督稽核处和投资委托托管团队等 8 个职能处室，现有员工 80 余人。

（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领导经验。

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、国际业务部工作,对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有较丰富相关工作经验。

(三) 基金托管业务经营情况

截止到 2006 年 12 月 31 日,中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、金鼎、汉博、通宝、通乾、鸿飞、银丰等 11 只封闭式证券投资基金,以及华夏成长、融通新蓝筹、博时价值增长、华宝兴业宝康系列(包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置 3 只子基金)、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华宝兴业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华-道琼斯 88 精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华富竞争力优选、华宝兴业现金宝、上投摩根货币市场、华夏红利、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、长城消费增值、华安上证 180ETF、上投摩根双息平衡、泰达荷银效率优选、华夏深圳中小企业板 ETF、交银施罗德稳健配置、华宝兴业收益增长、华富货币市场、工银瑞信精选平衡、鹏华价值优势、中信稳定债券、华安宏利、上投摩根成长先锋、博时价值增长贰号、海富通风格优势、银华富裕主题、华夏优势增长、信诚精萃成长、工银瑞信稳健成长等 44 只开放式证券投资基金。

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,直接负责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。投资托管服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

投资托管服务部具备系统、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；业务管理实行严格复核、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《证券投资基金法》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“证券投资基金托管业务综合系统——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，如发现接近法律法规和基金合同规定的控制比例情况，及时提醒基金管理人；发现异常情况，与基金管理人进行情况核实后，并向基金管理人发出书面通知，督促其纠正，同时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资用途及费用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，编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作进行合法合规性、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。

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

注册地址: 北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人: 郭树清

客户服务统一咨询电话: 95533

网址: www.ccb.cn

(2) 上海浦东发展银行

注册地址: 上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址: 上海市银城中路 188 号

法定代表人: 张广生

电话: 021-68881829

传真: 021-68881851

联系人: 杨静

客户服务电话: 021-68881829

网址: www.spdb.com.cn

(3) 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: 上海市延平路 135 号

法定代表人: 祝幼一

电话: (021) 62580818 转 213

传真: (021) 62569400

联系人: 芮敏祺

客户服务咨询电话: 400-8888-666

网址: www.gtja.com

(4) 上海证券有限责任公司

注册地址: 上海市九江路 111 号

法定代表人: 蒋元真

电话: (021) 65087006

传真: (021) 65213164

联系人: 刘永

客户服务电话 800-6200-071

网址: www.962518.com

(5) 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: 王明权

电话: 021-962505、021-54033888

传真: 021- 54038844

联系人: 胡洁静

客户服务电话: (021)962505

网址: www.sw2000.com.cn

(6) 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: 官少林

电话: (0755)26951111 (客户服务中心)

传真: (0755)82943237

联系人: 黄健

客户服务电话: 400-8888-111

网址: www.newone.com.cn

(7) 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15-16 楼

法定代表人: 王明权

电话: 021-68816000

传真: 021-68815009

联系人: 刘晨

客户服务电话: 021-68823685

网址: www.ebscn.com

(8) 中国银河证券有限责任公司

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: 朱利

电话: (010)66568587

传真: (010) 66568536

联系人: 郭京华

客户服务热线: (010) 68016655

网址: www.chinastock.com.cn

(9) 中信建投证券有限责任公司

注册地址: 北京市东城区新中街 68 号

办公地址: 北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人: 黎晓宏

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

(10) 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: 021-68419125

联系人: 杨盛芳

客户服务热线: 021-68419974

兴业证券公司网站 (www.xyzq.com.cn)

