

---

# 上投摩根行业轮动股票型证券投资基金 招募说明书（更新）

核准文号：中国证监会证监许可[2009]1382号文

核准日期：[2009年12月15日]

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

## 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7月28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。
7. 基金托管人于2013年8月25日对本招募说明书相关内容进行了复核。

二零一三年九月

---

## 上投摩根行业轮动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.....	19
六、基金的募集及基金合同的生效.....	33
七、基金份额的申购、赎回和转换.....	34
八、基金的投资.....	40
九、基金的业绩.....	53
十、基金的财产.....	53
十一、基金资产的估值.....	54
十二、基金的收益与分配.....	58
十三、基金的费用与税收.....	60
十四、基金的会计与审计.....	61
十五、基金的信息披露.....	62
十六、风险揭示.....	65
十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	67
十八、基金合同的内容摘要.....	70
十九、基金托管协议的内容摘要.....	78
二十、对基金份额持有人的服务.....	82
二十一、招募说明书的存放及查阅方式.....	83
二十二、其它应披露事项.....	83
二十三、备查文件.....	83

---

## 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《上投摩根行业轮动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行业轮动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，投资人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

在本基金招募说明书中，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：指上投摩根行业轮动股票型证券投资基金
- 2.基金管理人：指上投摩根基金管理有限公司
- 3.基金托管人：指招商银行股份有限公司
- 4.基金合同：指《上投摩根行业轮动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：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《上投摩根行业轮动股票型证

---

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.招募说明书或本招募说明书：指《上投摩根行业轮动股票型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7.基金份额发售公告：指《上投摩根行业轮动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、规范性文件、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做出的修订

10.《销售办法》：指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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》及颁布机关对其不时做出的修订

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》及颁布机关对其不时做出的修订

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，以及依据有关法律法规规定或中国证监会批准可投资于证券投资基金的其他自然人

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：指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

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以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

20.基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

- 
- 21.基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、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他条件，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本基金的基金份额变动及结余情况的账户
- 30.基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
- 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，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
- 32.基金募集期：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：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日
- 36.T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)
- 37.开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
- 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证券投资基金注册登记业务规则》，是规范基金管理人所管理的证券投资基金登记结算方面的业务规则，由基金管理人和投资人

---

共同遵守

40.认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

41.申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

42.赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

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公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

44.转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

45.定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

46.巨额赎回：指本基金单个开放日，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)超过上一开放日基金总份额的 10%

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：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

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、恐怖袭击、传染病传播、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、公众通讯设备或互联网络故障。

### 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：

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：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%
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。

2009 年 3 月 31 日，基金管理人的注册资本金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：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：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：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。

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。

## 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。

上海财经大学工商管理硕士，曾任职于上海证券（原上海财政证券），先后担任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。

北京大学管理科学硕士。曾任职于长城证券、华安基金和华泰联合证券（原联合证券），从事投资银行、投资顾问和投资管理等相关工作；2004年至2010年，任职于华宝兴业基金，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

冯刚先生，北京大学管理科学硕士。2000年至2004年，先后任职于长城证券、华安基金和华泰联合证券（原联合证券），从事投资银行、投资顾问和投资管理等相关工作；2004年至2010年，任职于华宝兴业基金，先后任基金经理、国内投资部总经理；2006年6月至2010年7月，任华宝兴业收益增长股票型证券投资基金基金经理；2008年10月至2010年7月，同时担任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理，2010年8月起加入上投摩根基金管理有限公司，任副总经理兼A股投资总监。2011年12月起同时担任上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金经理及上投摩根行业轮动股票型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理为许运凯先生，任职时间为自本基金合同生效日起至2011年12月7日。

#### 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。

### （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利益；
- (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不断完善内部合规控制。

