上投摩根智选30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：2013年3月6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. 基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整；
2. 招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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；
3. 投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应当认真阅读招募说明书；
4. 基金的过往业绩并不预示其未来表现；
5. 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。
5. 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。
6. 本招募说明书所载内容截止日为2018年9月5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。

二〇一八年十月

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：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、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
孟亮先生自2005年9月至2010年4月在上投摩根基金管理有限公司担任研究员，2010年4月至2015年3月在国投瑞银基金管理有限公司担任研究员、基金经理、基金投资部副总监，自2015年3月起加入上投摩根基金管理有限公司，现担任我司国内权益投资一部副总监兼高级基金经理一职。自2015年9月起担任上投摩根智选30混合型证券投资基金基金经理，自2016年4月起同时担任上投摩根中国优势证券投资基金基金经理，自2016年10月起同时担任上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年4月起同时担任上投摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
本基金历任基金经理杜猛先生，其任职日期为2013年3月6日至2015年9月29日。历任基金经理帅虎先生，其任职日期为2014年12月30日至2016年3月18日。
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、基金托管人概况
（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：周慕冰
客户服务电话：95599
网址：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：陈四清
客服电话：95566
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
法人代表：李建红
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：彭纯
客户服务热线：95559
网址：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：高国富
客户服务热线：95528
网址：www.spdb.com.cn
(8) 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
客户服务热线：021-962888
网址：www.bankofshanghai.com
(9) 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：www.citicbank.com
(10) 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
(11) 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：冀光恒
门户网站：www.srcb.com
客户服务电话：021-962999
(12) 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
(13) 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：李琦
客户服务电话：400-800-0562
网址：www.hysec.com
(14) 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
(15) 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
(16) 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
(17) 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
(18) 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
(19) 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
(20) 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
(21) 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
(22) 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
(23) 华泰证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场
法定代表人：周易
客户咨询电话：95597
网址：www.htsc.com.cn
(24) 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
(25) 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
(26) 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
客户服务热线：0591-96326
公司网址：www.hfzq.com.cn
(27) 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
(28) 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
(29) 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
(30) 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
(31) 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
(32) 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
(33) 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
(34) 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
(35) 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 www.jjmmw.com
(36) 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
公司网址：www.fund123.cn
(37) 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
客户服务电话：400-1818-188
网址： www.1234567.com.cn
(38) 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
(39) 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
网址：www.leadbank.com.cn
(40) 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
网址：www.lufunds.com
(41) 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
网址： www.hongdianfund.com
(42) 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
网址：www.yingmi.cn
(43) 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/
(44) 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
网址：www.xincai.com
(45) 北京肯特瑞基金销售有限公司
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/
(46) 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
(47) 奕丰基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人：TEO WEE HOWE
客服电话：0755-89460500
网址：www.ifastps.com.cn
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：张兰、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：薛竞、沈兆杰
四、基金概况
基金名称：上投摩根智选30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：

