

上投摩根阿尔法股票型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(上接 A14 版)

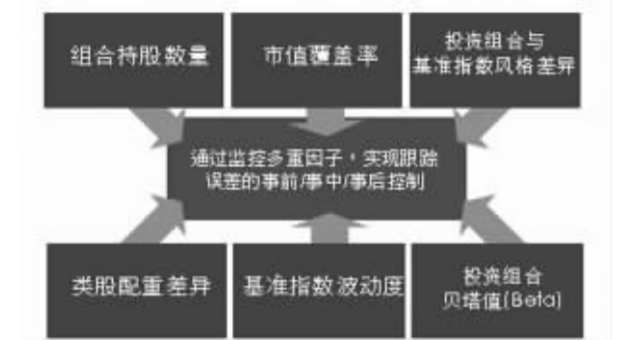
本基金是股票型证券投资基金,属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金产品。

(七)投资风险管理的

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

1. 监控多重因子,实现对跟踪误差的事前/事中/事后控制

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



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

2. 考察跟踪误差边际贡献实现风险控制

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

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

(八)投资限制

1. 组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的 10%;
- (2) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券,其市值不超过该证券的 10%;
- (3) 本基金股票投资比例为基金总资产的 60—95%,其它为 5—40%;
- (4) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;
- (5) 基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
- (6) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

(7) 法律法规或中国证监会对上述比例限制另有规定的,从其规定。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述(1)-(4)项规定的投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 承销证券;
- (2) 向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的交易;
- (4) 买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (8) 依照法律法规有关规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

(九)基金的融资

本基金可以按照国家的有关规定进行融资。

(十)基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;
- 2、有利于基金资产的安全与增值;
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金投资者的利益。

(十一)基金的投资组合报告

1、报告期末基金资产组合情况
截至 2007 年 12 月 31 日,上投摩根阿尔法股票型证券投资基金资产净值为 13,337,891,687.80 元,基金份额净值为 6.4794 元,累计基金份额净值为 6.5194 元。其资产组合情况如下:

序号	资产项目	金额(元)	占基金总资产比例
1	股票	9,991,929,632.47	74.16%
2	债券	642,332,509.58	4.77%
3	资产支持证券	0.00	0.00%
4	权证	107,461,807.19	1.29%
5	银行存款及清算备付金	2,519,194,664.38	18.70%
6	其他资产	132,576,808.83	0.98%
	合计	13,473,438,422.46	100.00%

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	分类	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	A 农林牧渔业	177,810,736.74	1.33%
2	B 采矿业	368,517,823.35	2.76%
3	C 制造业	5,165,662,310.02	38.73%
4	CI 食品、饮料	1,746,579,650.44	13.10%
5	C2 纺织服装	0.00	0.00%
6	C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
7	C2 木材、家具	0.00	0.00%
8	C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
9	04 石油、化学、塑胶、塑料	928,225,082.75	6.96%
10	05 电子	64,147,570.98	0.48%
11	08 金属、非金属	980,311,440.25	7.42%
12	C7 机械、设备、仪表	1,235,537,414.35	9.19%
13	09 医药、生物制品	163,963,727.44	1.23%
14	C9 其他制造业	46,477,427.90	0.35%
15	D 电力、煤气及水的生产和供应业	122,331,483.03	0.92%
16	E 建筑业	94,380,000.00	0.71%
17	F 交通运输、仓储业	260,265,711.13	1.98%
18	G 信息技术业	826,397,643.94	6.20%
19	H 批发和零售业	1,106,516,365.81	8.20%
20	I 金融、保险业	1,363,594,807.27	10.23%
21	J 房地产业	219,189,181.56	1.64%
22	K 社会服务业	53,912,225.04	0.40%
23	L 传播与文化产业	331,282.28	0.00%
24	M 综合类	243,347,585.61	1.82%
	合计	9,991,929,632.47	74.91%

3、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	证券代码	证券名称	库存数量(股)	证券市值(元)	市值占净值
1	600519	贵州茅台	5,277,083	1,213,729,090.00	9.10%
2	000063	中兴通讯	10,879,556	692,918,921.64	5.20%
3	600036	招商银行	17,399,364	689,536,795.32	5.17%
4	600299	蓝星新材	10,091,545	478,323,751.85	3.59%
5	000895	双汇发展	6,099,914	359,833,926.86	2.70%
6	600517	置信电气	6,032,617	340,963,512.84	2.56%
7	600761	安徽合力	8,266,020	309,893,069.80	2.32%
8	600019	宝钢股份	17,679,275	308,326,556.00	2.31%
9	601166	兴业银行	5,223,659	270,898,955.74	2.03%
10	600825	新华传媒	5,039,788	257,583,564.68	1.93%

