上投摩根核心优选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:2012年11月28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5月27日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2019年3月31日。

二零一九年七月

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:陈氏
总经理:王大智
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%和摩根富林明资产管理(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:陈氏
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、摩根投信董事长暨摩根资产管理集团台湾区负责人。
现任上投摩根基金管理有限公司总经理。
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。
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;同时兼任华泰证券股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、申银万国期货有限责任公司、东海期货有限责任公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。
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:汪棣
美国加州大学洛杉矶分校金融专业工商管理硕士学位,并先后获得美国加州注册会计师执照和中国注册会计师证书。
曾担任普华永道金融服务部合伙人及普华永道中国投资管理行业主管合伙人。
现担任招商证券股份有限公司、复星联合健康保险股份有限公司、亚太财产保险有限公司及51信用卡有限公司独立董事、中国台湾旭昶生物科技股份有限公司监事。
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:
王大智先生,总经理
学士学位。
曾任摩根资产管理香港及中国基金业务总监、摩根投信董事长暨摩根资产管理集团台湾区负责人。
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,孙芳女士,华东师范大学经济学硕士,2003年7月至2006年10月任华宝兴业基金行业研究员;自2006年12月起加入上投摩根基金管理有限公司,先后担任行业专家、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、副总经理兼投资副总监。自2011年12月起担任上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金经理,2012年11月起担任上投摩根核心优选混合型证券投资基金基金经理,2014年2月至2015年7月同时担任上投摩根核心成长股票型证券投资基金基金经理,自2014年12月起同时担任上投摩根行业轮动混合型证券投资基金基金经理。
本基金历任基金经理为李佳嘉女士,任职日期为2015年8月11日至2016年10月28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;黄栋,量化投资部总监兼高级基金经理;张军,投资董事、国际投资部总监、投资绩效评估总监兼高级基金经理;朱晓龙,研究部总监兼基金经理;陈圆明,绝对收益投资部总监兼基金经理;聂曙光,债券投资部总监兼资深基金经理;孟晨波,总经理助理/货币市场投资部总监兼资深基金经理;任翔,投资经理兼固收研究部总监;钟维伦,资深投资经理;刘凌云,组合基金投资部总监兼基金经理;张文峰,组合基金投资部副总监兼投资经理;孟鸣,基金经理兼资深投资组合经理;叶承焘,投资经理;陈晨,投资经理。
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
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:金煜
客户服务热线:95594
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9号
法定代表人:李庆萍
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:洪崎
24小时客户服务热线:95568
网址:www.cmbc.com.cn
(11) 平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人:谢永林
客户服务统一咨询电话:95511转3
网址:www.bank.pingan.com
(12) 上海农村商业银行股份有限公司
地址:中山东二路70号上海农商银行大厦
法定代表人:冀光恒
门户网站:www.srcb.com
客户服务电话:021-962999
(13) 南京银行股份有限公司
办公地址:南京市玄武区中山路288号
法定代表人:胡升荣
客服电话:95302
网站:www.njcb.com.cn
(14) 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
网址: www.swhysc.com
(15) 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
(16) 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.shzq.com
(17) 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
(18) 招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路111号
法定代表人:霍达
客户服务电话:95565
网址:www.newone.com.cn
(19) 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
客服热线:95525
网址:www.ebscn.com
(20) 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2-6层
法定代表人:陈共炎
客服电话: 4008888888
网址:www.chinastock.com.cn
(21) 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
(22) 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
(23) 海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路689号
法定代表人:周杰
客服电话:95553
公司网址:www.htsec.com
(24) 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
(25) 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
(26) 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
(27) 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:张佑君
客户服务热线:95548
公司网址:www.cs.ecitic.com
(28) 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
(29) 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:姜晓林
客户服务电话:95548
公司网址:www.sd.citics.com
(30) 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
(31) 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:95517
公司网址:www.essence.com.cn
(32) 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:李新华
