上投摩根强化回报债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

基金合同生效日期:2011年8月10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,投资人申购基金时应当认真阅读招募说明书;
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。
4. 本招募说明书摘要所载内容截止日为2019年2月9日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2018年12月31日。

二零一九年三月

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:Daniel J. Watkins
学士学位。
曾任欧洲业务副首席执行官、摩根资产欧洲业务首席运营官、全球投资管理运营总监、欧洲运营总监、欧洲注册登记业务总监、卢森堡运营总监、欧洲注册登记业务及伦敦投资运营经理、富林明投资运营团队经理等职务。
现任摩根资产管理亚洲业务首席执行官、资产管理运营委员会成员、集团亚太管理团队成员。
董事:王大智
学士学位。
曾任摩根资产管理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:戴立宇
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,东吳大学法学院副教授。
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
基金经理, 唐鹏女士, 英国爱丁堡大学硕士,2008年2月至2010年4月任JPMorgan(EMEA)分析师,2011年3月加入上投摩根基金管理有限公司,先后担任研究员及基金经理助理,自2015年5月至2019年1月担任上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金基金经理,自2015年12月起担任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理,自2015年12月至2018年11月担任上投摩根轮动添利债券型证券投资基金基金经理, 自2016年5月起同时担任上投摩根双债增利债券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分红添利债券型证券投资基金及上投摩根纯债添利债券型证券投资基金基金经理,2016年8月至2018年12月担任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丰回报混合型证券投资基金基金经理,2017年1月至2018年12月担任上投摩根安泽回报混合型证券投资基金基金经理, 自2018年2月起同时担任上投摩根安隆回报混合型证券投资基金基金经理,2018年2月至9月担任上投摩根安腾回报混合型证券投资基金基金经理。
基金经理,刘阳女士, 自2011年5月至2012年6月在申银万国证券研究所担任分析师,2012年6月至2013年5月在广发证券研发中心担任高级分析师,2013年6月起加入上投摩根基金管理有限公司, 历任投资经理助理兼研究员、投资经理;自2015年12月至2017年8月担任上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金, 自2015年12月起担任上投摩根双债增利债券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纯债添利债券型证券投资基金基金经理,自2016年12月至2019年1月同时担任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理及上投摩根岁岁盈定期开放债券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岁岁金定期开放债券型证券投资基金基金经理,自2017年11月起同时担任上投摩根丰瑞债券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岁岁益定期开放债券型证券投资基金基金经理。
本基金的历任基金经理为赵峰先生,任职时间为2011年9月8日起至2014年12月1日;历任基金经理杨成先生,任职时间为2014年8月10日起至2015年4月22日;历任基金经理马毅先生,任职时间为2015年4月22日至2015年12月23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)。
2018年6月末,本集团资产总额228,051.82亿元,较上年末增加6,807.99亿元,增幅3.08%。上半年,本集团盈利平稳增长,利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元,增幅5.42%;净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.65亿元,增幅6.08%。
2017年,本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017年中国最佳银行”,美国《环球金融》“2017最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017年中国最佳数字银行”、“2017年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》“2017最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017全球银行1000强”中列第2位;在美国《财富》“2017年世界500强排行榜”中列第28名。
中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合与合规管理处、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,在安徽合肥设有托管运营中心,在上海设有托管运营中心上海分中心,共有员工315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、投信托管业务部、投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,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),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。
黄秀莲,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),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。
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。
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2018年二季度末,中国建设银行已托管857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。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”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”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。
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
(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) 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) 中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
24小时客户服务热线: 95568
网址:www.cmbc.com.cn
(11) 华夏银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街22号
办公地址:北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人:吴建
客户咨询电话:95577
网址:www.hxb.com.cn
(12) 北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址:北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人:张东宁
客户服务电话:95526
公司网站:www.bankofbeijing.com.cn
(13) 宁波银行股份有限公司
注册地址:宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人:陆华裕
客户服务统一咨询电话:96528(上海、北京地区962528)
网址:www.nbcb.com.cn
(14) 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
(15) 东莞农村商业银行股份有限公司
注册地址:东莞市南城路2号
办公地址:东莞市南城路2号
法定代表人:何沛良
客服电话:961122
网址:www.drcbank.com
(16) 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
(17) 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
(18) 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
(19) 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
(20) 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
(21) 广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址: 广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点
公司网站:http://www.gf.com.cn
(22) 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
(23) 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
(24) 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
(25) 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
(26) 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
(27) 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
(28) 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:王少华
客户服务电话:4008188118
网址:www.guodu.com
(29) 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
(30) 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
(31) 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
(32) 东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:潘鑫军
客户服务热线:95503
东方证券网站:www.dfzq.com.cn
(33) 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
(34) 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
(35) 中国国际金融有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:金立群
公司网址:www.cicc.com.cn
电话:021-58881690
(36) 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
(37) 上海华信证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号 环球金融中心9楼
法定代表人:罗浩
客户服务电话:68777877
公司网站:www.shhxzq.com
(38) 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
(39) 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
(40) 东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:赵俊
客户服务电话:95531;4008888588
公司网站:www.longone.com.cn
(41) 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
(42) 上海长量基金销售有限公司
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
(43) 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
(44) 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
(45) 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
(46) 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
(47) 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
(48) 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.jmmw.com
(49) 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五常街道文一西路969号3幢5层599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:祖国明
客服电话:400-0766-123
公司网站:www.fund123.cn
(50) 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
(51) 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
(52) 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
(53) 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
(54) 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
(55) 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/
(56) 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
(57) 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/
(58) 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
(59) 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:国浩律师集团(上海)事务所
注册地址:上海市南京西路580号南证大厦45楼
负责人:倪俊骥
联系电话:021-52341668
传真:021-52341670
经办律师:宣伟华
(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:上投摩根强化回报债券型证券投资基金
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	0.8%
人民币100万以上(含),500万以下	0.4%
人民币500万以上(含)	每笔人民币1,000 元

