

信息披露 Disclosure

更新摘要

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	600519	贵州茅台	30000	219,438.00	1.20
2	600900	长江电力	7,000,000	122,064.00	0.67
3	601398	建设银行	15,400,000	100,870.00	0.56
4	601966	九牧王	6,000,000	97,362.00	0.53
5	601390	中国移动	11,500,000	95,565.00	0.47
6	600202	中石油	12,100,000	79,529.00	0.43
7	601169	北京银行	12,500,000	75,376.00	0.41
8	601288	农业银行	20,000,000	70,594.00	0.38
9	601888	中国国旅	1,000,000	64,410.00	0.35
10	600276	恒顺醋业	800,000	60,660.00	0.33

(四) 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	2,306,120.00	13.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	8,734,260.00	47.91
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	短期融资券(含短期融资券)	422,478.10	2.32
8	资产支持证券	2,901,000.00	16.01
9	其他	-	-
10	合计	14,463,868.10	79.29

(五) 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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111814009	国开债09C09	30,000	2,901,000.00	15.91
2	109761	17国债17	12,000	1,200,120.00	6.58
3	010383	01国债18	10,000	991,650.00	5.44
4	122366	14国债16	8,000	799,600.00	4.39
5	130629	15国债15	8,000	799,600.00	4.37

(六) 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贵金属支持证券投资组合

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	999999	黄金	1,000.00	100,000.00	0.55

本基金本报告期末未持有贵金属。

(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(八) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(九) 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。

(十) 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。

(十一) 投资组合报告附注

1. 报告期内本基金投资的前十名证券没有出现在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. 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,037.36
2	应收证券清算款	1,227,270.74
3	应收股利	-
4	应收利息	384,372.68
5	其他应收款	-
6	其他流动资产	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,586,480.76

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	鹏华转债	156,723.60	0.86
2	120035	久其转债	132,893.00	0.73
3	120016	顺兴转债	125,920.00	0.72

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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	601380	中国移动	85,065.00	0.47	期货合约

6. 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因合同久限原因,投资组合中部分证券与合计可能存在误差。

七. 基金业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额净值。基金过往业绩并不代表其未来表现,投资者有风险,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。

安瑞回报A

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准增长率②	超额收益率③	年化收益率④	①-②	①-④	②-④
自基金合同生效以来至2017年12月31日	0.90%	0.13%	3.15%	0.11%	-2.26%	0.02%	
2018.1.1-2018.9.6	0.18%	0.18%	1.50%	0.18%	-1.32%	0.00%	

安瑞回报C

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准增长率②	超额收益率③	年化收益率④	①-②	①-④	②-④
自基金合同生效以来至2017年12月31日	0.11%	0.13%	3.15%	0.11%	-3.04%	0.02%	
2018.1.1-2018.9.6	-0.11%	0.18%	1.50%	0.18%	-1.61%	0.00%	

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×15%+中证综合债券指数收益率×85%。

八. 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. 销售服务费;
4. 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费;
5. 《基金合同》生效前与基金相关的信息披露费、律师费、诉讼费和其他费;
6. 基金份额持有人大会费用;
7. 基金审计费、期货交割费用;
8. 基金银行账户费;
9. 销售服务费;
10. 根据相关法律法规及《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二. 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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 0.8\%$ 当年天数

H为每日应计提的管理费

E为前一日的基金资产净值

管理费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需出具资金划拨授权书。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费

本基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.25\%$ 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需出具资金划拨授权书。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自扣划日起,管理人应进行核对,如发现问题,应及时联系托管人协商解决。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金,以及基金管理人的基金行广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

3. 销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.5%。

C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.5%年费率计提,计算方法如下:

$H = E \times \text{销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需出具资金划拨授权书。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自扣划日起,管理人应进行核对,如发现问题,应及时联系托管人协商解决。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金,以及基金管理人的基金行广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

4. 除基金管理人和基金托管人履行法律法规及《基金合同》约定的基金费用外,由管理人及基金托管人根据其他法律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财产。

下列费用不列入基金费用:

1. 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;

2. 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3. 《基金合同》生效前的相关费用;

4. 其他根据法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四. 费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致并履行适当程序后,可根据基金发展情况调整管理费费率、基金托管费、销售服务费等相关费率。基金管理人必须就费率调整的实施日期在指定媒介上予以公告。