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）	每笔人民币1,000 元

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
小于七日	1.5%
大于等于七日，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%
三年以上（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
本基金主要投资于受益于国家经济转型，具有较高增长潜力的上市公司股票，在有效控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
（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）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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（但须符合中国证监会相关规定）。
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。
基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的60%-95%，其中投资于基金持仓比例最高的前30只股票的资产不低于股票资产的85%；其余资产投资于债券、货币市场工具、权证、资产支持证券等金融工具；权证投资占基金资产净值的0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持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%。
（三）投资策略
1、资产配置策略
本基金将从宏观层面出发，采用定量分析和定性分析相结合的手段，对宏观经济环境、宏观经济政策、产业政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行综合分析，结合股票、债券等各类资产风险收益特征，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。本基金将根据各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整确定基金资产在各类资产间的分配比例，动态优化投资组合，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。
2、股票投资策略
从长期来看，盈利的增长是推动公司股价上涨的重要因素。本基金将集中投资于具有良好业绩支撑和确定性成长的公司，以分享其股价上涨带来的收益。从具体操作上，本基金将通过严格的个股精选，筛选出具有较高竞争优势和成长能力的上市公司，并从中挑选出基金管理人认定的最具投资价值的30只左右的股票构建投资组合，以实现对优质股票的集中持股。
本基金将主要采用“自下而上”的方法，基于对上市公司的业绩质量、成长性和估值水平的综合衡量，精选中长期持续增长且估值合理的绩优股票。同时也将结合“自上而下”的行业分析，根据宏观经济环境、国家产业政策、上下游行业运行态势的分析评估企业发展的外部环境，以最低的组合风险精选股票投资组合。
（1）财务指标筛选
本基金将首先采用定量的方法分析公司的财务指标，考察上市公司的盈利能力、盈利质量、成长能力、运营能力以及负债水平等方面，初步筛选出财务健康、成长性良好的优质股票，作为本基金的备选池。具体的分析指标如下：

盈利能力	ROE，ROA，毛利率，EBITDA/主营业务收入
盈利质量	企业自由现金流量，主营业务收入现金流量
成长能力	主营业务收入增长率，净利润增长率，EPS
运营能力	资产周转率，流动比率
负债水平	资产负债率

（2）多元价值评估
针对备选池股票，本基金将进一步通过对上市公司翔实的案头分析和深入的实地调研，从多个角度对公司投资价值进行综合分析，从而优选出具有良好成长潜力的上市公司。对于上市公司的价值评估将分别从企业外部环境和企业内部因素两个方面展开。
1）企业外部环境分析
公司所处的行业的市场规模在很大程度上决定了企业成长的速度和空间，足够大的市场才能支撑企业的长期持续成长。本基金将重点分析企业所处行业的发展前景，通过对宏观经济发展阶段、国家产业政策、上下游产品供求状况、行业技术发展趋势等因素的综合分析，预测行业发展的趋势，形成对行业未来发展空间的判断。此外，本基金将结合对行业内部竞争格局的分析，优选行业发展趋势良好，在行业内处于垄断地位或寡头地位或是具有明显竞争优势的公司。
2）企业内部因素分析
●发展战略
本基金将考察公司的战略目标及产业布局是否符合产业的发展方向和国家产业政策，从而支持公司的持续高速成长。本基金将重点关注公司发展战略符合居民需求变化趋势、产业发展方向、经济转型方向和国家产业政策的上市公司。
●创新能力
本基金主要关注企业的创新能力，具备创新能力的企业通过产品、技术和服务层面的创新可以有效保持其核心竞争力，并增强企业盈利的可持续性，从而确保企业在比较长的时间内独享创新所带来的超额利润，以实现企业成长的可持续性。对于高新科技行业内的上市公司，本基金将重点观察公司是否具备持续的技术升级与创新能力，以保持其在行业内的技术领先地位，维持企业的长期成长；对于消费服务行业内的上市公司，本基金将重点观察公司是否能够敏锐的感受到消费者需求的转变或是能够有效的引导消费者的需求，不断开发新产品与服务，从而维持、扩大市场占有率，获得持续的业绩增长。
●商业模式
领先的商业模式有助于建立并维持企业的核心竞争力，独特的商业模式使竞争对手难以模仿避免恶性竞争，从而使得企业能够以超越行业平均水平的速度成长。本基金将对上市公司的商业模式进行研究，分析其商业模式侧重的核心要素和针对的公司运营环节。本基金将重点分析公司的商业模式能否有效整合内外各要素，形成高效、完整、具有独特核心竞争力的运行系统，并达成持续盈利的目标。
●公司治理结构
公司治理结构是决定公司评估价值的重要因素，也是决定公司盈利能力能否持续的重要因素。本基金将着力于分析上市公司的治理结构、管理层素质及其经营决策能力、投资效率等方面，判断公司是否具备保持长期竞争优势的能力。
（3）估值优化
为了避免投资于估值过高的公司股票，本基金将结合上市公司所处行业、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）、企业价值/销售收入(EV/SALES)、企业价值/息税折旧摊销前利润法（EV/EBITDA）、自由现金流贴现模型（FCFF，FCFE）或股利贴现模型（DDM）等。通过不同的估值方法对公司的内在价值进行评估，筛选出估值合理或具有吸引力的公司进行投资。