(11) 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) 53594566 转 4125

传真: (021) 53858549

联系人: 金芸

客户服务咨询电话: (021) 962503

网址: www.htsec.com

(12) 广发证券股份有限公司

注册地址: 广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室

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：肖中梅

咨询电话：(020) 87555888 转各营业网点

传真：(020) 87557985

公司网站：<http://www.gf.com.cn>

(13) 交通银行

注册地址：上海市仙霞路 18 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：方诚国

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58400370

联系人：江永珍

客户服务电话：95559

网址：<http://www.bankcomm.com>

(14) 联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

法定代表人：马国强

电话：0755-82493561

传真：0755-82492187

联系人：盛宗凌

客户服务热线：4008888555

网址：www.lhzq.com

(15) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号

办公地址：福建省福州市湖东路 154 号

客户服务热线：95561

网址：www.cib.com.cn

(16) 国信证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人：何如

咨询电话：8008108868

公司网站：www.guosen.com.cn

(17) 国都证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格广场 45 层

办公地址：北京市安外大街安贞大厦 3 层

法定代表人：王少华

全国业务咨询电话：800-810-8809

开放式基金业务传真：010-64482090

联系人：马泽承

网址：www.guodu.com

(18) 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

(19) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座

法定代表人：林义相

客户服务热线：8610-84533151*822 或 802

网址：www.txsec.com

(20) 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：张雪瑾

联系电话：(025) 84457777-882

网址：www.htsc.com.cn

(21) 上海银行

办公地址：上海市中山东二路 585 号

法定代表人：陈辛

联系人：张浩

联系电话：021-63370888

传真：021-63370777

客户服务热线：021-962888

网址：www.bankofshanghai.com

(22) 中信证券股份有限公司

办公地址：

电话：010-84588888

传真：010-84865560

公司网址：www.ecitic.com

(23) 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：王益民

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客户服务热线：021-962506

东方证券网站：www.dfzq.com.cn

(24) 德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 588 号浦发大厦 26 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 588 号浦发大厦 26 楼

法定代表人：王军

电话：021-68590808

传真：021-68596077

客户服务电话：021-68590808-8119

公司网址：www.tebon.com.cn

(25) 财富证券有限责任公司联系方式如下：

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：胡军

电话：0731-4403343

联系人：张治平

公司网址：www.cfzq.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：上海市浦东新区浦东南路 528 号，上海证券大厦南塔 21 楼

负责人：韩炯

联系电话：021-6881 8100

传真：021-6881 6880

经办律师：傅轶、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

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室

法定代表人：杨绍信

联系电话：8621-61233277

联系人：郁豪伟

经办注册会计师：汪棣 陈宇

六、基金的募集

本基金经中国证监会证监基金字（2005）155 号文件批准，自 2005 年 9 月 14 日至 9 月 29 日为募集期，本次募集的净销售额为 767,319,308.57 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 300,779.58 元人民币。

本次募集有效认购总户数为 8,537 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 767,319,308.57 份基金份额，利息结转的基

金份额为 300,779.58 份基金份额，两项合计共 767,620,088.15 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 2005 年 10 月 11 日生效。基金存续期限为不定期。

七、基金份额的申购、赎回和转换

（一）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过本基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。条件成熟时，投资者可通过基金管理人或其指定的代销机构以电话、传真或网上等形式进行申购与赎回，具体办法另行公告。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1. 开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

2. 申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过30天开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过30天开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始日后，由基金管理人最迟于开始日前 1 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

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。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

(三) 申购与赎回的程序

1. 申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的交易时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

2. 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，并在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购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，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

(四) 申购和赎回的金额

1. 申购的单笔最低金额为1,000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. 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1000份，基金账户余额不得低于1000份，如进行一次赎回后基金账户中基金份额余额将低于1000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 1000 份之情况，不受此限，但再次赎回时必须一次性全部赎回。

3. 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见定期更新的招募说明书。

4. 基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前 3 个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

(五) 申购和赎回的价格、费用及其用途

1. 基金申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} \times \text{申购费率}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / \text{T 日基金份额净值}$$

申购费率如下表所示：

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， 1000 万元以下	0.3 %
1000 万元（含）以上	1000 元

2. 基金赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times \text{T 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

赎回费率如下表所示：

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%

3. T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

4. 申购份额余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

5. 赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

6. 本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

7. 本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

8. 赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费总额的 25% 归基金财产，75% 用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

9. 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 3 个工作日内在至少一种指定媒体公告。

10. 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) 拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1. 不可抗力。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
4. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分。
5. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

(七) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1. 不可抗力。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 连续两个开放日发生巨额赎回。
4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
5. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已接受的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，但不得超过正常支付时间 20 个工作日。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

(八) 巨额赎回的情形及处理方式

1. 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

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人的赎回申请时，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人的赎回申请有困难或认为支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 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；投资人未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

3. 巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案，并在 2 日内通过指定媒体、基金管理人的公司网站或销售机构的网点刊登公告，说明有关处理方法。

连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受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。

(九) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1. 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内在至少一种指定媒体上刊登暂停公告。

2. 如发生暂停的时间为 1 日，第 2 个工作日基金管理人应在至少一种指定媒

体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3. 如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4. 如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在至少一种指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

(十) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并及时告知基金托管人与相关机构。

(十一) 基金的非交易过户

指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户。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。

