上投摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)招募说明书（更新）摘要

注册文号:中国证监会证监许可[2018]379号文
生效日期:[2018年8月15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
二〇一九年三月

【重要提示】

本基金于【2018】年【3】月【5】日经中国证券监督管理委员会证监许可[2018]379号文注册。

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、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。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。

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。

基金管理人开展基金中基金业务,应当遵循基金份额持有人利益优先原则,制定科学合理的投资管理制度,有效防范和控制风险。

本基金主要投资于公开募集的证券投资基金,基金净值会因为其投资所涉及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,由于基金投资人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。

本基金属于混合型基金中基金,预期风险和收益水平低于股票型基金,高于债券型和货币市场基金,属于较高风险收益水平的基金产品。

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》。

本招募说明书摘要所载内容截止日为2019年2月14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。

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

孟鸣先生,上海外国语大学日本文化经济本科。自2001年6月至2003年7月,在三菱UFJ银行担任职员;自2003年8月至2004年10月,在麦肯光明传播集团担任客户经理;自2004年10月加入埃森哲,2004年10月至2006年8月，由埃森哲派出为美国证券托管清算机构服务,担任金融信息咨询部研究组长;自2006年9月到2015年1月,服务于德意志银行股票研究团队,担任证券研究部部门负责人,其间由于合同关系变更,2013年11月至2015年1月受雇于易唯思商务咨询;自2015年1月起加入上投摩根基金管理有限公司,历任公司高级投资组合经理,现担任资深投资组合经理;自2018年8月起担任上投摩根尚睿混合型基金中基金（FOF）基金经理。

刘凌云女士,自2008年6月至2009年7月,在中海基金管理有限公司担任产品研发经理,负责策略及产品设计;自2009年7月起加入上投摩根基金管理有限公司,历任产品经理、高级投资组合经理、客户投资组合总监、组合基金投资部总监;自2018年8月起担任上投摩根尚睿混合型基金中基金（FOF）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、基金托管人情况

（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、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。具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

(3) 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

(4) 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

(5) 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

(6) 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

(7) 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

(8) 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

(9) 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

(10) 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

(11) 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

(12) 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

(13) 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

(14) 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

(15) 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

(16) 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

(17) 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

(18) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
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

(19) 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

(20) 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

(21) 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

(22) 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

(23) 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

(24) 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

(25) 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

(26) 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

(27) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
办公地址:浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室
法定代表人:陈柏青
客服电话:400-0766-123
公司网站:www.fund123.cn

(28) 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

(29) 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

(30) 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

(31) 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馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层
办公地址:北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层
法定代表人:郑毓栋
客服电话:400-618-0707
网站:www.hongdianfund.com

(32) 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

(33) 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/

(34) 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

(35) 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
网站:http://fund.jd.com/

(36) 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
网站: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:刘佳、姜亚萍

四、审计基金财产的会计师事务所

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:曹阳
经办注册会计师:陈玲、曹阳

四、基金概况

基金名称:上投摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)
基金类型:基金中基金（FOF）

五、基金的投资

一、投资目标

通过优选基金,并结合严格的风险控制,实现基金资产的长期稳健增值。

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,包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含QDII基金及其他经中国证监会核准或注册的基金）、国内依法发行的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中期票据、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单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）。

本基金将不低于80%的基金资产投资于其他基金份额,股票型、混合型基金和商品基金（均包含QDII）的合计投资比例为基金资产的60-90%,剩余资产将投资于债券型基金和货币市场基金（均包含QDII）,以及债券、资产支持证券、债券回购、银行存款及同业存单等。本基金每个交易日日终应保持现金或到期日在一年期以内的政府债券合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

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

本基金将60-90%的资产配置于预期收益和风险较高的资产类别,如股票型、混合型基金以及商品基金。因此在大部分市场环境下,本产品的风险收益特征将与上述资产类别的走势高度相关,在FOF中属于较高风险收益的产品。

在大类资产配置上,本基金将结合产品定位、风险收益特征以及管理人的长期资本市场观点确定基金的资产配置方案。

首先,管理人将根据基金业绩基准确定产品的风险收益特征。其次,管理人将根据投研团队的长期资本市场观点对各类型资产的风险收益特征进行判断。具体而言,管理人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,评估国内股票及债券、海外股票及债券、大宗商品、另类资产等各资产类别的风险收益特征,并加以分析比较,形成对不同资产类别长期走势的预期。最后,结合本基金以及各资产类别的风险收益特征,依据现代投资组合理论,模拟得出各大类资产的长期战略配置比例。

本基金将密切关注市场风险的变化以及各资产类别的风险收益的相对变化趋势,在业绩比较基准所确定的均衡配置基础上,以收益风险比最大化为原则,通过定性方式适度调整本基金的中长期战略配置比例。原则上,管理人参考公司月度资产配置会议决议对大类资产进行评估,检视大类资产的市场展望和中长期资本市场观点是否发生改变,根据检视情况决定是否进行资产配置的动态再平衡。当资本市场发生重大变化且管理人认为将影响各类资产的预期时，管理人将根据实际情况调整资产配置比例。

2、主动管理型基金投资策略

本基金将综合运用定量分析和定性分析的方式,通过层层筛选,优选能持续创造超额收益的基金构建投资组合。

首先,本基金管理人将通过初步的定量指标筛选出历史业绩表现良好（主要考察绝对收益、超额收益以及同类排名等指标）、规模适中、流动性较好的基金。在基金初步筛选的基础上,进一步通过尽职调查在基金管理公司层面进行考察,了解标的基金公司的基本情况以及综合实力（综合考虑资产管理规模、公司治理、投研体系、风险控制等指标）,通过了解基金的投资流程、风格以及实际运作,形成基金筛选基础池。

