

# 上投摩根中小盘股票型证券投资基金

## 招募说明书（更新）摘要

**基金合同生效日期：2009年1月21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. 投资有风险，投资人申购基金时应当认真阅读招募说明书；
2. 基金的过往业绩并不预示其未来表现；
3. 本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、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。
4. 本招募说明书所载内容截止日为2014年1月20日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2013年12月31日。

二零一四年三月

## 一、基金管理人

### (一)基金管理人概况

本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基本信息如下：

注册地址：上海市浦东富城路 99 号震旦国际大楼 20 层

办公地址：上海市浦东富城路 99 号震旦国际大楼 20 层

法定代表人：陈开元

总经理：章硕麟

成立日期：2004 年 5 月 12 日

实缴注册资本：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% 变更为目前的 51% 和 49%。

2006 年 6 月 6 日，基金管理人的名称由“上投摩根富林明基金管理有限公司”变更为“上投摩根基金管理有限公司”，该更名申请于 2006 年 4 月 29 日获得中国证监会的批准，并于 2006 年 6 月 2 日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

2009 年 3 月 31 日，基金管理人的注册资本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：

董事：Paul Bateman

毕业于英国 Leicester 大学。

历任 Chase Fleming Asset Management Limited 全球总监，摩根资产管理全球投资管理业务 CEO。

现任摩根资产管理全球主席、摩根资产管理委员会主席及投资委员会会员。同时也是摩根大通高管委员会资深成员。

董事：许立庆

台湾政治大学工商管理硕士学位。

曾任摩根富林明台湾业务总经理、摩根资产管理亚太区行政总裁。

现任怡和（中国）有限公司主席、怡和管理有限公司董事；香港证券及期货事务监察委员会投资产品咨询委员会委员；富时台湾交易所台湾系列指数咨询委员会主席。

董事：Jed Laskowitz

获美国伊萨卡学院学士学位（主修政治）及布鲁克林法学院荣誉法学博士学位。

曾负责管理 J.P Morgan 集团的美国基金业务。

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

董事：杨德红

获复旦大学经济学学士，中欧工商管理学院 MBA。

现任上海国际集团有限公司副总经理。

董事：林彬

获中欧工商管理学院 MBA。

曾任香港沪光国际投资管理有限公司副总经理。

现任上海国际信托有限公司副总经理。

董事：潘卫东

硕士研究生，高级经济师。

曾任上海市金融服务办公室金融机构处处长（挂职）、上海国际集团有限公司总裁助理。

现任上海国际集团有限公司副总裁、上海国际信托有限公司党委书记、董事长。

董事：章硕麟

获台湾大学商学硕士学位。

曾任怡富证券（台湾）投资顾问股份有限公司协理、摩根大通（台湾）证券副总经理、摩根富林明（台湾）证券股份有限公司董事长。

现任上投摩根基金管理有限公司总经理。

独立董事：

独立董事：周道炯

大学专科学历，曾就学于安徽省委马列夜大学、中共安徽省委中级党校进修班、中共中央高级党校培训班。

曾任中国证监会主席、中国建设银行行长、九届全国人大财经委委员。

现任 PECC 中国金融市场发展委员会顾问。周道炯先生长期从事证券金融市场监管工作，目前作为高级顾问为证券市场改革提供顾问咨询意见。

独立董事：刘红忠

国际金融系经济学博士，现任复旦大学国际金融系主任、复旦大学国际金融研究中心副主任、中国金融学会理事、中国国际金融学会理事和上海市金融学会理事。

独立董事：戴立宁

获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

历任台湾财政部常务次长。

现任台湾东吴大学专任客座副教授。

独立董事：李存修

获美国加州大学柏克利校区企管博士(主修财务)、企管硕士、经济硕士等学位。

现任台湾大学财务金融学系专任教授。

2. 监事会成员基本情况:

监事长: 郁忠民

研究生毕业, 高级经济师。

历任华东政法学院法律系副主任; 上海市证券管理办公室稽查处、机构处处长; 上海国际集团有限公司投资管理部经理; 上海证券有限责任公司副董事长、总经理、党委副书记。

