上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

基金合同生效日期：2016年8月5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，投资人认购（或申购）基金时应当认真阅读本招募说明书；
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。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、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。
5. 本招募说明书摘要所载内容截止日为2018年8月4日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为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25楼
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楼
法定代表人：陈兵
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投资有限公司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：陈兵
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：Paul Bateman
大学本科学位。
曾任Chase Fleming Asset Management Limited全球总监、摩根资产管理全球投资管理业务行政总裁。
现任摩根资产管理全球主席、资产管理营运委员会成员及投资委员会成员。
董事：Michael I. Falcon
金融学学士学位。
曾任摩根资产退休业务总监。
现任摩根资产管理亚太区行政总裁、资产管理营运委员会成员、集团亚太管理团队成员、集团资产管理亚太区营运委员会主席。
董事：王大智
学士学位。
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。
现任摩根投信董事长暨摩根资产管理集团台湾区负责人。
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副总裁、上海国际信托有限公司党委书记。
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兼任总行战略发展部总经理。
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总行零售业务部总经理。
董事：章硕麟
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金融与治理中心主任。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：赵睿嵘
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：梁斌
学士学位。
曾在高伟绅律师事务所（香港）任职律师多年。
现任摩根大通集团中国法律总监。
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：
章硕麟先生，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信贷部总经理、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、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，聂娜光先生，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。
基金经理，黄栋先生，上海财经大学经济学硕士。2005年至2010年先后在东方证券、工银瑞信基金从事金融工程研究工作；2010年7月起加入上投摩根基金管理有限公司，主要负责金融工程研究方面的工作。2012年9月起担任上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金基金经理，2013年7月至2016年8月同时担任上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2015年6月起同时担任上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，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，自2017年8月起同时担任上投摩根优选多因子股票型证券投资基金基金经理，自2018年1月起同时担任上投摩根量化多因子灵活配置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。
二、基金托管人
（一）基本情况
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：田国立
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
中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。
2017年6月末，本集团资产总额216,920.67亿元，较上年末增加7,283.62亿元，增幅3.47%。上半年，本集团实现利润总额1,720.93亿元，较上年同期增长1.30%；净利润较上年同期增长3.81%至1,390.09亿元，盈利水平实现平稳增长。
2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”，《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。
中国建设银行总行设资产托管业务部，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、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。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。
（二）主要人员情况
纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
（三）基金托管业务经营情况
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2017年二季度末，中国建设银行已托管759只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。
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：田国立
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.com
(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：易会满
客户服务统一咨询电话：95588
网址：www.icbc.com.cn
(3) 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：陈四清
客服电话：95566
网址：www.boc.cn
(4) 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
法人代表：李建红
客户服务中心电话：95555
网址：www.cmbchina.com
(5) 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：彭纯
客户服务热线：95559
网址：www.bankcomm.com
(6) 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：高国富
客户服务热线：95528
网址：www.spdb.com.cn
(7) 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
客服电话：95561
网址：www.cib.com.cn
(8) 申万宏源证券有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层（邮编：200031）
法定代表人：李梅
客服电话：95523或4008895523
国际互联网网址：www.swhysc.com
(9) 申万宏源西部证券有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室（邮编：830002）
法定代表人：韩志谦
客户服务电话：400-800-0562
网址：www.hysec.com
(10) 上海证券有限责任公司
注册地址：上海市黄浦区四川中路213号久事商务大厦7楼
办公地址：上海市黄浦区四川中路213号久事商务大厦7楼
法定代表人：李俊杰
客户服务电话：021-962518
网址：www.962518.com
(11) 国泰君安证券股份有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路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：杨德红
客户服务咨询电话：95521
网址：www.gtja.com
(12) 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
客户服务电话：95565
网址：www.newone.com.cn
(13) 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：周健男
网址：www.ebscn.com
(14) 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
客服电话：4008888888
网址：www.chinastock.com.cn
(15) 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
客户服务咨询电话：400-8888-108；
网址：www.csc108.com
(16) 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：杨华辉
客户服务热线：95562
公司网站：www.xyzq.com.cn
(17) 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
客服电话：95553
公司网址：www.htsec.com
(18) 国都证券股份有限公司
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
客户服务电话：4008188118
网址：www.guodu.com
(19) 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
客户服务电话：95536
公司网址：www.guosen.com.cn
(20) 中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
客户服务热线：010-95558
(21) 中信证券（山东）有限责任公司
注册和办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
法定代表人：杨宝林
客户服务电话：95548
公司网址：www.citicssd.com
(22) 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：王连志
客服电话：4008001001
公司网址：www.essence.com.cn
(23) 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：尤习贵
客户服务热线：95579或4008-888-999长江证券客户服务网站：www.95579.com
(24) 平安证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层（518048）
法定代表人：詹露阳
客服电话：95511-8
网址：http://stock.pingan.com
(25) 诺亚正行基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号C栋2楼
法定代表人：汪静波
客服电话：400-821-5399
公司网站：www.noah-fund.com
(26) 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
客服电话：400-820-2899
公司网站：www.erichfund.com
(27) 北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦6层
法定代表人：闫振杰
客服电话：400-818-8000
公司网站：www.myfund.com
(28) 上海华夏财富投资管理有限公司
住所：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人：李一梅
客户服务电话：400-817-5666
传真：010-88066552
(29) 上海万得基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人：王廷富
客户服务电话：400-821-0203
网址：www.520fund.com.cn
(30) 嘉实财富管理有限公司
住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
法定代表人：赵学军
客服电话：400-021-8850
网站：www.harvestwm.cn
(31) 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
(32) 深圳众禄基金销售股份有限公司
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 及 www.jjmmw.com
(33) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室
办公地址：杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6楼
法定代表人：陈柏青
客服电话：400-0766-123
公司网站：www.fund123.cn
(34) 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
(35) 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：浙江省杭州市滨柏路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
(36) 上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：李兴春
客服电话：400-921-7755
网站：www.leadbank.com.cn
(37) 上海陆金所基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：胡学勤
客服电话：400-821-9031
网站：www.lufunds.com
(38) 北京虹点基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
法定代表人：郑毓栋
客服电话：400-618-0707
网站：www.hongdianfund.com
(39) 珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼
法定代表人：肖雯
客服电话：020-89629066
网站：www.yingmi.cn
(40) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人：马勇
客服电话：400-166-1188
网站：http://8.jrj.com.cn/
(41) 北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人：李昭琛
客服电话：010-62675369
网站：www.xincai.com
(42) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部
法定代表人：江卉
客服电话：4000988511/4000888816
网址：http://fund.jd.com/
(43) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司
注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法定代表人：钱昊旻
客服电话：4008-909-998
网址：www.jnlc.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：上海源泰律师事务所
注册地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人：廖海
联系电话：021-5115 0298
传真：021-5115 0398
经办律师：廖海、刘佳
（四）会计师事务所：
名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址：中国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：中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
联系电话：(021) 23238888
传真：(021) 23238800
联系人：沈兆杰
经办注册会计师：薛竟、沈兆杰
四、基金概况
基金名称：上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金
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：