经过以上几个步骤筛选的股票将进入本基金的核心股票池，本基金将根据对核心股票池个股价值的评估和市场机会的判断选择30只左右的股票构建股票投资组合，前30大重仓股票的投资比例不低于股票资产的85%。
3、固定收益类投资策略
对于固定收益类资产的选择，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管理，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：本基金通过紧密关注申购/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，寻求其合理的估值水平，谨慎投资，以追求较稳定的当期收益。
6、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。
（四）投资限制
1、组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制：
（1）股票等权益类资产占基金资产的60%-95%，其中投资于基金持仓比例最高的前30只股票的资产不低于股票资产的85%；
（2）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%；
（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）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
（5）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%；
（6）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%；
（7）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%；
（8）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%；
（9）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%；
（10）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%；
（11）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；
（12）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；
（13） 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%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1 年，债券回购到期后不得展期；
（14）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；
（15）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；
（16）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；
（17）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；
本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；
（18）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的60%-95%；
（19）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；
（20）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。
（21）法律法规、监管部门或基金合同规定的其他比例限制。
因证券、期货市场波动、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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。
如果法律法规对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。
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。
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。
（五）业绩比较基准
沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
沪深 300指数是中证指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的300只 A股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。
本基金是混合型基金，基金在运作过程中将维持60%-95%的权益类资产，其余资产投资于债券及其他具有高流动性的短期金融工具。本基金将业绩比较基准中股票指数与债券指数的权重确定为80%和20%，并用上证国债指数收益率代表债券资产收益率。因此，“沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%”是衡量本基金投资业绩的理想基准。
如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，或者是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。
（六）风险收益特征
本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高预期收益的基金产品。本基金风险收益特征会定期评估并在公司网站发布，请投资者关注。
（七）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。
（八）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。
（九）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	345,071,706.02	82.28
	其中：股票	345,071,706.02	82.28
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	73,754,219.84	17.59
7	其他各项资产	536,081.61	0.13
8	合计	419,362,007.47	100.00