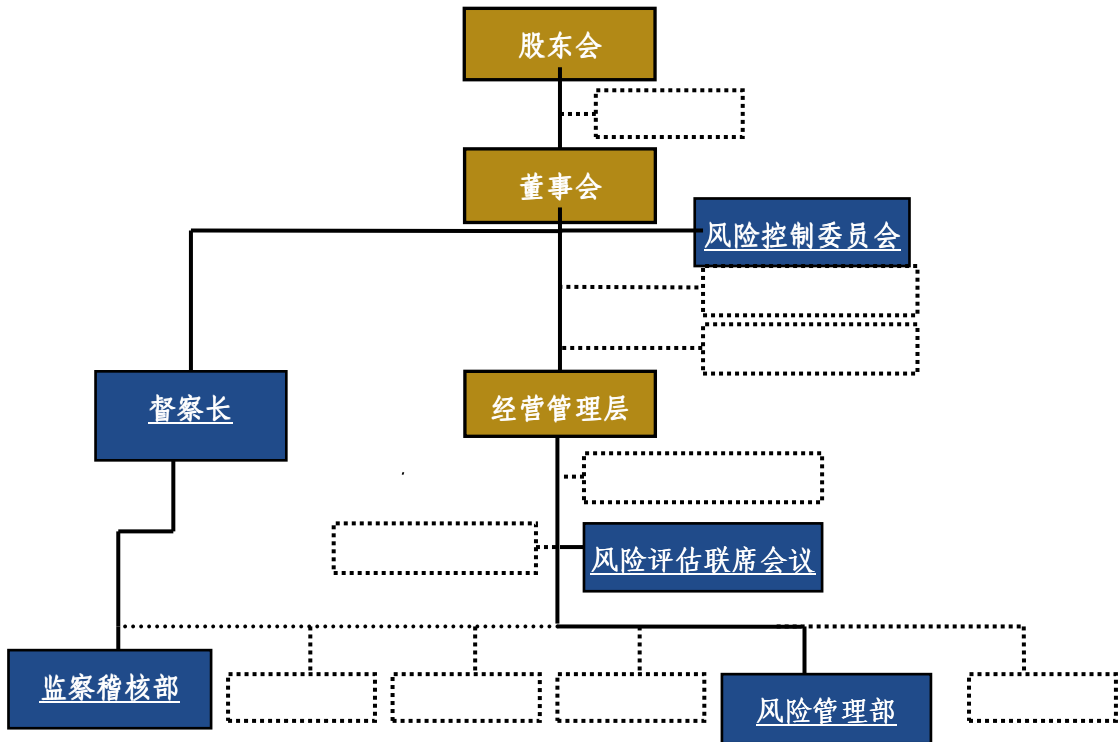
4、风险管理体系：

- (1) 董事会下设风险控制委员会，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控制评估。

(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控管，并提出内控建议。



#### 四、基金托管人

##### (一) 基金托管人概况

###### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：215.77亿元

---

法定代表人：傅育宁

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

## 2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截止2012年9月30日，招商银行总资产3.1446万亿元人民币，核心资本充足率8.47%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务支持室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室4个职能处室，现有员工52人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

经过十年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2012年招商银行加大高收益托管产品营销力度，新增托管公募开放式基金13只，新增首发公募开放式基金托管规模433亿元。克服国内证券市场震荡下行的不利形势，托管费收入、托管资产均创出历史新高，实现托管费收入6.54亿元，较上年增长28.17%，托管资产余额1.08万亿元，较年初增长112.85%。



---

作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人，成功签约“壹基金”公益资金托管，为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索，该项目荣获 2012 中国金融品牌「金象奖」“十大公益项目”奖；三度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。

## （二）主要人员情况

傅育宁先生，招商银行董事长和非执行董事，英国布鲁诺尔大学博士学位。1999 年 3 月开始担任本公司董事。2010 年 8 月起任招商局集团有限公司董事长。兼任招商局国际有限公司（香港联合交易所上市公司）主席，利和经销集团有限公司（香港联合交易所上市公司）及信和置业有限公司（香港联合交易所上市公司）独立非执行董事，香港港口发展局董事，香港证券及期货事务监察委员会成员等；中国南山开发（集团）股份有限公司董事长，招商局能源运输股份有限公司（上海证券交易所上市公司）董事长，及中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司（深圳证券交易所上市公司）董事长，及新加坡上市公司嘉德置地有限公司独立非执行董事。

田惠宇先生，本行主要负责人，执行董事，2013 年 5 月起担任本行主要负责人、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

唐志宏先生，招商银行副行长，吉林大学本科毕业，高级经济师。1995 年 5 月加入本公司，历任沈阳分行副行长，深圳管理部副主任，兰州分行行长，上海分行行长，深圳管理部主任，总行行长助理，2006 年 4 月起担任本公司副行长。同时担任招商信诺人寿保险公司及中国银联股份有限公司董事。

吴晓辉先生，招商银行资产托管部总经理，硕士研究生，高级经济师。1993 年 10 月进入招商银行工作；历任招商银行总行计划资金部副总经理，总行资金交易部总经理，招银国际金融有限公司总裁；招商银行济南分行党委书记、行长，2011 年 7 月起担任招商银行总行资产托管部总经理。

## （三）基金托管业务经营情况

截至 2013 年 7 月 31 日，招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金（含招商安泰股票型投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金和招商安泰债券投资基金），招商现金增值证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、华夏货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利

---

债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票型证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)、中银价值精选灵活配置混合型基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、诺安保本混合型证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、博时裕祥分级债券型证券投资基金、上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金 (QDII-LOF)、中银中小盘成长股票型证券投资基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金 (LOF)、易方达纯债债券型证券投资基金、中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF)、中银保本混合型证券投资基金、嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信 14 天理财债券型发起式证券投资基金、鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中银纯债债券型证券投资基金、南方安心保本混合型证券投资基金、中银理财 7 天债券型证券投资基金、中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、中银理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、中银稳健添利债券型发起式证券投资基金、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金、中银消费主题股票型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金共 66 只开放式基金及其它托管资产，托管资产为 15481.20 亿元人民币。