A类基金份额	
申购金额区间	费率
人民币100万以下	1.0%
人民币100万以上（含），500万以下	0.6%
人民币500万以上（含）	每笔人民币1,000 元

C类基金份额不收取申购费。
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：

A类基金份额：	
持有期限	费率
7日以内	1.5%
7日以上（含），30日以内	0.75%
30日以上（含），一年以内	0.50%
一年以上(含)，两年以内	0.35%
两年以上(含)，三年以内	0.2%
三年以上(含)	0 %

C类基金份额：

持有期限	费率
7日以内	1.5%
7日以上（含），30日以内	0.5%
30日以上（含）	0%

3. 基金转换
基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理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
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。
（二）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）、权证、债券等固定收益类金融工具（包括国债、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、银行存款等）、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（须符合中国证监会相关规定）。
股票资产占基金资产的0%-50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
（三）投资策略
1、资产配置策略
在大类资产配置上，本基金将通过对宏观经济环境、财政政策、货币政策、产业政策的分析和预测，判断宏观经济所处的经济周期及运行趋势，结合对资金供求状况、股票债券市场的估值水平以及市场情绪的分析，评估各类别资产的风险收益特征，并加以分析比较，形成对不同类别资产表现的预测，确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产间的配置比例。本基金将密切关注市场风险的变化以及各类别资产的风险收益的相对变化趋势，动态调整各大类资产之间的比例，在严格控制基金下行风险的前提下，力争提高基金收益。
本基金管理人将采用严格的仓位控制策略，根据基金单位净值的变化和对未来市场的判断，灵活控制股票仓位，控制下行风险。具体而言，本基金将以每一个会计年度作为仓位控制策略执行的周期，即：以上一年度年末的基金单位净值作为基准，根据基金当前净值与本年度单位累计分红金额之和确定股票仓位上限。当基金份额单位净值连续五个交易日达到净值调整阀值，则触发仓位调整机制，基金管理人应根据对未来市场的判断在十个交易日内将股票仓位调整到规定范围内。具体股票仓位控制要求如下表所示：

基金净值区间	股票仓位上限
NAV1+D（1.03*NAV0	30%
1.03*NAV0≤NAV1+D（1.05*NAV0	40%
NAV1+D≥1.05*NAV0	50%