现任上海国际集团金融管理总部总经理。

监事: Simon Walls

获伦敦大学帝国理工学院的数学学士学位。

历任 JPMorgan Asset Management (Japan) Ltd 总裁、首席运营官; JPMorgan Trust Bank 总裁、首席运营官以及基础架构总监。

现任摩根资产管理日本董事长以及投资管理亚洲首席行政官。

监事: 张军

曾任上投摩根基金管理有限公司交易部总监。

现任上投摩根亚太优势股票型证券投资基金和上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金基金经理。

监事: 万隽宸

曾任上海国际集团有限公司高级法务经理。

现任上投摩根基金管理有限公司总经理助理、风险管理部总监。

3. 总经理基本情况:

章硕麟先生, 总经理。

获台湾大学商学硕士学位。

曾任怡富证券(台湾)投资顾问股份有限公司协理、摩根大通(台湾)证券副总经理、摩根富林明(台湾)证券股份有限公司董事长。

现任上投摩根基金管理有限公司总经理。

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

董红波先生，管理学硕士，曾任职于中华全国供销合作总社监察局及办公厅、中国平安人寿上海分公司战略发展部，2004 年进入泰信基金管理公司，曾先后

担任研究部副经理、泰信先行策略基金经理助理，2007年1月至2008年6月担任泰信先行策略基金经理，2008年7月进入上投摩根基金管理有限公司。2009年1月起担任上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金经理，自2012年2月起同时担任上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金基金经理，自2013年5月起同时担任上投摩根中国优势证券投资基金基金经理。

本基金的历任基金经理为王振州先生，任职时间为自本基金合同生效日起至2011年12月8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。

## 二、基金托管人概况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010) 6759 5096

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商

业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

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

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

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

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险



资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等 12 个职能处室、团队，现有员工 225 人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金销售机构:

1. 直销机构: 上投摩根基金管理有限公司 (同上)

2. 代销机构:

(1) 中国建设银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人: 王洪章

客户服务电话: 95533

传真: 010-66275654

(2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人: 姜建清

客户服务统一咨询电话: 95588

网址: [www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(3) 中国农业银行股份有限公司

住所: 北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人: 蒋超良

客户服务电话: 95599

网址: [www.abchina.com](http://www.abchina.com)

(4) 中国银行股份有限公司

地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号 客户服务电话: 95566

法定代表人：田国立

网址：www.boc.cn

(5) 招商银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

客户服务中心电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(6) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

客户服务热线：95559

网址：[www.bankcomm.com](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

(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](http://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](http://www.cmbc.com.cn)

(13) 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)

(14) 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](http://bank.pingan.com)

(15) 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)

(16) 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

(17) 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](http://www.sywg.com)

(18) 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](http://www.962518.com)

(19) 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](http://www.gtja.com)

(20) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）  
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼  
法定代表人：孙树明  
联系人：黄岚  
统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点  
公司网站：<http://www.gf.com.cn>

(21) 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  
联系人：林生迎  
客户服务电话：95565  
网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(22) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号  
办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号  
法定代表人：袁长清（代行）  
电话：021-22169999  
传真：021-22169134  
联系人：刘晨

网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(23) 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)

(24) 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)

(25) 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](http://www.xyzq.com.cn)

(26) 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](http://www.htsec.com)

(27) 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](http://www.guosen.com.cn)

(28) 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](http://www.guodu.com)

(29) 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](http://www.htsc.com.cn)

(30) 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

(31) 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](http://www.dfzq.com.cn)

(32) 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](http://www.cfzq.com)

(33) 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](http://www.xcsc.com)

(34) 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

(35) 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

(36) 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

(37) 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

(38) 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](http://www.tebon.com.cn)

(39) 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](http://www.cjis.cn)

(40) 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](http://www.hysec.com)

(41) 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)

(42) 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

(43) 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)

(44) 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)

(45) 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)

(46) 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)

(47) 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)

(48) 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)

(49) 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)

(50) 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： 4008-773-772

公司网站： [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(51) 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)

(52) 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)

(53) 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)

(54) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址： 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址： 北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人： 闫振杰