继承是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；捐赠指受理基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起 2 个月内办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

(十二) 基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

(十三) 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人提供定期定额投资计划服务，具体实施方法以定期更新的招募说明书和基金管理人届时公布的业务规则为

准。

八、基金的投资

(一) 投资目标

本基金采用哑铃式投资技术 (Barbell Approach)，同步以“成长”与“价值”双重量化指标进行股票选择。在基于由下而上的择股流程中，精选个股，纪律执行，构造出相对均衡的不同风格类资产组合。同时结合公司质量、行业布局、风险因子等深入分析，对资产配置进行适度调整，努力控制投资组合的市场适应性，以求多空环境中都能创造超越业绩基准的主动管理回报。

(二) 投资理念

实践表明，价值投资 (Value Strategies) 和成长投资 (Growth Strategies) 在不同的市场环境中都存在各自发展周期，并呈现出一定的适应性。本基金将价值投资和成长投资有机结合，以均衡资产混合策略建立动力资产组合，努力克服单一风格投资所带来的局限性，并争取长期获得主动投资的超额收益。

(三) 投资范围

本基金的投资范围为股票、债券、货币市场工具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、企业债、可转换债券等，货币市场工具包括短期票据、回购、银行存款以及一年以内（含一年）的国债、金融债、企业债等。在正常情况下，本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 60 - 95%，其它为 5 - 40%，并保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

(四) 投资策略

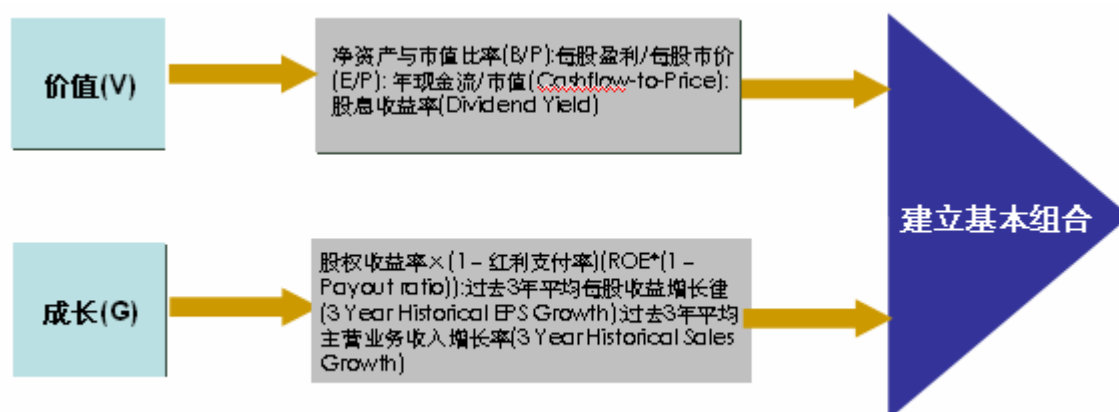
本基金充分借鉴摩根富林明资产管理集团全球行之有效的投资理念和技术，依据中国资本市场的具体特征，引入集团在海外市场成功运作的“Dynamic Fund”基金产品概念。具体而言，本基金将以量化指标分析为基础，通过严格的证券选择，积极构建并持续优化“哑铃式”资产组合，结合严密的风险监控，不断谋求超越业绩比较基准的稳定回报。

1、股票选择策略

1) 选取价值/成长因子

传统做法，基金经理人为追求较佳业绩，通常会采取“多头时买进成长型股票”、“空头时转进价值股”的策略。不过，随着经济景气循环缩短、市场变化日益加速，多空判断越来越不易。本基金透过财务指标及严格选股，纪律式定期调整投资组合，在于克服人性弱点、保留投资智慧，积极争取主动管理报酬。

