上投摩根安裕回报混合型证券投资基金招募说明书

注册文号:中国证监会证监许可[2018]594号文
注册日期:[2018年4月2日]
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
二〇一八年八月

【重要提示】

本基金于【2018】年【4】月【2】日经中国证券监督管理委员会证监许可[2018]594号文注册。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,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。

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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

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。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资入连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等。

本基金可以参与中小企业私募债的投资。中小企业私募债发行人为中小微、非上市企业,存在着公司治理结构相对薄弱、企业经营风险高、信息披露透明度不足等特点。投资中小企业私募债将存在违约风险和流动性不足的风险,这将在一定程度上增加基金的信用风险和流动性风险。

本基金参与内地与香港股票市场交易互联互通机制下港股通相关业务,基金资产投资于港股,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,基金资产并非必然投资港股。

本基金属于混合型基金产品,预期风险和收益水平高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。

投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

一、绪言

招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规的规定,以及《上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“合同”或“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了上投摩根安裕回报混合型证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项,投资者在做出投资决策前应仔细阅读招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假内容,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,并经中国证监会注册。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,是投资者拟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:指上投摩根安裕回报混合型证券投资基金
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:指交通银行股份有限公司
4、基金合同:指《上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金合同》及对该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《上投摩根安裕回报混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6、招募说明书:指《上投摩根安裕回报混合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《上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金份额发售公告》
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2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013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2013年3月15日颁布、同年6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《公开募集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、《流动性风险管理规定》:指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
14、中国证监会:指中国证券监督管理委员会
15、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
16、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
17、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
18、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法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
19、合格境外机构投资者:指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
20、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
21、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
22、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
23、销售机构:指上投摩根基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售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
24、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和办理非交易过户等
25、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的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登记业务的机构
26、基金账户:指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
27、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基金的基金份额变动及结余情况的账户
28、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
29、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
30、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
31、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限
32、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所及相关的期货交易所的正常交易日
33、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开放日
34、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)
35、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
36、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
37、《业务规则》:指《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则,由基金管理人和投资人共同遵守
38、认购:指在基金募集期内,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
39、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
40、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
41、基金转换:指基金份额持有人按照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其他基金基金份额的行为
42、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
43、定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、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
44、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%
45、元:指人民币元
46、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
47、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和
48、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值
49、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
50、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
51、基金份额的分类:本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别
52、A类份额:指在投资人认购、申购基金时收取认购、申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额
53、C类份额:指不收取认购、申购费用,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额
54、摆动定价机制:指当遭遇大额申购赎回时,通过调整基金份额净值的方式,将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
55、流动性受限资产:指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产,包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
56、港股通标的股票:指内地投资者委托内地证券公司,经由境内证券交易所在香港设立的证券交易服务公司,向香港联合交易所进行申报,买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票
57、指定媒介: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介
58、不可抗力:指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

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:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼20层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼25层
法定代表人:陈氏
总经理:章砚麟
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:

上海国际信托投资有限公司	51%
JPMorgan Asset Management (UK) Limited	49%

上投摩根基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[2004]56号文批准,于2004年5月12日成立的合资基金管理公司。2005年8月12日,基金管理人完成了股东之间的股权变更事项。公司注册资本保持不变,股东及出资比例分别由上海国际信托有限公司67%和摩根资产管理(英国)有限公司33%变更为目前的51%和49%。

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

2009年3月31日,基金管理人的注册资本金由一亿五千万元人民币增加到二亿五千万元人民币,公司股东的出资比例不变。该变更事项于2009年3月31日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

基金管理人无任何受处罚记录。

二、主要人员情况

1. 董事会成员基本情况:

董事长:陈氏
博士研究生,高级经济师。
曾任上海浦东发展银行大连分行资金财务部总经理,上海浦东发展银行总行资金财务部总经理助理,上海浦东发展银行总行个人银行总部管理会计部、财富管理部总经理,上海国际信托有限公司副总经理兼董事会秘书,上海国际信托有限公司党委副书记、总经理。
现任上海国际信托有限公司党委书记、总经理;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。同时也是摩根大通商管委员会资深成员。