广宇集团股份有限公司
召开 2008 年第二次临时股东大会的提示性公告

(1) 法人股东应持单位介绍信、营业执照复印件、加盖公章的法定代表人授权委托书或法人代表证明书及出席人身份证办理登记手续。

(2) 自然人股东持本人身份证、股票帐户卡;授权委托书;代理人持身份证、授权委托书、委托人股票帐户卡办理登记手续。

(3) 异地股东可采用信函或传真的方式登记,股东请填写《股东参会登记表》(格式附后),以便登记确认。传真在 2008 年 5 月 27 日 17:00 前送达公司董事会办公室。来信请寄:浙江省杭州市平海路 8 号 503 室公司董事会办公室,邮编:310006 (信封请注明“股东大会”字样)。

2、登记时间:2008 年 5 月 26 日、27 日,每日上午 9:00—11:30,下午 1:30—5:00

3、登记地点及联系方式:
浙江省杭州市平海路 8 号 503 室公司董事会办公室
电话:0571-87925786 传真:0571-87925813

联系人:华欣、王乐

5、其他事项:与会人员食宿及交通等费用自理。

六、参与网络投票的股东身份认证与投票程序
本次股东大会向股东提供网络方式的投票平台,网络投票包括交易系统投票和互联网投票,网络投票程序如下:

(一) 采用交易系统投票操作流程

1、通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为 2008 年 5 月 29 日的 9:30—11:30 和 13:00—15:00。

2、投票期间,交易系统将挂牌一只投票股票,股东以申报买入委托的方式对表决事项进行投票。

投票证券代码	证券简称	买卖方向	买入价格
362133	广宇股票	买入	对应申报价格

3、股东投票的具体程序为:
(1) 输入买入指令;

(2) 输入证券代码 362133;

(3) 在“委托价格”项下输入本次股东大会的议案序号,1 元代表议案 1,2 元代表议案 2,依次类推。总议案对应申报价格 100 元,代表一次性对所有议案进行投票表决。每一议案相应的申报价格具体如下表:

议案	议案内容	对应申报价格
总议案	以下所有议案	100元
1	关于修改《公司章程》的议案	1元
2	关于修改《募集资金使用管理办法》的议案	2元
3	关于修改《投资者关系管理办法》的议案	3元
4	关于修改《独立董事工作制度》的议案	4元
5	关于修改《累积投票制实施细则》的议案	5元
6	关于增加杭州广宇紫丁香房地产开发有限公司注册资本的议案	6元
7	关于提交股东大会确认公司新增项目投资的议案	7元
8	关于授权董事会增加土地储备投资额度及项目公司投资额度的议案	8元
9	关于授权董事会对子公司提供担保额度的议案	9元

4. 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	券种	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	国债	0.00	0.00%
2	金融债	189,051,000.00	1.42%
3	可转债	56,646,057.58	0.42%
4	央行票据	380,614,000.00	2.85%
5	企业债	16,021,452.00	0.12%
6	资产支持证券	0.00	0.00%
	合计	642,332,509.58	4.81%

5. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	07央行票据 06	165,376,000.00	1.24%
2	07国债开 17	99,600,000.00	0.75%
3	07央行票据 18	97,150,000.00	0.73%
4	06国债开 18	89,451,000.00	0.67%
5	07央行票据 12	68,103,000.00	0.51%

6. 基金投资资产支持证券及报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

无

7. 投资组合报告附注

1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2) 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

3) 截至 2007 年 12 月 31 日,本基金的其他资产项目包括:

序号	其他资产项目	金额(元)
1	交易保证金	2,977,932.01
2	应收利息	12,362,398.45
3	应收股利	0.00
4	应收申购款	103,965,592.16
5	应收证券清算款	13,269,886.21
	其他资产项目合计	132,576,808.83

4) 截至 2007 年 12 月 31 日,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细如下:

无

5) 截至 2007 年 12 月 31 日,本基金持有的权证投资如下:

	权证代码	权证名称	权证数量(份)	权证成本(人民币元)
主动投资	030002	五粮 YGC1	3,760,619	68,694,499.41
	合计		3,760,619	68,694,499.41
被动持有	580014	深高 CWB1	—	—
	580016	上汽 CWB1	803,304	6,887,598.66
	合计		960,120	7,407,156.24

六. 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实守信、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	净值增长率标准差②	业绩比较基准增长率③	业绩比较基准增长率标准差④	①-③	②-④
2005/10/11-2006/12/31	220%	0.00%	0.47%	0.00%	15%	-0.04%
2006/10/11-2007/12/31	72.01%	0.017	93.74%	0.012	79.27%	0.005
2007/10/11-2007/12/31	13.991%	0.0183	128.99%	0.0194	10.92%	-0.001

七. 费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

1. 费用的种类
- 1) 基金管理人的管理费;
- 2) 基金托管人的托管费;
- 3) 基金财产划支支付的银行费用;
- 4) 基金合同生效后的信息披露费用;
- 5) 基金份额持有人大会费用;
- 6) 基金合同生效后的会计师费和律师费;
- 7) 基金的证券交易费用;
- 8) 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

(4) 在“委托股数”项下填报表决意见,对应申报股数,具体如下表:

表决意见种类	赞成	反对	弃权
对应的申报股数	1股	2股	3股

(5) 确认投票委托完成

4、计票规则:
在计票时,同一表决只能选择现场和网络投票中的任意一种表决方式,如果重复投票,以第一次投票为准。

5、注意事项:
(1) 网络投票不能撤单;