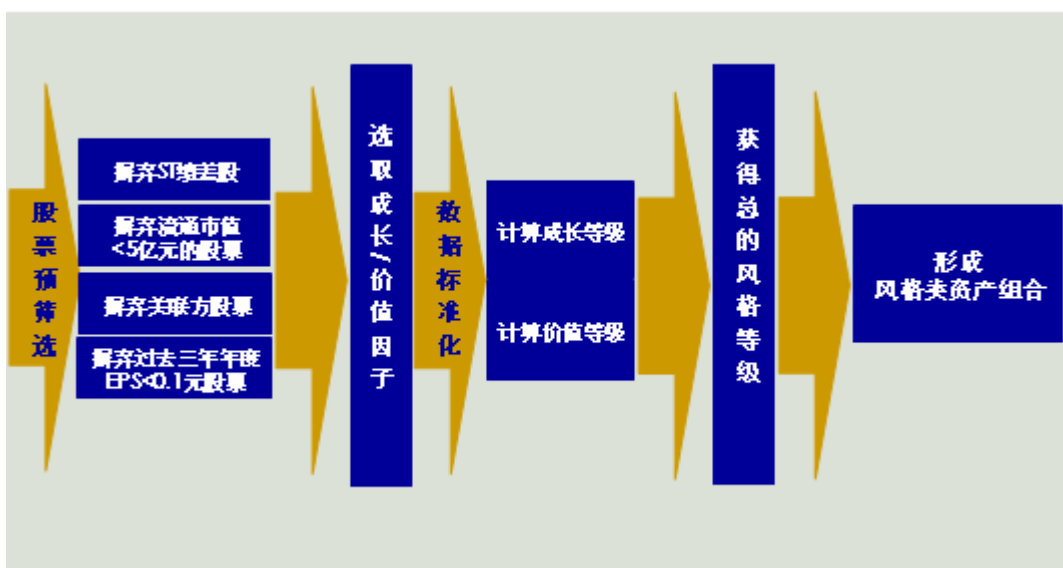
其中，投资策略的重点即贯彻“哑铃式投资”，即投资布局的搭配形同哑铃，强调两端投资，价值与成长性能平衡。同步执行价值与成长选股策略，兼顾价值与成长型股票，可以较好控制组合市场适应性，一定程度上能够排除对景气误判概率，以求多空环境中都能创造主动管理回报。



依据市场景气循环及相关环境变化，基金管理人将动态检视上述价值因子与成长因子的有效性，在严谨量化分析基础上，予以进行适度调整。

2) 计算股票风格等级

为合理辨别上市公司价值和成长特征，本基金根据现代统计学的基本理论，将各风格因子进行数据标准化。经过科学计算后，最终得到每一只股票的风格等级。本基金将最具价值特征的股票风格等级定为 0，最具成长特征的股票风格等级定为 100，所有排名被分别分配到各风格衡量中。具体流程见下图。



每家上市公司的价值和成长因子都配有一个风格排名，用其确定价值和成长因子排名。获得价值和成长因子序列后，个股的总体风格排名经过算术平均后即得出。这样，依据个股价值与成长属性的排序筛选股票，并进而形成相对均衡的风格类资产组合。

通过执行数据标准化的程序，在摒弃异常数据的同时，可以更加合理的多层面评估上市公司价值和成长特征，基金管理人不仅能够深入鉴别股票可投资性能，增加投资组合的长期稳定效益，也可以借助风格因子的追踪调整及投资组合的重新平衡，更好地判断市场方向与把握市场中价值与成长的变换节奏。

3) 创造主动管理报酬

本基金以量化指标进行个股筛选，然后研究团队将对个股进行基本面审核，结合跟踪误差的紧密监控，以求不论指数高低、市场多空皆创造主动管理回报，从而不仅改善市场环境中的负面影响，也努力达到投资者利用基金产品进行理财的目标。本基金拥有三重主动管理报酬来源，分别是：

① 量化指标分析：

- ◆ 运用多重量化模型，以“成长”、“价值”指标进行严谨的股票筛选；
- ◆ 通过数据标准化过程，计算每一只股票的风格等级并排序；
- ◆ 依据市场环境及基金管理人实践经验，可对风格指标进行合理调整。

② 基本面分析

- ◆ 研究团队对入选个股进行基本面审核；
- ◆ 在两类风格股票池中，所有个股进行策略性分类：优质级、品质级、转型级和交易级；
- ◆ 依据上述结论，调整步骤一中的个股名单。

③ 核心库确认

- ◆ 投研团队根据行业布局、风险因子等进行最后阶段筛选；
- ◆ 紧密监控组合跟踪误差，及时反馈组合变化信息；
- ◆ 确认核心库后，将定期重复上述步骤，对组合进行调整。



2、固定收益类投资策略

本基金以股票投资为主，为控制股票投资风险，优化组合流动性管理，本基金适度考虑配置防御性资产，进行债券、货币市场工具等品种的投资。对于此类资产的选择，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券种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、供求变化等因素的综合分析，