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	-	-
C	制造业	324,959,270.93	80.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	319,516.60	0.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,870,026.88	1.71
J	金融业	-	-
K	房地产业	6,475,857.97	1.61
L	租赁和商务服务业	6,286,416.00	1.57
M	科学研究和技术服务业	79,391.50	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.02
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	345,071,706.02	85.94

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	002236	大华股份	1,556,353	35,095,760.15	8.74
2	002456	欧菲科技	2,142,683	34,561,476.79	8.61
3	002466	天齐锂业	694,241	34,427,411.19	8.57
4	300136	信维通信	1,065,075	32,729,754.75	8.15
5	603799	华友钴业	323,877	31,568,291.19	7.86
6	002008	大族激光	394,392	20,977,710.48	5.22
7	300003	乐普医疗	481,991	17,679,429.88	4.40
8	000661	长春高新	68,545	15,607,696.50	3.89
9	002507	涪陵榨菜	450,697	11,573,898.96	2.88
10	002304	洋河股份	81,972	10,787,515.20	2.69

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序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
8. 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。
9.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。
10. 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。
11.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	274,820.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,326.53
5	应收申购款	246,934.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	536,081.61

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。
七、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-2013/12/31	15.50%	1.51%	-8.51%	1.07%	24.01%	0.44%
2014/1/1-2014/12/31	-6.23%	1.36%	42.21%	0.97%	-48.44%	0.39%
2015/1/1-2015/12/31	68.88%	3.00%	5.68%	1.99%	63.20%	1.01%
2016/1/1-2016/12/31	-18.04%	1.99%	-8.35%	1.12%	-9.69%	0.87%
2017/1/1-2017/12/31	32.02%	1.30%	17.55%	0.51%	14.47%	0.79%
2018/1/1-2018/6/30	-14.15%	1.81%	-9.75%	0.92%	-4.40%	0.89%

八、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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、按照国家有关规定和《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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×1.5%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。
2、基金托管人的托管费
本基金的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×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
基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。
上述“一、基金费用的种类中第3－7项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
（三）不列入基金费用的项目
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、其他根据相关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）基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。
（五）基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。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。
九、招募说明书更新部分说明
本基金于2013年3月6日成立，至2018年9月5日运作满五年半。现依据《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2018年4月19日公告的《上投摩根智选30混合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2018年9月5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；
2. 在“三、基金管理人”的“基金管理人概况”的“主要人员情况”中，对董事、监事以及投资决策委员会等信息进行了更新。
3. 在“二、释义”中，根据基金合同的修改内容相应修改了招募说明书相关释义；
4. 在“三、基金管理人”的“主要人员情况”中，对董事、监事、基金经理、其他高级管理人员及投资决策委员会人员等信息进行了更新。
5. 在“五、相关服务机构”中，对代销机构的信息进行了更新。
6. 在“七、基金的申购、赎回和转换”中，根据基金的合同的修改内容相应修改了招募说明书对应部分。
7. 在“八、基金的投资”的中，根据基金合同的修改内容对投资范围和投资限制进行相应修改；在“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。
8. 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。
9. 在“十一、基金的估值”中，根据基金合同的修改对暂停估值的情况进行了更新；
10. 在“十五、基金的信息披露”中，根据基金合同的修改对定期报告和临时报告的披露内容进行了修改；
11. “十八、基金合同的内容摘要”及“十九、托管协议的内容摘要”相应修改；
12. 在“二十二、其他应披露事项”章节，对本披露期内的重大事项进行了披露。

2018年10月20日

关于以通讯开会方式召开上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告