(2) 对同一表决事项的投票只能申报一次,多次申报的以第一次为准;

(3) 同一表决权既通过交易系统又通过网络投票,以第一次投票为准;

(4) 如需查询投票结果,请于投票当日下午 6:00 以后登录深圳证券交易所互联网投票系统 (<http://wltp.cninfo.com.cn>),点击“投票查询”功能,可以查看个人投票结果,或通过投票委托的证券公司营业部查询。

(二) 采用互联网投票操作流程

1、按照《深圳证券交易所投资者网络服务身份认证业务实施细则》的规定,股东可以采用服务密码或数字证书的方式进行身份认证。

(1) 申请服务密码的流程
登陆网址:<http://wltp.cninfo.com.cn> 的“密码服务专区”;

填写“姓名”、“证券账户号”、“身份证号”等资料,设置 6—8 位的服务密码;如申请成功系统会返回一个 4 位数字的激活验证码。

(2) 激活服务密码
股东通过深交所交易系统比照买入股票的方式,凭借“激活验证码”激活服务密码。

买入证券	买入价格	买入股数
369999	1元	4位数字的“激活验证码”

该服务密码需要通过交易系统激活后使用。如服务密码激活指令上午 11:30 前发出的,当日下午 13:00 即可使用;如服务密码激活指令上午 11:30 后发出的,次日方可使用。服务密码激活后长期有效,在参加其他网络投票时不必重新激活。密码激活后如遇失可通过交易系统挂失,挂失后可重新申请,挂失方法与激活方法类似。申请数字证书时,可向深圳证券信息公司或其委托的代理发证机构申请。咨询电话:0755-83239016。

2、股东根据获取的服务密码或数字证书登录网址 <http://wltp.cninfo.com.cn> 进行互联网投票系统投票。

2、上述基金费用由基金管理人法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

3、基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式

1) 基金管理人的管理费
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$, 本基金年管理费率为 1.5%
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

2) 基金托管人的托管费
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$, 本基金年托管费率为 0.25%
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3) 上述 1、中 3) 到 8) 项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

4、不列入基金运作费用的项目
基金管理人和基金托管人因未履约或未履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付,基金收取认购费的,可以从认购费中列支。

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

6、基金税收
基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

(二) 与基金销售有关的费用
与基金销售有关的费用主要包括基金的申购费、赎回费、转换费等,上述费用具体的费率、计算公式、收取使用方式等内容请参见本招募说明书“第七章基金份额的申购、赎回和转换”。

八. 招募说明书更新部分说明

上投摩根阿尔法股票型证券投资基金于 2005 年 10 月 11 日成立,至 2008 年 4 月 10 日运作满二年半。现依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合基金管理人对本基金实施的投资经营活动,对 2007 年 11 月 26 日公告的《上投摩根阿尔法股票型证券投资基金招募说明书》进行内容补充和更新,主要更新的内容如下:

1、在“三、基金管理人”的“主要人员情况”中,对董事、独立董事、监事、基金经理及投资决策委员会等信息进行了更新。

2、在“四、基金托管人”中,对基金托管人的基本情况及相关业务经营情况进行了更新。

3、在“五、相关服务机构”部分,补充了新增代销机构—工商银行、北京银行、中信银行、民生银行、平安银行、中银国际证券、华夏银行的有关信息。

4、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。

5、在“九、基金的业绩”中,根据基金的实际运作情况,对本基金 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日的业绩进行了说明。

6、在“二十、对基金份额持有人的服务”的“联系方式”中,增加新的咨询电话。

2008 年 5 月 26 日

证券代码:002133 证券简称:广宇集团 公告编号:(2008)037

本公司及全体董事、监事、高级管理人员保证公告内容真实、准确和完整,并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

广宇集团股份有限公司以下简称“公司”)第二届董事会第十四次会议决定于 2008 年 5 月 29 日召开 2008 年第二次临时股东大会,公司于 2008 年 5 月 14 日在《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》和巨潮资讯网 www.cninfo.com.cn 上刊登《广宇集团股份有限公司召开 2008 年第二次临时股东大会的通知》,根据《上市公司股东大会规则》、《公司章程》的规定,现发布关于召开股东大会提示性公告如下:

一、本次股东大会召开的基本情况

1、会议召开时间:2008 年 5 月 29 日(星期四)上午 9 时

2、股权登记日:2008 年 5 月 23 日

3、会议召开地点:杭州市平海路 8 号公司会议室

4、会议召集人:公司董事会

5、会议方式:本次股东大会采取现场投票与网络投票相结合的方式。公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统向公司股东提供网络形式的投票平台,公司股东可以在网络投票时间内通过深圳证券交易所的交易系统或互联网投票系统进行表决。

6、参加会议的方式:公司股东只能选择现场投票(现场投票可以委托代理人代为投票)和网络投票中的一种表决方式,同一表决权出现重复表决的以第一次投票结果为准。