联系电话： 010-62020088

传真： 010-62020035

联系人： 宋丽冉

客服电话： 4008886661

公司网址： [www.myfund.com](http://www.myfund.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: 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 45 楼

负责人: 倪骏骥

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

#### 四、基金概况

基金名称: 上投摩根中小盘股票型证券投资基金

基金运作方式: 契约型开放式

#### 五、基金的申购费、赎回费和转换费

##### 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）	1,000 元每笔
----------------	-----------

## 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	0.35 %
大于等于两年小于三年	0.2 %
大于等于三年	0 %

## 3、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。

## 六、基金的投资

### (一)投资目标

本基金重点投资于中国 A 股市场上的中小盘股票，通过缜密的资产配置原则和严格的行业个股选择，分享中国经济高速增长给优势中小市值上市公司带来的机遇，并积极运用战略和战术资产配置策略，动态优化投资组合，力求实现基金资产长期稳健增值。

### (二)投资范围

本基金投资具有良好流动性的金融工具，投资范围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。其中，股票投资的比例范围为基金资产的 60% - 95%；债券、权证、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比例范围为 5-40%。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%的股票资产投资于中小盘股票。

基金管理人每半年末将对中国 A 股市场中的股票按流通市值从小到大排序并相加，累计流通市值达到 A 股总流通市值 70%的这部分股票归入中小盘股票。在此期间对于未被纳入最近一次排序范围的股票（如新股上市等），如果其流通市值可满足以上标准，也称为中小盘股票。

一般情况下，上述所称的流通市值指的是在国内证券交易所上市交易的股票的流通股本乘以收盘价。如果排序时股票暂停交易或停牌等原因造成计算修正的，本基金将根据市场情况，取停牌前收盘价或最能体现投资者利益最大化原则的公允价值计算流通市值。

如果今后市场中出现更科学合理的中小盘股票界定及流通市值计算方式，本基金将予以相应调整，并提前三个工作日公告变更后具体的计算方法。

此外，如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围；如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人可依据相关规定履行适当程序后相应调整本基金的投资比例上限规定，不需经基金份额持有人大会审议。

### （三）投资理念

在中国经济高速增长的环境下，具有领先优势的中小市值企业面临着巨大的发展机遇。本基金将深入挖掘中小市值上市公司未来高成长性和内在价值带来的投资机会。

### （四）投资策略

本基金充分借鉴摩根资产管理集团全球行之有效的投资理念和技术，运用“自下而上”精选个股与“自上而下”资产配置相结合的投资策略，重点投资于具有



行业优势、公司优势和估值优势的中小市值上市公司股票。同时结合市场研判，对相关资产类别的预期收益进行监控，动态调整股票、债券等大类资产配置。

## 1、股票投资策略

由于中国经济是新兴的市场经济体，处于内需不断增长的过程中。对于那些具有领先优势的中小市值公司来说，往往能够获得跳跃式的发展速度和巨大的成长空间。本基金主要采用以下三层模式，挖掘并投资于具有合理商业模式和核心竞争能力及巨大发展潜力的中小市值上市公司：

### 1) 行业优势

立足全球视野，在中国宏观经济运行及具体产业政策的背景下，分析各个行业所处的发展周期和发展前景。甄选出当前处于上升周期和产业政策受益的行业，作为资产配置的依据。

不同的行业由于处于不同的产业周期，其发展会有很大的不同，对正处于结构性调整的中国经济，这一点尤为重要。本基金正是基于这样的分析，重点投资处于上升周期和产业政策受益行业的中小市值上市公司，以把握其快速成长带来的投资机会。重点关注以下两类企业：（1）能够从产业调整、消费升级、汇率变革等中国经济结构性变迁中获益，且保持长期发展优势的上市公司；（2）在细分行业中具有领先地位且保持长期发展优势的上市公司（具有领先的经营模式、稳定良好的销售网络、市场品牌或创新产品等竞争优势）。