五. 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

九. 招募说明书修改

上海摩根安瑞回报混合型证券投资基金于2017年12月20日成立,至2018年9月24日运作满一年。现依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集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》及其他有关法律法规的要求,更新招募说明书。本基金基金经理孙蔚明先生,自2018年9月20日起,担任本基金基金经理职务,“暂停赎回或暂停支付赎回款项的情形”、“巨额赎回的情形及处理方式”中更新了相关内容。

在“八、基金的投资”的“投资目标和投资策略”中更新了相关内容。

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进行了最近一期投资组合报告的更新。

10. 在“九、基金的业绩”中,根据基金的实际运作情况,对本基金成立以来产生的业绩进行了更新。

11. 在“十一、基金资产的估值”的“暂停估值的情形”中对相关内容进行了更新。

12. 在“十五、基金的信息披露”的“公开披露的信息”中对相关内容进行了更新。

13. 在“十八、基金合同的内容摘要”中,根据基金合同的修改进行了更新。

14. 在“二十二、其他应披露事项”中列入了本报告期与基金投资有关的重大事项。

上海摩根安瑞回报混合型证券投资基金

二〇一八年九月七日

上投摩根安瑞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[2016]2541号
生效日期:2017年11月25日
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
重要提示:
1. 本基金经中国证监会注册,基金的投资业绩并不预示其未来表现,基金管理人承诺不以任何基金资产为特定对象提供投资建议。
2. 本招募说明书依据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会注册。
3. 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即表明其对本基金合同的承认和接受,并视同《基金法》、《运作办法》及其他相关法律法规享有权利并承担义务。
4. 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。
5. 本基金可以参与中小企业私募债券的投资,中小企业私募债发行人为中小微企业,非上市公司,存在着公司治理结构相对薄弱,企业经营风险高,信息披露透明度不够等特点。投资者应充分了解该类债券的风险和流动性不足的风险,这将在一定程度上影响基金的投资收益和流动性风险。
6. 本招募说明书所载内容截止日为2018年7月24日,基金投资组合及基金业绩的数据截止为2018年6月30日。

二〇一八年九月

一. 基金管理人

一. 基金管理人概况

本基金的管理人为上海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号富汇国际大厦25层

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号富汇国际大厦25层

法定代表人:陈彪

总经理:章晓春

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

股权结构及持股比例:

1. 上海国信信托有限公司 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]16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,基金管理人完成了与开友之间的股权转让事项,公司注册资本保持不变,股权及出资比例由上海国际信托有限公司67%、摩根资产管理(英国)有限公司33%变更为目前51%和49%。

2006年6月6日,基金管理人名称由“上投摩根林明基基金管理公司”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。

截至2018年9月6日,基金管理人注册资本为人民币伍亿元,人民币普通股人民币二亿五千万人民币,公司股东的出资比例变更。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到处罚记录。

二. 主要人员情况

1. 董事成员基本情况:

董事长:陈彪

博士研究生,高级经济师。

曾任上海浦东发展银行大区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,上海浦东发展银行总行人力资源部副总经理,财富管理部副总经理,上海国信信托有限公司副总经理兼董事秘书,上海国际信托有限公司党委副书记、总经理。

董事:Paul Bateman

大客户经理,曾任渣打银行全球董事,现任Chase Fleming Asset Management Limited全球董事,摩根资产管理全球投资银行业务执行总裁。

董事:Michael J. Fulcon

曾任摩根资产管理亚太区首席运营委员会成员及投资委员会成员。

董事:李欣

曾任摩根资产管理亚太区行政总裁,资产管理运营委员会成员,集团亚太区管理团队成员,集团资产管理亚太区运营委员会主席。

董事:王智晋

曾任摩根资产管理机构分销业务总监、机构业务拓展总监、香港及中国基金业务总监。

董事:廖卫东

博士研究生,高级经济师。

曾任上海浦东发展银行办公室公共机构处处长(挂职)、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:陈海宁

曾任上海浦东发展银行股份有限公司副行长,上海国信信托有限公司董事长。

董事:陈海平

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。

董事:上海国信信托有限公司负责资产管理业务的副总经理兼战略发展部总经理

董事:丁蔚

博士研究生。

曾任渣打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,个人银行总部副经理兼银行卡部总经理。

现任上海浦东发展银行总行零售业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展银行总行副行长,现任上海浦东发展银行总行副行长兼基金业务部总经理。

董事:章晓春

曾任上海浦东发展