一、召开会议基本情况
根据《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》和《上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人上投摩根基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）决定以通讯开会方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议具体安排如下：
1、会议召开方式：通讯开会方式。
2、表决票收取时间：自2018年10月22日起，至2018年11月19日止（以收到表决票的时间为准）
二、会议审议事项
《关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》（见附件一）。
上述议案的内容说明见《关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案说明》（见附件二）
三、权益登记日
本次大会的权益登记日为2018年10月22日，即在该日下午交易时间结束后，在上投摩根基金管理有限公司登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参与本次会议的表决。
四、表决票的填写和寄交方式
1、本次会议表决票，样本见附件三。基金份额持有人可剪报、复印或登陆本基金管理人网站（www.cifm.com）下载表决票。
2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：
（1）个人持有人自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件复印件；
（2）机构持有人自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件正反面复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；
（3）个人持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供持有人身份证件复印件，以及填妥的授权委托书原件（参照附件四）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；
（4）机构持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供持有人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（参照附件四）；合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。
3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件于前述表决票收取时间内（以收到时间为准），通过专人送交或邮寄的方式，提交给本基金管理人（专人送达的以实际递交时间为准；通过邮寄方式提交的，以收件日邮戳时间为准）。
基金份额持有人可将填妥的表决票和所需的相关文件邮寄至基金管理人，具体地址和联系方式为：
地址：上海市浦东新区福山路455号全华信息大厦4楼
联系人：上投摩根基金管理有限公司客户服务部
联系电话：400 889 4888，(021)38794888
邮政编码：200122
请在信封表面注明：“上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。
五、计票
1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国建设银行股份有限公司）派出的一名授权代表的监督下在表决截止日期后2个工作日内统计全部有效表决票，并由公证机构对其计票过程予以公证并形成决议。
2、基金份额持有人所持的每份基金份额有一票表决权。
3、表决票效力的认定如下：
（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。
（2）如多选或表决意见空白的表决票，或表决票上的表决意见模糊不清或相互矛盾的，其他要件均符合本会议通知的规定，则视为弃权表决，但其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。
（3）如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。
（4）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：
①送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；
②送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；
③送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以收件日邮戳时间为准。
六、决议生效条件
1、如提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所对应的基金份额占本基金在权益登记日基金总份额的50%以上（含50%），则本次通讯开会视为有效；
2、本次议案如经提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所对应的基金份额的三分之二以上（含三分之二）同意，则视为表决通过，形成的大会决议有效；
3、基金份额持有人大会表决通过的事项，将由本基金管理人在自通过之日起5日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。
七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权
根据《基金法》及《基金合同》的规定，本次持有人大会需要出席大会的基金份额持有人或其代理人所代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）。若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于上述规定比例的，基金管理人可以在本次基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，到会者所持有的有效基金份额应不少于权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。
重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人做出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新做出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。
八、本次大会相关机构
1、会议召集人（基金管理人）：上投摩根基金管理有限公司
联系电话：400 889 4888，(021)38794888
电子邮件：services@cifm.com
网站：www.cifm.com
2、基金托管人：中国建设银行股份有限公司
3、公证机构：上海市东方公证处
联系方式：021-62154848
联系人：林奇
4、律师事务所：上海源泰律师事务所刘佳姜亚萍
九、重要提示
1、关于本次议案的说明见附件二。
2、请持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。
3、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话咨询。
4、本通知的有关内容由上投摩根基金管理有限公司负责解释。
5、根据《基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会费用以及会计师费、公证费、律师费等相关费用可从基金资产列支。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一八年十月二十日