### 2) 公司优势

本基金根据上市公司的净利润增长率、市场份额增长率等成长性指标，将其与行业平均水平作比较，定量分析公司当前在行业中所处的领先地位。

本基金主要通过从公司成长能力和未来成长潜力两方面深度挖掘公司的优势。

#### （1）成长能力分析

企业历史的财务表现不但能刻画企业的经营情况，还可以较大程度上反映未来成长性。在所有满足本基金界定的中小市值上市公司中，选取过去两年主营业务收入增长率优于行业平均水平，且净资产收益率超过 GDP 增长率，且边际主营业务收入增长率递增的高成长上市公司，构建初级股票池。

#### （2）未来成长潜力挖掘

本基金对上市公司未来成长潜力的判断，主要是从挖掘上市公司保持高成长

性和业绩增长的驱动因素，深入分析这些驱动因素是否具有可持续性。

深入分析上市公司的商业盈利模式，重点分析这种盈利模式是否合理且具有可持续性，能否带动公司利润持续增长；并判断该商业模式在该公司继续扩张的过程中是否容易复制，是否符合市场经济和行业发展的趋势。

根据对上市公司的产品定价能力、竞争对手情况、产品的可复制性、产业链分析等方面的考察，判断公司当前在行业中或细分行业中是否具有一定的垄断地位；判断公司的市场份额是否在不断提升，市场份额的提升对主营业务收入增长率是否具有带动效应。

根据上市公司的公司治理结构、管理层素质及其经营决策能力、企业品牌、创新能力、投资效率等方面分析公司是否具备长期领先的能力。

### 3) 估值优势

市场对中小型公司估值的差异较大，本基金结合上市公司所处行业、业务模式等特征，在以上筛选出的具有行业优势和公司优势的中小市值公司中，采用 PEG 和 PSG 等相对估值指标与股利折现模型、自由现金流折现模型等绝对估值方法，进一步精选出具有估值优势的股票。

## 2、资产配置策略

资产配置层面包括类别资产配置和行业资产配置，本基金不仅在股票、债券和现金三大资产类别间实施策略性调控，也通过对区域/行业效应进行评估后，确定行业资产配置权重。

本基金主要根据宏观经济、政策环境、利率走势、市场资金构成及流动性等情况，通过运用宏观经济分析中的量化模型和基本面分析预测宏观经济趋势，对大类资产类别的预期收益进行动态监控，适时作出时机选择，确定相应大类资产配置比例。

在把握宏观经济周期性波动的基础上，分析区域/行业效应，依据对行业基本面和景气周期的分析预测，同时考虑上市公司的行业成长性，确定基金在一定时期内的行业布局。在此基础上，本基金管理人将实施灵活的行业轮换策略，通过跟踪不同行业的相对价值以及行业景气周期变化等因素，适时调整行业资产配置权重，积极把握行业价值演化中的投资机会。

## 3、债券投资策略

配置防御性资产是控制基金组合风险的策略性手段。对于债券资产的选择，

本基金将以价值分析为主线，在综合研究的基础上实施积极主动的组合投资，并主要通过类属配置与债券选择两个层次进行投资管理。

在类属配置层次，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。

在券种选择上，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。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。

#### **4、可转换债券投资策略**

可转换债券（含可交易分离可转债）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。

#### **5、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,寻求其合理估值水平,谨慎进行投资,以追求较稳定的当期收益。

#### (五) 投资风险管理的

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、借鉴公司旗下已有的开放式基金风险管理成熟经验基础上,引进 Barra Aegis 股票投资组合风险管理系统、回报分析和组合最优化模型,通过量化的归因分析和严格的风险预算实现动态风险控制,实现组合风险与收益优化配比。

其中,股票投资组合风险管理系统通过对风险量化分析,适时测度追踪误差(Active Risk)、全风险(Total Risk)、风险价值(Value at Risk)、风险回报(Return at Risk)等,产生风险报表,提供风险分解、风险指标的暴露度、行业的暴露度与边际风险贡献的丰富数据,辅助基金管理人动态和精确地实现投资组合风险管理。

#### (六) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:

$40\% \times \text{天相中盘指数收益率} + 40\% \times \text{天相小盘指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$

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在与基金托管人协商一致的情况下对业绩比较基准予以调整。业绩比较基准的变更应履行适当的程序,报中国证监会备案,并予以公告。