注：NAV0为上一年度年末基金单位净值，NAV1为基金当前单位净值，D为本年度单位累计分红金额。
2、债券投资策略
本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，结合不同债券品种的到期收益率、流动性、市场规模等情况，灵活运用久期策略、期限结构配置策略、信用债策略、可转债策略等多种投资策略，实施积极主动的组合管理，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，对债券组合进行动态调整。
（1）久期管理策略
本基金将基于对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，对未来市场的利率变化趋势进行预判，进而主动调整债券资产组合的久期，以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。
（2）期限结构配置策略
在确定债券组合的久期之后，本基金将通过对收益率曲线的研究，分析和预测收益率曲线可能发生的形状变化。本基金除考虑系统性的利率风险对收益率曲线形状的影响外，还将考虑债券市场微观因素对收益率曲线的影响，如历史期限结构、新债发行、回购及市场折借利率等，进而形成一定阶段内收益率曲线变化趋势的预期，适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合，并进行动态调整。
（3）信用债投资策略
信用债的收益率是在基准收益率基础上加上反映信用风险收益的信用利差。基准收益率主要受宏观经济和政策环境的影响，信用利差的影响因素包括信用债市场整体的信用利差水平和债券发行主体自身的信用变化。基于这两方面的因素，本基金将分别采用以下的分析策略：
1）基于信用利差曲线策略
分析宏观经济周期、国家政策、信用债市场容量、市场结构、流动性、信用利差的历史统计区间等因素，进而判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险，以及信用利差曲线的未来趋势，确定信用债券的配置。
2）基于信用债信用分析策略
本基金将以内部信用评级为主、外部信用评级为辅，研究债券发行主体的基本面，以确定债券的违约风险和合理的信用利差水平，判断债券的投资价值。本基金将重点分析债券发行人所处行业的发展前景、市场竞争地位、财务质量（包括资产负债水平、资产变现能力、偿债能力、运营效率以及现金流质量）等要素，综合评价其信用等级，谨慎选择债券发行人基本面良好、债券条款优惠的信用类债券进行投资。
（4）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。
（5）中小企业私募债投资策略
基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，其中，投资决策流程和风险控制制度需经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。
本基金对中小企业私募债的投资主要从自上而下判断景气周期和自下而上精选标的两个角度出发，结合信用分析和信用评估进行，同时通过有纪律的风险监控实现对投资组合风险的有效管理。本基金将对债券发行人所在行业的发展前景、公司竞争优势、财务质量及预测、公司治理、营运风险、再融资风险等指标进行定性定量分析，确定债券发行人的信用评分。为了提高对私募债券的投资效率，严格控制投资的信用风险，在个券甄选方面，本基金将通过信用调查方案对债券发行主体的信用状况进行分析。
（6）证券公司短期公司债券投资策略
本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。
3、股票投资策略
本基金将采用自下而上的分析方法，以企业基本面研究为核心，并结合股票价值评估，精选具有较强竞争优势且估值合理的股票构建投资组合。
本基金将采取一定的新股投资策略，全面深入地把握上市公司基本面，运用公司研究平台和股票估值体系，综合考虑未来成长性、盈利能力、所处行业前景等因素，深入发掘新股内在价值，结合市场估值水平和股市投资环境，估计新股上市交易的合理价格，选择合适标的参与新股投资。
基本面分析上，本基金首先将运用定量的方法，对公司财务状况、盈利质量、成长能力等方面进行综合评估，选择财务健康、成长性好的公司。其次，本基金将从公司商业模式、创新能力、成本控制、公司治理等多方面评估公司的竞争力和成长性，重点关注具有以下竞争优势的优质上市公司：①主营业务突出，盈利能力强，未来盈利具有可持续性；②在管理、品牌、资源、技术、创新能力中的某一方面或多个方面具有竞争对手在短时间内难以模仿的优势；③产品或服务具有足够的市场容量与规模，良好的市场品牌形象，市场份额领先；④公司治理结构规范，管理能力强。
估值方法上，本基金将根据上市公司所处行业、业务模式以及公司发展中所处的不同阶段等特征，选择合适的股票估值方法，可供选择的估值方法包括市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市盈率－长期成长法（PEG）、折现现金流法（DCF）等估值方法对公司的估值水平进行分析比较，筛选出估值合理或具有吸引力的公司进行投资。
4、股指期货投资策略
本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。
基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。
5、股票期权投资策略
本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股指期权定价模型，选择估值合理的期权合约。
基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，按照有关要求做好人员培训工作，确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。
6、资产支持证券投资策略
本基金综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量等因素，主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估，在严格控制风险的情况下，