董事:Jed Laskowitz
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。
曾任摩根资产管理亚太区行政总裁。
现任摩根资产管理环球投资管理方案联席总监。

董事:Michael I. Falcon
学士学位(主修金融)。
曾任摩根资产退休业务总监。
现任摩根资产管理环球投资管理的亚太区行政总裁、亚太区基金业务总监、环球投资管理营运委员会成员、集团业太管理团队成员、集团投资管理业太区营运委员会主席。

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室金融机构处处长(挂职)、上海国际集团有限公司副总裁。
现任上海浦东发展银行股份有限公司副行长、上海国际信托有限公司党委书记、董事长。

董事:陈海宁
研究生学历、经济师。
曾任上海浦东发展银行金融部总经理助理、公投总部贸易融资部总经理、武汉分行副行长、武汉分行党委书记、行长。
现任上海浦东发展银行总行资产负债管理部总经理。

董事:丁蔚
硕士研究生。曾就职于中国建设银行上海分行个人银行业务部副总经理,上海浦东发展银行个人银行总部银行卡部总经理,个人银行总部副总经理兼银行卡部总经理。
现任上海浦东发展银行电子银行部(移动金融部)总经理。

董事:章砚麟
获台湾大学商学硕士学位。
曾任怡富证券股份有限公司副总经理(现名摩根大通证券)、摩根富林明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:俞樵
经济学博士。
现任清华大学公共管理学院经济与金融学教授及公共政策研究所所长。曾经在加里伯利大学经济系、新加坡国立大学经济系、复旦大学金融系等单位任教。

独立董事:刘红忠
国际金融系经济学博士
现任复旦大学经济学院教授,复旦大学金融研究中心副主任。

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。
曾任台湾财政部常务次长,东吴大学法学院副教授。
现任北京大学法学院及光华管理学院兼职教授。

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特聘教授。

2. 监事会成员基本情况:

监事会主席:赵峥嵘
硕士学位,高级经济师。
历任工商银行温州分行副行长、浦发银行温州分行副行长、行长及杭州分行行长等职务。现任上海国际信托有限公司监事长,党委副书记。

监事:张军
曾任上投摩根基金管理有限公司交易部总监、基金经理、投资组合管理部总监、投资绩效评估总监、国际投资部总监、组合基金投资部总监。
现任上投摩根基金管理有限公司投资董事,管理上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金和上投摩根全球多元配置证券投资基金(QDII)。

监事:万隽宸
曾任上海国际集团有限公司高级法务经理,上投摩根基金管理有限公司首席风险官,尚腾资本管理有限公司董事。
现任尚腾资本管理有限公司总经理。

3. 总经理基本情况:

章砚麟先生,总经理。
获台湾大学商学硕士学位。
曾任怡富证券股份有限公司副总经理(现名摩根大通证券)、摩根富林明证券股份有限公司董事长。

4. 其他高级管理人员情况:

杨红女士,副总经理
毕业于同济大学,获技术经济与管理博士
曾任招商银行上海分行稽核监督部业务副经理、营业部副经理兼工会主席、零售银行部副总经理、消费信贷中心总经理;曾任上海浦东发展银行上海分行个人银行业务部副总经理、个人银行发展管理部总经理、零售业务管理部总经理。

杜猛先生,副总经理
毕业于南京大学,获经济学硕士学位。
历任天同证券、中原证券、国信证券、中银国际研究员;上投摩根基金管理有限公司行业专家、基金经理助理、基金经理、总经理助理/国内权益投资一部总监兼资深基金经理。

孙芳女士,副总经理
毕业于华东师范大学,获世界经济学硕士学位。
历任华宝兴业基金研究员;上投摩根基金管理有限公司行业专家、基金经理助理、研究部副总监、基金经理、总经理助理/国内权益投资二部总监兼资深基金经理。