#### (四) 托管人的内部控制制度

##### 1、 内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运

---

作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

## 2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行行长层面对风险进行预防和控制。招商银行实行董事会领导下的行长负责制，重大事项的决策经行长办公会讨论决定，行长室下设合规管理委员会、风险控制委员会、审计管理委员会、信息规划委员会、服务监督管理委员会等机构。

二级风险防范是总行资产托管部在业务室、专业岗位设置时，必须遵循内控制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

总行资产托管部内设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督。

三级风险防范是各业务室对自身业务风险进行自我防范和控制。业务室根据法律法规、监管规定、业务规则及本部门具体情况制定工作流程及风险控制措施。

## 3、内部控制原则

(1) 全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全部人员参与。

(2) 审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险，托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点，应当体现“内控优先”的要求。

(3) 独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门，稽核监察室应保持高度的独立性和权威性，负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

(4) 有效性原则。内部控制应当符合国家法律法规和监管机关的规章，具有高度的权威性，成为所有员工严格遵守的行动指南；执行内部控制制度不能存在任何例外，部门任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力。

(5) 适时性原则。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。

(6) 防火墙原则。核算、清算、稽核监察等相关部门，应当在制度上和人员上适当分离，办公网和业务网分离，部门业务网和全行业务网分离，以达到风险防范的目的。

(七) 重要性原则。内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。

(八) 制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等

---

方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

(九) 成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

#### 4、内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行托管业务内控管理办法》、《招商银行基金托管业务操作规程》和等一系列规章制度，从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作，切实维护托管业务各当事人的利益，避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理，招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》，并建立了灾难备份中心，各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份，确保灾难发生时，托管业务能迅速恢复和不间断运行。

(2) 经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险

(3) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部通过数据加密传输、业务信息启动异地自动备份功能、业务信息磁带备份并由专人签收保存等措施保证业务信息及数据传递的安全性。业务信息不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室审批，并做好调用登记。

(4) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务运作过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行资产托管部对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房空间隔离并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护等，保证信息技术系统的安全。

(6) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源控制。

#### (五) 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

根据《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》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、

---

基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，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。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，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。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据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，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

## 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) 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](http://www.cmbchina.com)

(2) 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

(3) 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](http://www.icbc.com.cn)

(4) 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](http://www.abchina.com)

(5) 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](http://www.boc.cn)

(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

客户服务热线：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://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](http://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](http://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](http://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](http://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.nbc.com.cn](http://www.nbc.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](http://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](http://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: 广东省广州天河区大都会广场 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](http://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](http://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](http://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

公司网站：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：深圳市招商银行大厦 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](http://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](http://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](http://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

公司网站：[www.cf-clsa.com](http://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](http://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](http://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](http://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](http://www.zlfund.cn) [www.jjmmw.com](http://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](http://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](http://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](http://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](http://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](http://licaike.hexun.com)

(57) 星展银行（中国）有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号 1301、1801 单元

法定代表人：葛甘牛

咨询电话：400-820-8988

网站：[www.dbs.com.cn](http://www.dbs.com.cn)

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: 国浩律师集团(上海)事务所

注册地址: 上海市南京西路 580 号南证大厦 31 楼

负责人: 管建军

联系电话: 021-5234 1668

传真: 021-5234 1670

经办律师: 宣伟华

(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

## 六、基金的募集及基金合同的生效

本基金根据中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于核准上投摩根行业轮动股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2009]1382号文),自2010年1月6日起向全社会公开募集,截至2010年1月22日募集工作顺利结束。

经普华永道中天会计师事务所有限公司验资,本次募集的有效净认购金额为3,617,107,465.38元人民币,折合基金份额3,617,107,465.38份;认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计311,806.20元人民币,折合基金份额311,806.20份。

经中国证券监督管理委员会核准,本基金的基金合同于2010年1月28日生效。本基金为契约型开放式股票型基金,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销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### (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，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明。

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，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### 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3个月开始办理申购，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3个月开始办理赎回，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时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

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、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### (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，在开放日的具体业务办理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。

## 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受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金注册登记机构在 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，投资人应在 T+2 日后(包括该日)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。基金销售机构对申购申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购的确认以注册登记机构的确认结果为准。

## 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 100 份，基金账户余额不得低于 100 份，如进行一次赎回后基金账户中基金份额余额将低于 100 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 100 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依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告并报中国证监会备案。

## (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

申购费用 = (申购金额 × 申购费率) / (1 + 申购费率)

净申购金额 = 申购金额-申购费用

申购份额 = 净申购金额/ 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
人民币 100 万以下	1.5%
人民币 100 万以上（含），500 万以下	1.0%
人民币 500 万以上（含）	每笔人民币 1,000 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，

赎回总额 = 赎回份数 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 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	0.25%
大于等于二年	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 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