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；

在券种选择上，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，合理运用投资管理策略，实施积极主动的债券投资管理。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，重点关注利率趋势变化；其次，在判断利率变动趋势时，我们将重点考虑货币供给的预期效应（Money-supply Expectations Effect）、通货膨胀与费雪效应（Fisher Effect）以及资金流量变化（Flow of Funds）等，全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、债券市场政策趋势、物价水平变化趋势等因素，对利率走势形成合理预期。

2) 估值策略：建立不同品种的收益率曲线预测模型，并通过这些模型进行估值，确定价格中枢的变动趋势。根据收益率、流动性、风险匹配原则以及债券的估值原则构建投资组合，合理选择不同市场中有投资价值的券种，并根据投资环境的变化相机调整。

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评估为核心。通过久期管理，合理配置投资品种。在预期利率下降时适度加大久期，在预期利率上升时适度缩小久期。

4) 流动性管理：本基金会紧密关注申购/赎回现金流情况、季节性资金流动、日历效应等，建立组合流动性预警指标，实现对基金资产的结构化管理，以确保基金资产的整体变现能力。

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

新华富时 A 全指 $\times 80\%$ + 同业存款利率 $\times 20\%$ 。

新华富时 A 全指以沪深两市上市的 A 股股票为选样基础，根据流动性标准、可投资标准、以及受影响的股票标准进行初步筛选，形成合格样本股集合；在合格样本股集合上，按照总市值排序，选取累积市值前 95% 的公司形成最终指数样本股集合；按照可投资股本进行加权形成最终指数。作为衡量股市走向的基准，

新华富时 A 全指能够比较全面的反映国内 A 股市场的总体趋势。由于本基金贯彻由下而上、精选个股的投资策略，力求在全市场优选品种，构建相对均衡的风格类资产组合，同时根据本基金防御性资产的配置特征，选择上述业绩比较基准可以比较客观的反映本基金投资运作水平，并如实反映本基金的风险收益特征。

如果今后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对业绩比较基准予以调整。业绩比较基准的变更需经基金管理人和基金托管人协商一致，并在更新的招募说明书中列示。

(六) 风险收益特征

本基金是股票型证券投资基金，属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金产品。

(七) 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。本基金将在总结、借鉴公司旗下已有两只开放式基金风险管理成熟经验基础上，采用上投摩根基金管理有限公司的风险监控与绩效评估体系，建立针对本基金特点的风险管理模式，在组合构建、投资运作以及绩效评估等各环节全面贯彻风险管理机制。

1、 监控多重因子，实现对跟踪误差的事前/事中/事后控制

本基金追求超越业绩基准的相对收益，衡量投资组合相对于业绩基准风险的有效指标正是跟踪误差(Tracking Error)。跟踪误差可明确衡量基金管理人主动操作风险，本基金将适时监控与修正跟踪误差来控制运作风险，追求较长期而稳定的获利机会(Better Risk & Return Profile)。



针对影响跟踪误差的多重元素，本基金将对投资组合进行前瞻性风险配置，根据预设的风险目标构建效率组合。投资团队对本基金投资组合进行定期系统性审查，结合跟踪误差变化，及时评估资产配置等策略，必要时进行适度调整，以达到风险控制的标准。

2、考察跟踪误差边际贡献实现风险控制

由于跟踪误差是投资组合与基准指数报酬差异率的标准差，是由多个偏离基准指数的操作策略所构成，因此通过考察跟踪误差边际贡献 (Marginal Contribution)，可了解投资组合内容每一微小之变动对跟踪误差的影响，以此作为基金管理人进行投资决策的参考依据。

基金管理人将掌握每一投资决策所产生之跟踪误差的边际贡献，作好投资组合风险控制工作，力求跟踪误差不会过于偏离预设目标。此外，跟踪误差的边际贡献也有助于基金管理人进行投资组合跟踪误差的修正。如果跟踪误差超出预设风险区域，本基金将根据风险归因分析对边际风险贡献率最大的个股进行调整，适时控制跟踪误差，保证投资组合所承担的风险程度符合既定目标。

(八) 投资限制

1. 组合限制

基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (2) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的 10%；
- (3) 本基金股票投资比例为基金总资产的 60－95%，其它为 5－40%；
- (4) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (5) 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；
- (6) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
- (7) 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。

因证券市场波动、上市公司合并、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)－(4) 项规定的投资比例的，基金管理人应当在

10 个交易日内进行调整。

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。

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) 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。