其次,结合尽职调查结果以及公开数据,对基金经理进行深度访谈,将定量与定性分析相结合,对基金经理的投资管理能力、投资流程和风格形成结论,筛选后将不同投资风格/策略的代表性基金列入未来基金构建投资组合的核心池。

本基金目前将主要投资于本基金管理人旗下的公募基金,并根据定量及定性分析策略优选标的基金。未来本基金管理人本着审慎尽职的原则,可将投资范围逐步扩展至其他管理人旗下的公募基金,以丰富本基金的投资组合。

（1）定量分析

本基金对标的基金的业绩表现、基金规模、流动性状况进行定量分析,选择成立时间较长或有较长的可回溯历史业绩、历史业绩表现相对良好的基金。主要关注以下几个定量指标:最新基金规模;不同市场环境下的历史业绩表现,包括超额收益、夏普比率等;基金经理管理标的基金的年限;标的基金的投资者分布情况等。

例如,针对基金的业绩考察,原则上关注基金在中长期创造超额收益（阿尔法）的能力,降低短期超额收益在选择中的比重;若某基金长期超额收益为正,但是其短期超额收益出现负值,则应对该基金进行分析,确定其短期超额收益为负的原因;同时还会根据公开信息对业绩进行归因分析（若为股票型基金应包括资产配置、行业配置、个股选择、交易贡献等因子;若为债券型基金,则应重点关注票息收益、已实现资本利得、未实现资本利得等因子）,并与该基金核心投资流程及投资策略进行对应分析,以确定该基金投资运作是否与其核心投资流程及投资策略相符。

另外,结合基金的运作和市场的表现,根据基金经理的风险偏好、价值/成长、市值/流动性、贝塔/波动率、换手率/集中度等不同的指标和纬度,可以对基金的风格进行更明晰的划分,在不同的市场环境中针对性地选择基金。

（2）定性分析

在此基础上,本基金将通过对基金公司的股东背景、投研能力综合排名、基金经理的稳定性、基金投资风格、基金的业绩归因分析和基金经理的风险控制能力等方面的综合定性分析,进一步筛选出公司综合实力较强、投研团队稳定、投资风格一致的基金。

（3）尽职调查

本基金将通过对每只备选基金进行电话会议、正式拜访等方式,在充分了解基金管理公司、基金产品和投资团队的基础上,最终选择投研实力突出、风险内控制度完备和预期表现佳的基金。主要关注以下几个方面:

1）基金公司:公司历史、股东结构、产品种类、竞争优势、主要客户和是否发生过风险事件或法律诉讼等。

2）投研体系:投资决策机制、投研团队的构成、基金经理和研究人员的权责划分、考核指标和激励制度、信息来源和独立研究机构和卖方机构研究支持等。

3）基金经理:投资理念、组合构建流程、投资风格、稳定性、从业经验等。

4）风险控制:公司风控体系和风控流程、风险事故汇报路径和重大事件的应急处理方案等。

3、指数基金投资策略

本基金将通过对国内外宏观经济、经济结构转型的方向、国家经济政策、产业政策导向的深入研究,优选中长期景气向好的指数基金进行配置,以增厚组合收益。此外,本基金也将基于对市场未来运行趋势和风格的预判,积极参与包括行业主题、风格或策略指数等在内的各类指数基金的投资,把握市场阶段性投资机会,以获取更高的超额收益。

本基金将通过以下流程筛选指数基金:（1）流动性筛选,主要考察基金规模,辅以日均成交量及换手率等指标:如做市活跃程度,折溢价水平等。（2）积极风险最小化,主要考察指数基金的跟踪误差及跟踪偏离度。（3）总费用率控制,比较并尽量选择总费用率较具竞争力的指数基金品种。

4、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。

5、中小企业私募债投资策略

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。

6、证券公司短期公司债投资策略

本基金将主要从分析证券行业整体情况、证券公司基本面情况入手,包括整个证券行业的发展现状、发展趋势、具体证券公司的经营情况、资产负债情况、现金流情况,从而分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平,对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。

7、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,确定资产合理配置比例,在保证资产安全性的前提条件下,以期获得长期稳定收益。

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）本基金将不低于80%的基金资产投资于其他经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额;

（2）本基金持有单只基金的市值,不高于本基金资产净值的20%,且不得持有其他基金中基金;除ETF联接基金外,本基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金不得超过该基金净资产的20%,该基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准;

（3）本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

（4）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%;

（5）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%；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%;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%;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%;

（6）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;

（7）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;

（8）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%;

因证券市场波动、证券停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

（9）本基金在每个交易日日终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、存出保证金及应收申购款等;

（10）本基金持有的全部中小企业私募债券,其市值不超过基金资产净值的10%;本基金持有一家企业发行的中小企业私募债,不得超过该债券的10%;

（11）本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

（12）本基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额,包括分级基金以及中国证监会认定的其他基金份额;

（13）本基金投资其他基金,被投资基金的运作期限应当不少于1年、最近定期报告披露的规模应当高于1亿元;

（14）本基金投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金的,其市值不得超过基金资产净值的10%;

（15）股票型、混合型基金和商品基金（均包含ODII）合计投资比例为基金资产的60-90%;

（16）货币市场基金投资比例不超过基金资产的5%;

（17）基金管理人运用本基金财产投资于债券等金融工具的,投资品种和比例应当符合本基金的投资目标和投资策略;

（18）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

（19）法律法规和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定投资比例的,除上述第（2）、（6）、（8）、（9）、（18）项外,基金管理人应当在10个交易日内进行调整;因上述因素致使基金投资比例不符合上述第（2）项时,基金管理人应当在20个交易日内进行调整;但中国证监会规定的特殊情形除外。

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。期间,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约