7. 本基金的申购费用由投资人承担，并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，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

9. 本基金的申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%。本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。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，并最迟应于新的费率或收费方式实施日 3 个工作日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

10. 基金管理人可以在不违反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，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

#### (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者的申购申请：

- 1.因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 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.基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 5.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。
6. 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔或数笔申购。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停申购时，申购款项将全额退还投资者。发生上述 1 到 5 项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。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并予以公告。

#### (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者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1.因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 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.连续两个或两个以上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报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将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，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。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并予以公告。

#### (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)超过前一开放日的基金总份额的 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延期赎回。

(1)全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2)部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因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开放日基金总份额的 10%的前提下，可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；对于未能赎回部分，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，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。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)暂停赎回：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 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。



---

### 3.巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

#### (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，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2.如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在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日在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日在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、且由同一注册登记机构办理注册登记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，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### (十一)基金的非交易过户

基金的非交易过户是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以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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按基金注册登记机构的规定办理，受理非交易过户申请的销售机构可按规定标准收取过户费用。

---

#### (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标准收取转托管费。

#### (十三)定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### (十四)基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或是基金份额被冻结的，对冻结部分产生的权益一并冻结。

## 八、基金的投资

### (一)投资目标

本基金通过把握资产轮动、产业策略与经济周期相联系的规律，挖掘经济周期波动中强势行业中具有核心竞争优势的上市公司，力求在景气的多空变化中追求基金资产长期稳健的超额收益。

### (二)投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的 A 股、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金投资组合的资产配置范围为：股票资产占基金资产的 60%—95%；债券、权证、现金、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%；其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。本基金将不低于 80%的股票资产投资于强势行业中具有核心竞争优势的上市公司股票。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

---

如果法律法规对上述比例要求有变更的，在经中国证监会批准后，本基金投资范围将及时做出相应调整，以调整变更后的比例为准。

### （三）投资理念

在经济发展周期的不同阶段，不同的产业面临不同的发展机遇和挑战，在股票市场中表现为行业投资收益的中长期轮动，处于各行业的不同企业也面临不同的投资机会。本基金通过挖掘经济周期波动中强势行业中具有核心竞争优势的上市公司，力求获得稳健的投资回报。

### （四）投资策略

国际经验表明，受宏观经济周期波动的影响，产业发展存在周期轮动的现象。某些行业能够在经济周期的特定阶段获得更好的表现，从而形成阶段性的强势行业。在股票市场中表现为行业投资收益的中长期轮动，处于各行业的不同企业也面临不同的投资机会。本基金通过把握经济周期变化，依据对宏观经济、产业政策、行业景气度及市场波动等因素的综合判断，采取自上而下的资产配置策略、行业配置策略与自下而上的个股选择策略相结合，精选强势行业中具有核心竞争优势的个股，力求无论在多空市场环境下均能获取稳健的超额回报。

#### 1、资产配置策略

本基金对大类资产的配置是从宏观层面出发，采用定量分析和定性分析相结合的手段，综合宏观经济环境、政策形势、行业景气度和证券市场走势的综合分析，积极进行大类资产配置。影响资产收益最为关键的两大驱动因素包括基本面和流动性。基本面驱动，主要指在经济周期和通胀周期影响下，业绩增长、利率环境、通胀预期等因素的变动；流动性驱动，主要体现为货币市场环境变动的的影响，具体包括汇率变动、流动性结构变动等。随着各类资产风险收益特征的相对变化，本基金适时动态地调整股票、债券和货币市场工具的投资比例。

---

## 2、行业配置策略

本基金运用“投资时钟理论”，对行业的配置以宏观经济周期分析为基础，挖掘每一经济周期阶段下处于景气复苏以及景气上升阶段的行业，考察经济周期中行业轮动与市场波动的规律，把握行业间的相对强弱关系与强势行业的持续周期，增加预期收益率较高的行业配置，减少或者不配置预期收益率较低的行业。

### 1) 投资时钟理论

经典的投资时钟理论是一种将资产轮动和产业策略与经济周期联系起来的方法。根据产出缺口和通胀率的不同变化，将经济周期划分为衰退、复苏、过热和滞胀四个阶段。不同行业对宏观经济波动的敏感度差异演绎了经济周期下的产业轮动。投资时钟理论为行业配置提供了非常实用的指导性方法，在经济衰退期，注重防守型的成长投资；经济复苏时，注重周期型的成长投资；经济过热期，注重周期型的价值投资；经济滞胀期，注重防守型的价值投资。

### 2) 行业分类

本基金采用天相行业分类标准。本基金根据经济发展和市场的变化，在经基金管理人投资决策委员会批准后，可以变更行业分类标准。

### 3) 行业投资价值评估体系

根据投资时钟的理论基础，本基金管理人建立了“行业投资价值评估体系”，以考量在不同的经济周期中行业的相对表现。“行业投资价值评估体系”主要从行业景气度和估值两个角度分析行业的投资价值：