郭鹏先生,副总经理
毕业于上海财经大学,获企业管理硕士学位。
历任上投摩根基金管理有限公司市场经理、市场部副总监,产品及客户营销部总监、市场部总监兼互联网金融部总监、总经理助理。

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。

邹树波先生,督察长。
获管理学学士学位。
曾任天健会计师事务所高级项目经理,上海证监局主任科员,上投摩根基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监。

5. 本基金基金经理

基金经理施斌文先生,北京大学经济学硕士,2012年7月起加入上投摩根基金管理有限公司,在研究部任助理研究员、研究员,主要承担量化支持方面的工作。

基金经理聂曙光先生自2004年8月至2006年3月在南京银行任债券分析师;2006年3月至2009年9月在兴业银行任债券投资经理;2009年9月至2014年5月在中欧基金管理有限公司先后担任研究员、基金经理助理、基金经理、固定收益部总监、固定收益事业部临时负责人等职务,自2014年5月起加入上投摩根基金管理有限公司,自2014年8月起担任上投摩根纯债债券型证券投资基金基金经理,自2014年10月起担任上投摩根红利回报混合型证券投资基金基金经理,自2014年11月起担任上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金基金经理,自2015年1月起同时担任上投摩根稳进回报混合型证券投资基金基金经理,自2015年4月起同时担任上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金经理,自2016年6月起同时担任上投摩根优信增利债券型证券投资基金基金经理,自2016年8月起同时担任上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金和上投摩根岁岁丰定期开放债券型证券投资基金基金经理,自2017年1月起同时担任上投摩根安瑞回报混合型证券投资基金基金经理,自2017年4月起同时担任上投摩根安通回报混合型证券投资基金基金经理。

6. 基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

杜猛,副总经理兼投资总监;孙芳,副总经理兼投资副总监;朱晓龙,研究总监;孟晨波,总经理助理兼货币市场投资部总监;聂曙光,债券投资部总监;张军,投资董事;黄栋,量化投资部总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

1、依法募集资金,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、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、保存基金财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、法律法规和中国证监会规定的或《基金合同》约定的其他职责。

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)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;
(2)从事有可能使基金承担无限责任的投资;
(3)从事证券承销行为;
(4)违反证券交易业务规则,操纵和扰乱市场价格;
(5)违反法律法规而损害基金份额持有人利益的;
(6)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。

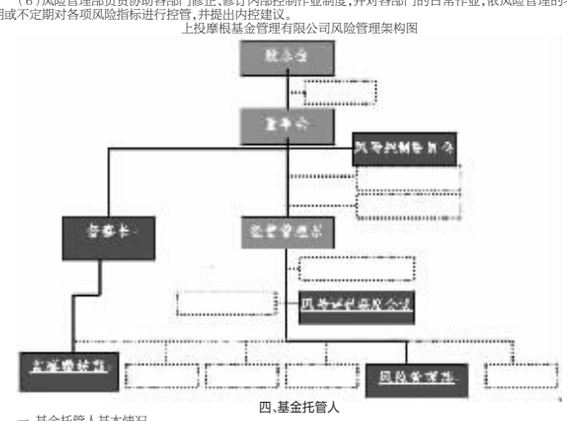
3、基金管理人关于内部合规控制声明书:

(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的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的评估。
(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。

上投摩根基金管理有限公司风险管理架构图



四、基金托管人

一、基金托管人基本情况

(一)基金托管人概况

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人:彭纯
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
邮政编码:200120
注册时间:1987年3月30日
注册资本:742.62亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号
联系人:陆志俊
电话:95559

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业,成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2017年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告,交通银行一级资本位列第11位,较上年上升2位;根据2017年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜,交通银行营业收入位列第171位。

截至2018年3月31日,交通银行资产总额为人民币92667.97亿元。2018年1-3月,交通银行实现净利润归属于母公司股东1人民币200.91亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称“托管中心”)。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(下转A18版)

上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
个人投资者理财服务热线:400 889 4888,(021)38794888
机构投资者理财服务热线:(021)38794999;(010)58369199
公司网站:www.cifm.com