#### (七) 风险收益特征

本基金是股票型基金,在证券投资基金中属于较高风险品种,其预期收益水平和风险高于混合型基金和债券型基金。 \_

#### (八) 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) 本基金股票投资的比例范围为基金资产的 60% - 95%；债券、权证、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比例范围为 5-40%；
- (7) 本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票资产的 80%；
- (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、股权分置改革中支付对价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。

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。

## (九)基金管理人代表基金行使股东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，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。

(十)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。

(十一)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	645,987,700.59	92.23
	其中：股票	645,987,700.59	92.23
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	53,627,053.81	7.66
6	其他资产	829,072.25	0.12
7	合计	700,443,826.65	100.00

注：截至2013年12月31日，上投摩根中小盘股票型证券投资基金资产净值为696,336,167.98元，基金份额净值为1.306元，累计基金份额净值为1.346元。

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,299,887.56	0.76
C	制造业	426,486,953.35	61.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,470,039.10	0.50
E	建筑业	22,767,310.98	3.27
F	批发和零售业	31,731,961.92	4.56
G	交通运输、仓储和邮政业	8,982,752.97	1.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,450,618.03	6.53
J	金融业	58,160,030.30	8.35
K	房地产业	15,892,389.98	2.28
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,742,891.90	1.97
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,691,570.00	1.54
S	综合	3,311,294.50	0.48



	合计	645,987,700.59	92.77
--	----	----------------	-------

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	002038	双鹭药业	1,270,076	64,202,341.80	9.22
2	000800	一汽轿车	3,425,777	40,766,746.30	5.85
3	600887	伊利股份	939,221	36,704,756.68	5.27
4	600518	康美药业	1,559,850	28,077,300.00	4.03
5	000581	威孚高科	697,075	21,469,910.00	3.08
6	002415	海康威视	895,316	20,574,361.68	2.95
7	600705	中航投资	1,146,200	19,462,476.00	2.79
8	002310	东方园林	596,698	19,398,651.98	2.79
9	600893	航空动力	1,004,864	19,223,048.32	2.76
10	000848	承德露露	747,263	18,270,580.35	2.62

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
本基金本报告期末未持有国债期货

#### 10. 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中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	296,707.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,178.59
5	应收申购款	520,186.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	829,072.25

#### 4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## 八、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	① - ③	② - ④
基金成立日-2009/12/31	53.00%	1.87%	70.47%	1.70%	-17.47%	0.17%
2010/1/1-2010/12/31	4.56%	1.50%	2.13%	1.33%	2.43%	0.17%
2011/1/1-2011/12/31	-28.40%	1.26%	-23.34%	1.13%	-5.06%	0.13%
2012/1/1-2012/12/31	13.67%	1.34%	4.12%	1.13%	9.55%	0.21%
2013/1/1-2013/12/31	3.32%	1.44%	7.83%	1.09%	-4.51%	0.35%

## 九、费用概览

### (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.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：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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、招募说明书更新部分说明

上投摩根中小盘股票型证券投资基金于 2009 年 1 月 21 日成立，至 2014 年 1 月 20 日运作满五年。现依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资

基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合基金管理人对本基金实施的投资经营活动，对 2013 年 9 月 3 日公告的《上投摩根中小盘股票型证券投资基金招募说明书（更新）》进行内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1、在重要提示中，更新内容截止日为 2014 年 1 月 20 日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为 2013 年 12 月 31 日。

2、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的相关信息进行了更新。

3、在“五、相关服务机构”中，变更并更新了代销机构的信息。

4、在“七、基金份额的申购、赎回和转换”的“申购和赎回的金额”中，对申购的单笔最低金额进行了更新。

5、在“八、基金的投资”的“基金的投资组合报告”中，根据本基金实际运作情况更新了最近一期投资组合报告的内容。

6、在“九、基金的业绩”中，根据基金的实际运作情况，对本基金成立以来的业绩进行了说明。

7、在“二十、对基金份额持有人的服务”的“基金电子交易服务”和“联系方式”中，对基金管理人的网站信息进行了更新。

8、在“二十二、其他应披露事项”中，对本披露期内的重大事项进行了披露。

2014 年 3 月 6 日