#### A. 行业景气判断

影响行业景气的长期因素有经济周期、行业的生命周期、产业结构升级、消费结构升级等，短期因素有通胀、汇率等。除了这些因素外，本基金对行业景气的判断还依据一些定量指标，包括先行指标——投资增速情况与滞后指标——行业利润增长趋势情况。如果投资增速开始下降，而行业利润增速保持较快增长，说明行业景气顶峰即将到来；如果投资增速开始下降，而行业利润增速也下降，表明行业景气处于下行周期；如果投资增速开始增加，而

行业利润增速下降，表明行业处于景气的谷底或者接近谷底期；如果投资增速开始增加，行业利润增速加快增长，表明行业处于行业景气的成长期（见下表）。

指标表现	投资增速下降	投资增速上升
行业利润增速下降	景气处于萧条期	景气处于谷底期
行业利润增速上升	景气处于衰退期	景气处于上升期

衡量行业利润增长趋势的指标主要包括行业近三年的主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、毛利率及净资产收益率等指标，特别关注各细分行业的关键因素的变化趋势，如吞吐量（港口行业）、开工率或者价格（石化行业）、产销率（轿车行业）、销售额/销售面积（房地产行业）、市场渗透率（电信运营业）等。

#### B. 估值水平：行业动态估值水平

以 A 股整体估值水平作为基准，结合国际估值的比较，考察各行业的估值水平。主要考察行业相对估值水平（行业估值/市场平均估值）、行业 PEG（行业估值/行业利润增长率）。

基金管理人在上述行业投资价值评估体系的基础上，结合波特五力分析方法（对行业吸引力、竞争力和企业战略分析的经典模型），每季度对全部行业的投资价值进行评级，由此决定不同行业的投资权重。如果遇到重大国家政策颁布等特殊情况，本基金管理人的宏观策略小组认为行业评级发生突然变化时，可以临时对行业的投资评级进行调整。

#### 4) 行业优化配置原则

景气度	估值水平	投资评级
景气处于上升期	估值水平低	A 级
景气处于上升期	估值水平高	B 级
景气处于谷底期	估值水平低	C 级
景气处于谷底期	估值水平高	D 级
景气处于衰退期	估值水平高或低	E 级

景气处于萧条期	估值水平高或低	F 级
---------	---------	-----

对于行业景气处于上升期且估值水平低的行业，其投资评级为 A，是本基金重点超配的行业，最高配置比例可达股票资产的 80%；对于行业景气度处于上升阶段，但估值水平偏高的行业，其投资评级为 B，最高配置比例可达股票资产的 60%；对于行业景气处于谷底期且估值水平较低的 C 评级行业，是本基金重点关注的行业，最高配置比例可达股票资产的 50%；对于景气度处于谷底期但估值水平高的 D 评级行业，本基金进行低配或者不予配置；对于景气度处于衰退期和萧条期的 E 评级行业和 F 评级行业，原则上不予配置。

本基金还将同时把握由于国家政策、产业政策、行业整合、市场需求、技术进步等因素带来的行业性投资机会。

### 3、个股选择

本基金重点投资于强势行业中获益程度最高且具有核心竞争优势的上市公司。主要评价标准包括：

1) 公司主营业务突出且具有核心竞争优势。公司在行业或者细分行业处于垄断地位或者具有独特的竞争优势，如具有垄断的资源优势、领先的经营模式、稳定良好的销售网络、著名的市场品牌或创新产品等。

2) 公司具有持续的成长能力和成长潜力。除了考察公司过去 2-3 年的主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、净资产收益率等衡量公司成长性和盈利质量的量化指标外，更注重对公司未来成长潜力的挖掘，从公司的商业盈利模式的角度深入分析其获得业绩增长的内在驱动因素，并分析这些业绩驱动因素是否具有可持续性。

3) 公司具有估值优势。针对不同行业特点采用相应的估值方法，参考国际估值水平，将公司的估值水平与整个行业的估值水平及市场整体估值水平进行比较，选择具有动态估值优势的公司。

4) 具有良好的公司治理结构。分析上市公司的治理结构、管理层素质及其经营决策能力、投资效率等方面，判断公司是否具备保持长期竞争优势的能力。

---

#### 4、固定收益类投资策略

对于固定收益类资产的选择，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管理，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。

在券种选择上，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，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。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，并利用这些模型进行估值，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。

(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。

(4) 流动性管理：本基金通过紧密关注申购/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。

#### 5、可转换债券投资策略

可转换债券（含交易分离可转债）兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。可转债的选择结合其债性和股性特征，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资于公司基本面优良、具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券，获取稳健的投资回报。

#### 6、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险

---

控制。本基金在投资权证时，将通过对权证标的证券基本面的深入研究，结合权证定价模型及其隐含波动率等指标，寻求其合理的估值水平，谨慎投资，以追求较稳定的当期收益。

(五) 业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

(六) 风险收益特征

本基金是主动管理的股票型证券投资基金，属于证券投资基金的较高风险品种，预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