重要提示

1、上投摩根安裕回报混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的已获中国证监会证监许可[2018]594号文准予募集注册。中国证监会对本基金的注册并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金为契约型开放式证券投资基金。

3、本基金的管理人为上投摩根基金管理有限公司(以下简称“本公司”),托管人为交通银行股份有限公司。注册登记机构为本公司。

4、本基金自2018年8月6日起至2018年9月7日止,面向个人投资者和机构投资者,通过交通银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、安信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、北京展恒基金销售有限公司、上海华夏财富投资管理有限公司、上海万得基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、上海好买基金销售有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、北京虹点基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、中证金牛(北京)投资咨询有限公司的代销网点和本公司的贵宾理财中心和电子交易系统同时发售。

5、本基金发售对象包括符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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。

6、基金份额的类别

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时,收取认购/申购费用的,称为A类基金份额;不收取认购/申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。

本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

在不违反相关法律法规规定及基金合同约定,且不损害基金份额持有人利益的前提下,本基金管理人可以根据市场情况在与基金托管人协商一致的情况下,增设新的基金份额类别、或者停止现有基金份额类别的销售等,不需要召开基金份额持有人大会审议,相关调整将按照《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。

7、募集币种:

人民币。

8、基金的面值:

本基金基金份额初始发售面值为人民币1.00元。

9、最低认购限额:

基金投资者首次认购本基金的最低限额为人民币10元(含认购费),追加认购的最低金额为每次人民币10元(含认购费)。

10、投资者欲购买本基金,需开立本公司基金账户,每个投资者仅允许开立一个本公司基金账户(保险公司多险种开户等符合法律法规规定的可以开立多个账户)。发售期内各代销网点同时为投资者办理开立基金账户的手续。请投资者注意,如同日在不同销售机构申请开立基金账户,可能导致开户失败。

11、基金账户开户和认购申请手续可以同时办理。

12、销售机构(指本公司代销网点和本公司贵宾理财中心或电子交易系统)对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接受了认购申请,申请的成功与否应以注册登记机构的确认结果为准。认购申请一经销售机构受理,不可以撤销。

13、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请阅读同时刊登在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上的《上投摩根安裕回报混合型证券投资基金招募说明书》。本基金的招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站 (www.cifm.com)、交通银行网站(http://www.bankcomm.com/)。投资者亦可通过本公司网站了解本公司的详细情况和本基金发售的相关事宜。

14、交通银行股份有限公司、建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、安信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、北京展恒基金销售有限公司、上海华夏财富投资管理有限公司、上海万得基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、上海好买基金销售有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、北京虹点基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、中证金牛(北京)投资咨询有限公司和本公司的贵宾理财中心和电子交易系统同时进行基金销售,具体的城市名称、网点名称、联系方式以及开户和认购等事项请见各代销机构在当地主要报纸上刊登的公告或在各代销网点发布的公告。

15、对于未开设销售网点地区的投资者,请拨打本公司的客户服务电话400 889 4888,(021)38794888咨询有关购买事宜。

16、基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。对于具体的募集期限,基金管理人可根据市场变化予以适当缩短。

17、风险提示

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资入连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等等。投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
注册登记机构:上投摩根基金管理有限公司

基金销售机构:交通银行股份有限公司、建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、安信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、北京展恒基金销售有限公司、上海华夏财富投资管理有限公司、上海万得基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、上海好买基金销售有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、北京虹点基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、中证金牛(北京)投资咨询有限公司和上投摩根基金管理有限公司贵宾理财中心和电子交易系统。

一、本次发售基本情况

1、基金名称

上投摩根安裕回报混合型证券投资基金(基金代码:上投安裕回报A 004823;上投安裕回报C 004824)。

2、基金类别:混合型证券投资基金

3、基金存续期限

不定期。

4、基金单位面值

每基金份额的初始发售面值为人民币1.00元。

5、投资目标

以追求稳健收益作为基金的投资目标,通过严格的风险控制,力争实现基金资产的稳健增值。

6、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、权证、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许