附件：
(一) 关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案
(二) 关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案说明
(三) 上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票
(四) 授权委托书
附件一：
关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案
上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金份额持有人：
为更好地满足投资者需求，根据《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》和《上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金管理人经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议召开基金份额持有人大会终止本基金《基金合同》。
终止本基金《基金合同》的具体方案和程序可参见附件二：《关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案说明》。
以上议案，请予审议。

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司
二〇一八年十月二十日

附件二：
关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案说明
一、声明
1、上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）成立于2013年7月18日。为顺应市场环境变化，保护基金份额持有人的利益，上投摩根基金管理有限公司（以下简称“本公司”）依据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议召开基金份额持有人大会终止本基金《基金合同》。
2、本次基金份额持有人大会需由出席会议的符合要求的基金份额持有人或其代理人所持有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）方可召开，且《关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》需经参加本次持有人大会表决的基金份额持有人（或代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）以上通过，存在未能达到开会条件或无法获得相关持有人大会表决通过的可能。
3、基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。
4、中国证监会对持有人大会表决通过的事项所作的任何决定或意见，均不表明其对本基金的价值或者投资人的收益做出实质性判断或保证。
二、方案要点
1、持有人大会决议生效并公告前的基金运作
在通过《关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》的持有人大会决议生效并公告前，本基金仍将按照《基金合同》的约定进行运作。
2、基金财产清算
（1）《关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。基金管理人将自决议生效之日起2个工作日内在指定媒介上公告。
（2）自基金份额持有人大会决议生效并公告后的下一日起，本基金即进入清算程序，基金管理人不再接受持有人提出的份额申购及赎回申请。本基金进入清算程序后，将不再收取基金管理费、托管费和销售服务费。
（3）基金管理人组织基金财产清算组并在中国证监会的监督下进行基金清算。基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。
（4）基金财产清算程序
A.《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
B.对基金财产和债权债务进行清理和确认；
C.对基金财产进行估值和变现；
D.制作清算报告；
E.聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
F.将清算报告报中国证监会备案并公告；
G.对基金财产进行分配
（5）清算费用
清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。按照《基金合同》的规定，清算费用应由基金财产清算组优先从基金财产中支付。
（6）基金财产清算剩余资产的分配
本基金基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。
3、持有人大会决议生效并公告后的相关安排
基金管理人将在基金财产清算完毕后将清算结果报中国证监会备案并予以公告，对基金财产进行分配。
三、终止《基金合同》的可行性
1、法律层面
本基金《基金合同》“第十九部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中约定：基金份额持有人大会决定终止的，本基金合同应当终止。同时，根据《基金合同》“第八部分基金份额持有人大会”约定，终止基金合同需召开基金份额持有人大会，且参加大会的基金份额持有人或其代理人所代表的基金份额需占权益登记日基金总份额的50%以上。由于终止基金合同事宜应当以特别决议通过，因此经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过后，决议方可生效。
2、技术运作方面
为了保障本基金持有人大会的顺利召开及后续工作的进行，公司将成立专项小组筹备持有人大会事宜，并与会计师事务所、律师事务所、公证机构、投资者等进行沟通，确保持有人大会的顺利进行。
基金持有人大会决议生效并公告后，基金将进入清算程序，并依据《基金合同》约定成立财产清算组，成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。清算报告将由会计师事务所进行外部审计，律师事务所出具法律意见书，报中国证监会备案并公告。
四、终止《基金合同》的主要风险及预备措施
1、基金议案被份额持有人大会否决的风险
在设计方案之前，基金管理人已对基金份额持有人进行了走访，认真听取了持有人意见，拟定议案综合考虑了持有人的要求。议案公告后，基金管理人还将再次征询意见。如有必要，基金管理人将根据持有人意见，对终止《基金合同》的方案和程序进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，预留出足够的时间，以做推迟基金份额持有人大会的召开的充分准备。
如果本终止方案未获得持有人大会批准，基金管理人计划按照有关规定重新向持有人大会提交议案。
2、持有人集中赎回基金份额的风险
在本基金召开基金份额持有人大会公告发布后，部分基金持有人可能选择提前赎回其持有的基金份额。
在本基金进入清算程序前，持有人申请赎回其持有的基金份额仍需按照《基金合同》约定的方式进行。如发生《基金合同》中约定的巨额赎回或可以暂停赎回的情形，基金管理人将根据基金投资组合的实际情况决定全部赎回或部分延期赎回或暂停。同时，基金管理人也将提前做好流动性安排，对资产进行变现以应对可能的赎回。
附件三：
上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人名称：			
证件号码（身份证件号／统一社会信用代码）	基金账号		
审议事项	同意	反对	弃权
关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案			
基金份额持有人／代理人签名或盖章 年月日			
说明： 请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。多选或表决意见空白，或表决票上的表决意见模糊不清或相互矛盾的，其他要件均符合本会议通知的规定，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，将视为无效表决。			

附件四：
授权委托书
兹委托先生／女士/公司代表本人（或本机构）参加投票截止日为年月日的以通讯方式召开的上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。
若上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。
委托人（签字/盖章）：
委托人身份证号或统一社会信用代码：
委托人基金账户号：
受托人签字/盖章：
受托人身份证号或统一社会信用代码：

委托日期：年月日

附注：
（1）本授权委托书中“委托人证件号码”，仅指基金份额持有人在开立基金账户时所使用的证件号码或该证件号码的更新。
（2）“基金账户号”处空白、多填、错填、无法识别等情况的，不影响授权效力，将被默认为代表持有人所持有的本基金所有份额。
（3）本授权委托书剪报、复印或按以上格式和内容自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

基金份额持有人名称：			
证件号码（身份证件号／统一社会信用代码）	基金账号		
审议事项（请在表决意见下打钩）	同意	反对	弃权
关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案			
基金份额持有人／代理人签名或盖章 年月日			
说明： 请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。多选或表决意见空白，或表决票上的表决意见模糊不清或相互矛盾的，其他要件均符合本会议通知的规定，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，将视为无效表决。			