(七) 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) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (6) 股票资产占基金资产的 60%—95%；债券、权证、现金、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%；
- (7) 本基金将不低于 80% 的股票资产投资于强势行业中具有核心竞争优势的上市公司股票；
- (8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超



---

过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(12)本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(13)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；

(14)本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(15)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；

(16)如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

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规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。在上述特殊情况下，基金管理人应根据中国证监会及相关法律法规的规定进行调整。

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。除投资资产配置比例外，基金托管人对基金的投资比例的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## 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，由中国证监会规定禁止的其他活动；

(9)法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

(八) 基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

1.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及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2.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；

3.有利于基金财产的安全与增值；

4.不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

(九)基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

(十) 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	2,395,838,036.69	90.33
	其中：股票	2,395,838,036.69	90.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	129,463,900.00	4.88
	其中：债券	129,463,900.00	4.88
	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	111,340,254.49	4.20
7	其他各项资产	15,662,939.53	0.59
8	合计	2,652,305,130.71	100.00

注：截至2013年6月30日，上投摩根行业轮动股票型证券投资基金资产净值为2,617,176,252.14元，基金份额净值为1.038元，累计基金份额净值为1.038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	8,782,782.75	0.34
B	采矿业	55,479,092.46	2.12
C	制造业	1,433,473,123.20	54.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,331,519.64	0.78
E	建筑业	43,868,058.95	1.68
F	批发和零售业	28,231,930.65	1.08
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	263,224,406.89	10.06
J	金融业	119,009,025.53	4.55
K	房地产业	164,766,455.55	6.30
L	租赁和商务服务业	12,134,908.50	0.46
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	91,889,923.74	3.51
O	居民服务、修理和其他服	-	-

	务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	46,939,516.40	1.79
R	文化、体育和娱乐业	107,707,292.43	4.12
S	综合	-	-
	合计	2,395,838,036.69	91.54

3. 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投资明细

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	600406	国电南瑞	12,222,866	182,487,389.38	6.97
2	600527	江南高纤	21,850,068	122,141,880.12	4.67
3	600518	康美药业	6,055,147	116,440,476.81	4.45
4	002038	双鹭药业	1,910,560	111,958,816.00	4.28
5	000661	长春高新	921,054	90,180,397.14	3.45
6	300014	亿纬锂能	3,353,149	79,134,316.40	3.02
7	300027	华谊兄弟	2,433,861	69,486,731.55	2.66
8	300070	碧水源	1,740,886	65,596,584.48	2.51
9	002353	杰瑞股份	950,188	65,562,972.00	2.51
10	000800	一汽轿车	4,724,469	58,110,968.70	2.22

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	10,089,900.00	0.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,374,000.00	4.56

	其中：政策性金融债	119,374,000.00	4.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	129,463,900.00	4.95

5. 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120245	12国开45	800,000	79,576,000.00	3.04
2	120318	12进出18	200,000	19,912,000.00	0.76
3	130218	13国开18	200,000	19,886,000.00	0.76
4	010308	03国债(8)	101,000	10,089,900.00	0.39

6. 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

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) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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没有超出基金合同规定的备选股票库。

3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,410,679.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	86,593.07
4	应收利息	2,427,431.70
5	应收申购款	11,738,235.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,662,939.53

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	300027	华谊兄弟	69,486,731.55	2.66	筹划重大资产重组事项

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。

## 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	份额净值 增长率①	份额净值 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
2010/01/28-2010/12/31	1.60%	1.15%	-1.15%	1.27%	2.75%	-0.12%
2011/01/01-2011/12/31	-24.51%	1.10%	-19.20%	1.04%	-5.31%	0.06%
2012/01/01-2012/12/31	13.69%	1.14%	6.71%	1.02%	6.98%	0.12%
2013/01/01-2013/06/30	19.04%	1.42%	-9.88%	1.20%	28.92%	0.22%

## 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。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，

---

不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。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以及国家法律法规规定和行业通行做法需要对外披露基金净值的非营业日。

### (二)估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所上市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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市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付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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上



---

市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、如有确凿证据表明按上述方法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与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。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，按照基金管理人对于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、权证、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工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个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.基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个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。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### (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3位以内(含第3位)发生差错时,视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理:

##### 1.差错类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿,承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等;对于因技术原因引起的差错,若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服,则属不可抗力,按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错,因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任,但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

##### 2.差错处理原则

(1)差错已发生,但尚未给当事人造成损失时,差错责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正差错发生的费用由差错责任方承担;由于差错责任方未及时更正已产生的差错,给当事人造成损失的,由差错责任方对直接损失承担赔偿责任;若差错责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保差错已得到更正。

(2)差错的责任方对有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对差错的有关直接当事人负责,不对第三方负责。

(3)因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”),则差错责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已