(九) 基金的融资

本基金可以按照国家的有关规定进行融资。

(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) 基金的投资组合报告

1、报告期末基金资产组合情况

截至 2006 年 12 月 31 日，上投摩根阿尔法股票型证券投资基金资产净值为 4,746,987,323.25 元，基金份额净值为 2.7008 元，累计基金份额净值为 2.7408 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	股票	3,857,346,785.92	80.75%
2	债券	220,219,893.20	4.61%
3	权证	12,920,584.35	0.27%
4	银行存款及清算备付金	455,980,358.22	9.54%
5	其他资产	230,287,457.97	4.83%
	合计	4,776,755,079.66	100.00%

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	分 类	市 值 （元）	市值占基金资产净值比例
1	A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
2	B 采掘业	212,100,929.02	4.47%
3	C 制造业	1,855,806,473.95	39.09%
	C0 食品、饮料	380,521,651.37	8.02%
	C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
	C2 木材、家具	0.00	0.00%
	C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	287,602,848.00	6.06%
	C5 电子	24,764,251.38	0.52%
	C6 金属、非金属	670,472,461.04	14.12%
	C7 机械、设备、仪表	409,694,090.95	8.63%
	C8 医药、生物制品	57,355,979.00	1.21%
	C99 其他制造业	25,395,192.21	0.53%
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	135,711,285.53	2.86%
5	E 建筑业	0.00	0.00%
6	F 交通运输、仓储业	167,240,349.29	3.52%
7	G 信息技术业	56,589,741.54	1.19%
8	H 批发和零售贸易	340,380,047.87	7.17%
9	I 金融、保险业	585,261,444.86	12.33%
10	J 房地产业	205,617,909.76	4.33%
11	K 社会服务业	109,341,488.82	2.30%
12	L 传播与文化产业	0.00	0.00%
13	M 综合类	189,297,115.28	3.99%
	合计	3,857,346,785.92	81.26%

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	股票数量 (股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600036	招商银行	18,399,379	301,013,840.44	6.34%
2	601398	工商银行	36,131,690	224,016,478.00	4.72%
3	600005	武钢股份	33,517,978	213,174,340.08	4.49%
4	600299	星新材料	10,600,382	193,774,982.96	4.08%
5	000002	万科A	10,900,789	168,308,182.16	3.55%
6	600761	安徽合力	6,211,511	138,206,119.75	2.91%
7	600858	银座股份	5,616,246	114,346,768.56	2.41%
8	600219	南山铝业	12,646,199	113,689,329.01	2.39%
9	600019	宝钢股份	11,598,108	100,439,615.28	2.12%
10	600456	宝钛股份	3,200,764	99,223,684.00	2.09%

4、报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	券种	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	国债	0.00	0.00%
2	金融债	220,219,893.20	4.64%
3	可转债	0.00	0.00%
4	央行票据	0.00	0.00%
5	企业债	0.00	0.00%
	合计	220,219,893.20	4.64%

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

序号	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	06 农发 06	60,054,650.00	1.27%

2	04 国开 15	50,582,700.00	1.07%
3	06 国开 27	39,473,543.20	0.83%
4	04 国开 01	30,321,000.00	0.64%
5	02 进出 03	19,934,000.00	0.42%

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

无

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 2006 年 12 月 31 日，本基金的其他资产项目包括：

序号	其他资产项目	金额（元）
1	交易保证金	441,854.52
2	应收利息	2,879,588.42
3	应收申购款	66,142,653.35
4	应收证券清算款	160,823,361.68
	其他资产项目合计	230,287,457.97

4) 截至 2006 年 12 月 31 日，本基金持有的处于转股期的可转债明细如下：

无

5) 截至 2006 年 12 月 31 日，本基金持有的权证投资如下：

	权证代码	权证名称	权证数量（份）	权证成本（人民币元）
被动持有	580009	伊利 CWB1	696,489	0.00
	580011	中化 CWB1	213,450	0.00
	合计		909,939	0.00
主动投资	-	-	-	-
	合计		-	-

备注：本基金持有的权证全部为被动持有，未发生主动投资情况

九、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
2006/01/01-2006/12/31	173.01%	0.0127	93.74%	0.0112	79.27%	0.0015

十、基金的财产

(一) 基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

(二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三) 基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

(四) 基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十一、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。

(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) 送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

2) 首次发行的股票，按成本价估值；

(3) 配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值；若收盘价等于或低于配股价，则估值为零；

(4) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1) - (3)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) - (3)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；