B类基金份额的申购费率为0
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类基金份额赎回费率

持有基金份额期限	费率
小于七天	1.5%
大于等于七天小于一年	0.1%
大于等于一年小于二年	0.05%
大于等于二年	0

B类基金份额赎回费率

持有基金份额限制	费率
小于七天	1.5%
大于等于七天小于三十天	0.1%
大于等于三十天	0

3、基金转换
基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记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本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
本基金在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上,通过主动管理,力争获得超越业绩比较基准的投资收益率,实现基金资产的长期稳定增值。
(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,包括股票(包含中小板、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的相关规定。
本基金主要投资于国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购等固定收益品种。本基金可以参与一级市场新股申购或增发新股,以及在二级市场上投资股票、权证等权益类资产。
本基金的投资组合比例为:债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%;股票、权证等权益类品种投资比例不超过基金资产的20%。本基金持有的全部权证市值不超过基金资产净值的3%, 并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。
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
本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,对股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的20%。本基金将遵循自上而下的配置原则,以宏观经济分析和政策分析为基础,根据对宏观经济运行趋势、国家财政政策与货币政策、市场流动性水平、债券市场和股票市场估值水平等因素的综合分析,对各大类资产的预期风险和收益进行动态评估,从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例,并跟踪影响资产配置策略的各种因素的变化,对大类资产配置比例进行动态优化管理。
本基金将通过对固定收益类金融工具的主动管理, 力争获取稳定的债券投资收益。此外,本基金将根据对股票市场的趋势研判及新股(增发)申购收益率的预测,适度参与一级市场和二级市场的股票投资,在严格控制风险的前提下,力求提高基金的整体收益率。
2、债券投资策略
本基金将采用积极主动的债券投资策略,以中长期利率分析为核心,结合宏观经济周期、宏观政策方向、收益率曲线形态、债券市场供求关系等分析,实施积极的债券投资组合管理。在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。
(1)债券类资产配置策略
1)久期调整策略
本基金将基于对市场利率的变化趋势的预判,相应的调整债券组合的久期。本基金通过对影响债券投资的宏观经济变量和宏观经济政策等因素的综合分析,预测未来的市场利率的变动趋势,判断债券市场对上述因素及其变化的反应,并据此积极调整债券组合的久期。在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益,在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。
2)收益率曲线策略
在确定债券组合的久期后, 本基金主要采用收益率曲线策略决定组合的期限结构配置。收益率曲线策略,即通过考察市场收益率曲线的动态变化及预期变化,寻求在一段时期内获取因收益率曲线形状变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益的策略。
本基金将对债券市场收益率期限结构进行分析, 预测收益率期限结构的变化方式,根据收益率曲线形态变化确定合理的组合期限结构,包括采用子弹策略、哑铃策略和梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,以从长期、中期和短期债券的相对价格变化中获利。
3)类属配置策略
本基金根据市场和类属资产的信用水平, 在判断各类属的利率期限结构与国债利率期限结构应具有的合理利差水平基础上,将市场细分为交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债等子市场。结合各类属资产的市场容量、信用等级和流动性特点,运用修正的均值-方差等模型,对投资组合类属资产进行最优化配置和调整,确定类属资产的最优权重。
(2)个券选择
在确定债券组合久期、期限结构和类属配置的基础上,本基金对影响个别债券定价的主要因素,包括流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、税赋、含权等因素进行分析,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。
对于企业债、短期融资券等信用类债券,本基金将运用内部信用评估体系,对债券发行人以及债券的信用风险进行度量,进而确定信用风险利差。通过对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断,选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债券进行投资。
(3)动态增强策略
在以上债券投资策略的基础上,本基金还将根据债券市场的动态变化,运用骑乘收益率曲线策略、息差策略和互换策略,进行适当的主动投资,以提高债券组合的收益。
1)骑乘收益率曲线策略
在预期未来收益率曲线变动较为平稳的情况下, 通过分析收益率曲线各期限段的利差情况,本基金可以买入收益率曲线最突起部位所在剩余期限的债券,这一期限的收益率水平此时处于相对较高的位置,随着债券剩余期限的缩短,债券的剩余期限将缩短,收益率水平将下降,从而可获得资本利得收益。
2)息差策略
息差策略是指通过不断正回购融资并持续买入债券的操作, 只要回购资金成本低于债券收益率,就可以达到杠杆放大的套利目标。
3)互换策略
债券互换就是同时买入和卖出具有相近特性的两个以上债券品种, 从而获取收益率差的行为。不同债券品种在利息、久期、流动性、税收特性、违约风险和衍生条款等方面的差别,决定了债券互换的可行性和潜在获利可能。
(4)可转换债券的投资策略
可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性