---

经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4)差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5)差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6)如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

(7)按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3.差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1)查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2)根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3)根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4)根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4.基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1)基金份额净值计算出现错误时，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 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；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。

(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市场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；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；

4.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

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开放日交易结束后计算当日或国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### (八)特殊情况的处理

1.基金管理人或基金托管人按估值方法的第5项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

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，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和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，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但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

基金收益指基金利润，包括基金投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息和其他收入扣除相关费用后的余额。

### (二) 基金期末可供分配利润

基金期末可供分配利润指截止收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低者。

---

### (三) 收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 本基金的每一基金份额享有同等收益分配权；
2. 本基金收益每年最多分配四次，每次基金收益分配比例不低于可供分配利润的40%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；
3. 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
4. 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
5. 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。
6. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。
7. 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除息日的基金份额净值自动转为基金份额。

法律、法规或监管机构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整。

### (四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、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，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；
2. 在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定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)基金费用的种类

- 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.基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5.基金份额持有人大会费用；
- 6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7.基金的证券交易费用；

8.在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

- 9.依法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参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 1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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。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 0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，

---

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.除管理费和托管费之外的基金费用,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。

#### (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。基金合同生效前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。

(五)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。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

#### (六)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。

## 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;
- 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同意。
- 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。就更换会计师事务所,基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## 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、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的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(以下简称“指定报刊”)和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

- 1.虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;
- 2.对证券投资业绩进行预测;
- 3.违规承诺收益或者承担损失;
- 4.诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构;
- 5.登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;
- 6.中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的,以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

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.在开始办理基金份额申购或者赎回后，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。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

#### (六)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。

#### (七)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；

4.基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

5.基金定期报告应当按有关规定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。

#### (八)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及决议；
- 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.基金变更、增加或减少代销机构；
  - 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.中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

#### (九)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)基金份额持有人大会决议

#### (十一)中国证监会规定的其他信息

#### (十二)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,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

基金主要投资于证券市场,而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动,从而导致基金收益水平发生变化,产生风险。主要的风险因素包括:

---

1. 政策风险。因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

2. 经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

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。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

4. 上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

5. 购买力风险。基金份额持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

## **2、管理风险**

1. 在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、行业发展前景及证券市场价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

2. 基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

## **3、流动性风险**

基金的流动性风险主要表现在两方面：一是基金管理人建仓时或为实现投资收益而进行组合调整时，可能会由于个股的市场流动性相对不足而无法按预期的价格将股票或债券买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，当个股的流动性较差时，基金管理人被迫在不适当的价格大量抛售股票或债券。两者均可能使基金净值受到不利影响。对本基金而言，本基金主要投资中小盘股票，相对大盘股票而言，中小盘股票的流动性相对较低，可能增加投资的交易成本。

## **4、特定风险**

在经济发展周期的不同阶段，某些行业能够在经济周期的特定阶段获得更好的表现，从而形成阶段性的强势行业。本基金将通过把握经济周期变化，依据对宏观经济、产业政策、行业景气度及市场波动等因素的综合判断，采取自上而下的资产配置策略、行业配置策略与自下而上的个股选择策略相结合，精选强势行业中具有核心竞争优势的个股。

由于行业景气度受多种因素影响，如经济周期、行业竞争、市场前景、技术变迁、行业政策等，都会导致行业的盈利能力发生变化。虽然基金可通过事前风险评估和事后风险控制降低对行业景气的误判风险，但不能完全规避。因此，可能存在对行业景气的预期发生偏差从而给基金投资的行业选择带来风险。

风险防范措施：基金管理人将发挥专业研究的优势，加强宏观经济和产业研究与预测能

---

力，正确分析和判断行业景气度发展趋势，平衡调整行业资产配置比例，将这一风险最小化。

### **5、操作或技术风险**

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

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基金份额持有人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、代销机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

### **6、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。

### **7、其他风险**

1. 因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
2. 因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
3. 因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；
4. 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
5. 因战争、自然灾害等不可抗力导致的基金管理人、基金代销机构等机构无法正常工作，从而影响基金的申购、赎回按正常时限完成的风险。

## **(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、基金合同的变更、终止与基金财产的清算**

### **(一) 基金合同的变更**

1. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持

---

有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

- (1)转换基金运作方式；
- (2)变更基金类别；
- (3)变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (4)变更基金份额持有人大会程序；
- (5)更换基金管理人、基金托管人；
- (6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

- (7)本基金与其他基金的合并；
- (8)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- (9)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

- (1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2)法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、收费方式或调低赎回费率；
- (4)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (5)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (6)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (7)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2.关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体及基金管理人网站上公告。

## (二)本基金合同的终止

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.中国证监会规定的其他情况。

---

### (三)基金财产的清算

#### 1.基金财产清算组

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

(2)基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3)基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算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，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

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

#### 3.清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算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 个工作日内由基金财产清算组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### 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