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2. 债券估值办法：

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价

中所含的债券应收利息(自债券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,按最近交易日债券收盘净价估值;

(3) 未上市债券按其成本价估值;

(4) 在银行间债券市场交易的债券按其成本价估值;

(5) 在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1) - (4)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) - (4)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;

(6) 国家有最新规定的,按其规定进行估值。

根据有关法律法规,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、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. 基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人每工作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。

(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。

差错处理的原则和方法如下:

(1) 基金份额净值出现错误时,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 0.5% 时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；

(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所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. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；

4. 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；

5. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七) 基金净值的确认

基金管理人应每日对基金资产估值。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工作日交易结束后计算当日的基金资产净值并以加密传真等方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后以双方确认的方式传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

(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(4)项或债券估值方法的第(5)项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

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，本基金管理人和本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，本基金管理人和本基金托管人可以免除赔偿责任。但本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。

十二、基金的收益与分配

(一) 基金收益的构成

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。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

(二) 基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

(三) 收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
2. 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
3. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。
4. 本基金收益每年最多分配4次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的60%；
5. 本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；

6. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

(四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应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、支付方式等内容。

(五) 收益分配的时间和程序

1. 基金收益分配方案由基金管理人拟订, 由基金托管人复核, 在报中国证监会备案后 5 个工作日内公告;

2. 在分配方案公布后 (依据具体方案的规定), 基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令, 基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

十三、基金的费用与税收

(一) 与基金运作有关的费用

1、费用的种类

- 1) 基金管理人的管理费;
- 2) 基金托管人的托管费;
- 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和律师费;
- 7) 基金的证券交易费用;
- 8) 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

2、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。

3、基金运作费用计提方法、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的年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$, 本基金年管理费率为 1.5%

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。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：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}, \text{本基金年托管费率为} \underline{0.25\%}$$

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，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 1、中 3) 到 8) 项费用由基金托管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。

4、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。

5、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

6、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

(二) 与基金销售有关的费用

与基金销售有关的费用主要包括基金的申购费、赎回费、转换费等，上述费用具体的费率、计算公式、收取使用方式等内容请参见本招募说明书“第七节基金份额的申购、赎回与转换”。

十四、基金的会计与审计

(一) 基金的会计政策

1. 基金管理人为本基金的会计责任方；
2. 本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日，如果基金首次募集的会计年度，基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
3. 本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
4. 会计制度执行国家有关的会计制度；
5. 本基金独立建账、独立核算；
6. 基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
7. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

(二) 基金的审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。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，应事先征得基金管理人和基金托管人同意，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，并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2日内公告。

十五、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人应按规定将基金信息披露事项在规定时间内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。公开披露的基金信息包括：

(一) 招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的15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。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每6个月的最后1日。

（二）基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

（三）基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，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。

（四）基金合同生效公告

基金管理人将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。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

（五）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易3个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

（六）基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1. 本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

2. 基金管理人将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；

3. 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。

（七）基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在

基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

(八) 基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1. 基金管理人应当在每年结束之日起 90 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。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2. 基金管理人应当在上半年结束之日起 60 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. 基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 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。

(九) 临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下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事件时，有关信息披露义务人应当在 2 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：

1. 基金份额持有人大会的召开；
2. 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 50%；
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 30%；
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 0.5%;
18. 基金改聘会计师事务所;
19. 变更基金份额发售机构;
20. 基金更换注册登记机构;
21. 本基金开始办理申购、赎回;
22. 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
23. 本基金发生巨额赎回并延期支付;
24. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
25. 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
26. 中国证监会规定的其他事项。

(十) 澄清公告

在本基金合同存续期限内,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。

(十一) 基金份额持有人大会决议

(十二) 中国证监会规定的其他信息

(十三) 信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后,将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、有关销售机构及其网点,供公众查阅。投资人在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在至少一种指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

十六、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、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。

十七、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，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- (3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- (4) 基金合并、撤销；
- (5) 中国证监会允许的其他情况。

（二）基金财产的清算

1. 基金财产清算小组

(1) 基金合同终止时，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金清算小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、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2. 基金财产清算程序

基金合同终止后，发布基金清算公告；

- (1) 基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- (2) 对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估价和变现；
- (4) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (7) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (8) 公布基金清算公告；
- (9) 对基金剩余财产进行分配。

3. 清算费用

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算小组优先从基金财产中支付。

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。

基金财产未按前款 (1) - (3) 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

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果由基金财产清算小组经中国证监会备案后 3 个工作日内公告。