本上投摩根行业轮动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、基金份额发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、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用;
- 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其他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任何原因, 自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有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) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;
- 3) 发售基金份额;
- 4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
- 5) 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, 在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;
- 6) 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了本基金合同或有关法律法规规定的行为, 对基金财产、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;
- 7) 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;
- 8) 在法律法规允许的前提下, 为基金的利益依法为基金进行融资、融券;
- 9) 自行担任或选择、更换注册登记机构, 获取基金份额持有人名册, 并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;
- 10) 选择、更换代销机构, 并依据基金销售服务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;
- 11) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
- 12) 在基金托管人更换时, 提名新的基金托管人;
- 13) 依法召集基金份额持有人大会;
- 14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

### 4. 基金管理人的义务

- 1) 依法募集基金, 办理或者委托经中国证监会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) 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) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;
  - 23) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时, 及时报告中国证监会并通知基金托管人;
  - 24) 执行生效的基金份额持有人大会决议;

- 
- 25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;
  - 26) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利, 为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利, 不谋求对上市公司的控股和直接管理;
  - 27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### 5. 基金托管人的权利

- 1) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;
- 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;
- 6) 依法召集基金份额持有人大会;
- 7) 按规定取得基金份额持有人名册资料;
- 8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### 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) 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) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
- 21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- 23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- 24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## （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(法律法规和中国证监会另有规定的除外)；

- 
- (5) 变更基金份额持有人大会程序;
  - (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, 但法律法规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) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
  - (10) 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。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。

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。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其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。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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、持有或代表有表决权的基金份额数量、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 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，不影响在公证机关监督下形成的决议的效力。

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 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：

#### (1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)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；

#### (2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)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、终止基金合同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) 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的

---

视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5) .基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6) 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) 中国证监会规定的其他情况。

### (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。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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：招商银行股份有限公司

名称：招商银行股份有限公司(简称：招商银行)

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码：518040

法定代表人：秦晓

成立时间：1987 年 4 月 8 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2002]83 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；同业拆借；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。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 215.77 亿元

存续期间：持续经营

### （二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先向基金托管人提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。

对基金管理人发送的不符合基金合同规定的投资行为，基金托管人可以拒绝执行，并书面通知基金管理人；对于已经执行的投资，基金托管人发现该投资行为不符合基金合同的规定的，基金托管人应书面通知基金管理人进行整改，并将该情况报告中国证监会。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。



---

基金托管人应对基金的投资和融资比例是否符合基金合同的规定进行监督。基金托管人应监督基金合同约定的基金投资资产配置比例（自基金合同生效之日起满6个月后开始）、单一投资类别比例限制、融资限制、股票申购限制、基金投资比例是否符合法规及基金合同的规定，不符合规定的，基金托管人应书面通知基金管理人及时进行整改，整改的时限应符合法规及基金合同允许的投资比例调整期限。

。

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规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。在上述特殊情况下，基金管理人应根据中国证监会及相关法律法规的规定进行调整。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，如基金托管人提醒基金管理人后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单，但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知基金托管人。新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5、本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人就相关事项协商一致后签订补充协议，明确基金投资流通受限证券的比例。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度

---

和比例等的情况进行监督。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

7、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应及时核对并回复基金托管人，对于收到的书面通知基金管理人应以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限。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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

8、基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。包括但不限于：对基金托管人发出的提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

9、若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人及时纠正，由此造成的损失由基金管理人承担。

10、基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### （三）基金财产的保管

1.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2.基金托管人应安全保管基金财产。

3.基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

4.基金托管人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。

5.基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的实物证券的损坏、灭失，由此产生的责任基金托管人不承担责任。

6.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，到账日基金财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。基金管理人未及时催收给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失。

---

7.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财产。

#### （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

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 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，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.根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。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，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （五）基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称、证件号码和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

基金管理人应根据相关法规的要求，定期将基金份额持有人名册相关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。基金管理人和托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

#### （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，仲裁地点为深圳市，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，仲裁费用由败诉方承担。

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

##### 1、托管协议的变更程序

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。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

##### 2、基金托管协议终止出现的情形

- 1) 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

基金管理人为基金投资者提供基金电子交易服务。投资人可登录基金管理人的网站([www.51fund.com](http://www.51fund.com))查询详情。

#### （四）联系方式

上投摩根基金管理有限公司

咨询电话：400 889 4888、021 3879 4888

网址：[www.51fund.com](http://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、其它应披露事项

2013年2月8日，上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告

2013年3月14日，关于限制上投摩根行业轮动证券投资基金申购及转换转入业务金额的公告

2013年4月19日，上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告

2013年5月31日，上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金投资大华股份非公开发行股票的公告

上述公告均刊登于《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》及基金管理人公司网站上。

## 二十三、备查文件

- (一) 中国证监会批准上投摩根行业轮动股票型证券投资基金募集的文件
- (二) 上投摩根行业轮动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。