6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

十八、基金合同的内容摘要

本上投摩根阿尔法股票型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：

1. 基金份额持有人的权利

- 1) 分享基金财产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- 3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法

权益的行为依法提起诉讼；

- 9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

2. 基金份额持有人的义务

- 1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- 2) 交纳基金认购、申购款项及规定的费用；
- 3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及基金份额持有人合法权益的活动；
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 6) 返还在基金交易过程中因各种原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- 7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

3. 基金管理人的权利

- 1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定，独立运用基金财产；
- 2) 获得基金管理人报酬；
- 3) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 4) 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- 5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- 6) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- 7) 选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- 8) 选择、更换销售代理机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

- 9) 在基金托管人更换时, 提名新的基金托管人;
- 10) 依法召集基金份额持有人大会;
- 11) 法律法规规定的其他权利。

4. 基金管理人的义务

- 1) 依法募集基金, 办理或者委托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) 自基金合同生效之日起, 以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
- 4) 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财产;
- 5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立, 对所管理的不同基金分别管理, 分别记账, 进行证券投资;
- 6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人运作基金财产;
- 7) 依法接受基金托管人的监督;
- 8) 计算并公告基金资产净值, 确定基金份额申购、赎回价格;
- 9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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;
- 10) 按规定受理申购和赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;
- 11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
- 12) 编制中期和年度基金报告;
- 13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定, 履行信息披露及报告义务;
- 14) 保守基金商业秘密, 不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前应予保密, 不得向他人泄露;
- 15) 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;
- 16) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合

基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

- 17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 18) 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；
- 19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 22) 法律法规规定的其他义务。

5. 基金托管人的权利

- 1) 获得基金托管费；
- 2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- 3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
- 4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- 5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- 6) 依法召集基金份额持有人大会；
- 7) 法律法规规定的其他权利。

6. 基金托管人的义务

- 1) 安全保管基金财产；
- 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，负责基金财产托管事宜；
- 3) 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；
- 4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人

谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

- 5) 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及有关凭证；
- 6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- 7) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- 8) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 10) 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；
- 11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- 13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- 14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- 16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- 17) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- 19) 法律法规规定的其他义务。

（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

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上(含 10%，下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- (5) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 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；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2. 基金份额持有人大会的召集方式

1) 除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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 10 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 60 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 10%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 10 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 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%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 10 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 60 日内召开。

4) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项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 10%以上的

基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

(2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 天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。

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一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) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50% 以上通过方为有效，除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

(B) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二

以上通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、提前终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

- 3) 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。
- 4) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
- 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。

（三）基金合同解除和终止的事由

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- (3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- (4) 基金合并、撤销；
- (5) 中国证监会允许的其他情况。

（四）争议解决方式和适用法律

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，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，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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和

注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

十九、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：中国建设银行股份有限公司

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：100032

法定代表人：郭树清

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：壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍万元人民币

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具有重大违规行为，应及时报告中国证监会，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 对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 对基金托管人是否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, 应及时报告中国证监会, 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托管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、阻挠对方根据本托管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. 除证券交易清算资金外, 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账户的, 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. 基金托管人应当设有专门的基金托管部门, 取得基金从业资格的专职人员达到法定人数, 有安全保管基金财产的条件, 有安全高效的清算、交割系统, 有符合要求的营业场所、安全防范设施和与基金托管业务有关的其他设施, 有完善的内部稽核监控制度和风险控制制度。

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。

（四）基金收益与基金资产净值的计算与复核

1. 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，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. 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，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。

3. 基金份额净值错误的处理方式

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。

差错处理的原则和方法如下：

（1）基金份额净值出现错误时，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 0.5% 时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；

（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，按本托管协议第十九条规定处理。

（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。

（五）基金份额持有人名册的登记与保管

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、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权利登记日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册，由注册登记机构编制。

基金管理人对其对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）争议解决方式和适用法律

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，仲裁地点为北京市，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。

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. 本基金合同终止；
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、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

在未来市场和技术条件成熟时，基金管理人将为基金投资者提供基金电子交易服务。

（四）联系方式

上投摩根基金管理有限公司

咨询电话：021 3879 4888

网址: www.51fund.com

二十一、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、基金托管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。

二十二、备查文件

- (一) 中国证监会批准上投摩根阿尔法股票型证券投资基金募集的文件
- (二) 上投摩根阿尔法股票型证券投资基金基金合同
- (三) 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、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。