客户服务热线:95579或4008-888-999
长江证券客户服务网站:www.95579.com
(33) 平安证券股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层
办公地址:深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层
法定代表人:何之江
客服电话:95511-8
网址: www.stock.pingan.com
(34) 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
法定代表人:赵俊
客户服务电话:95531;4008888588
公司网站:www.longone.com.cn
(35) 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:上海市杨浦区长阳路1687号2号楼
法定代表人:汪静波
客服电话:400-821-5399
公司网站: www.noah-fund.com
(36) 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:上海市浦东新区东方路1267号陆家嘴金融服务广场二期11层
法定代表人:张跃伟
客服电话:400-820-2899
公司网站: www.erichfund.com
(37) 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11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
(38) 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:毛淮平
客户服务电话:400-817-5666
(39) 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:400-799-1888
网址:www.520fund.com.cn
(40) 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
(41) 星展银行(中国)有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号1301、1801单元
法定代表人:葛甘牛
咨询电话:400-820-8988
网站:www.dbs.com.cn
(42) 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
(43) 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
(44) 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
(45) 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:上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦
法定代表人:其实
客服电话:400-1818-188
网站: www.1234567.com.cn
(46) 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
(47) 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
(48) 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
(49) 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
(50) 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/
(51) 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
(52) 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/
(53) 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
(54) 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:400-684-0500
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:梁丽晶、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:上投摩根核心优选混合型证券投资基金
基金的类别:混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
五、基金份额的申购、赎回和转换
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本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
本基金将充分利用基金管理人研究团队的集体智慧,以内部研究组合作为核心股票,从中优选出具有良好基本面和较高成长性的公司进行投资,力争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:股票资产占基金资产的75%-95%,其中投资于内部研究组合中的股票的资产不低于股票资产的80%;权证投资占基金资产净值的0-3%;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。
(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、国家政策、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,确定合适的资产配置比例。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股票、债券及现金等类别资产间的分配比例,动态优化投资组合。
在控制风险的前提下,本基金将优先配置股票资产,本基金股票资产占基金资产的比例为75%-95%,其中投资于内部研究组合中的股票的资产不低于股票资产的80%
2、股票投资策略
本基金将依托本基金管理人的研究平台,采用“自下而上”的个股精选策略,基于公司内部研究团队对于个股的基本面的深入研究和细致的实地调研,选择具有良好基本面和成长空间的个股。
本基金将研究团队的集体智慧与基金经理的个人能力充分结合,强调研究对于投资的先导作用和支持作用,目标是更有效的将研究成果尤其是内部研究成果转化为基金业绩。本基金的股票投资包含核心股票和优选股票两个层面。核心股票由公司内部研究组合构成,主要包含了研究部推荐股票,是研究员在对个股进行深度研究和实地调研基础上提出的投资建议。优选股票是指基金经理基于对宏观经济、政策、行业以及个股的深入研究与把握,从核心股票中优选具有良好投资价值的股票,构建股票投资组合。
本基金明确提出将不低于80%的股票资产投资于公司内部研究组合中的股票。通过纪律化的投资约束,将研究成果积极转化为投资业绩。内部研究组合的构建主要由研究团队负责,具体而言,研究员采用定性分析与定量分析相结合的分析方法,通过对行业内个股的深入的基本面研究,对上市公司的投资价值进行综合考察,精选出质地优良、具有较强竞争优势的公司,构建内部研究组合。基本面研究由于专注于企业在管理、品牌、资源、技术、创新能力各方面的深入分析,因此可以更加准确地挑选出具有投资价值的公司。
在具体操作上,我们将采用自下而上的个股精选策略,综合运用定量分析与定性分析的手段,对公司基本面进行价值挖掘。
(1)定量分析
定量的方法主要通过对公司财务状况、盈利质量、成长能力、估值水平等方面的综合评估,选择财务健康、成长性好的公司。
①财务状况:评估公司的财务穿越宏观经济和行业的萧条和衰退期的能力,主要考察指标为资产负债率、资产周转率、流动比率等;
②盈利质量: 评估公司持续发展能力, 主要考察近三年平均净资产收益率(ROE)、近三年平均投资资本回报率(ROIC);
③成长能力:评估公司未来发展趋势与发展速度,成长能力是随着市场环境的变化,企业资产规模、盈利能力、市场占有率持续增长的能力,反映了企业未来的发展前景。主要考察指标为净利润增长率、主营业务收入增长率、主营业务利润增长率;
④估值分析:评估公司相对市场和行业的相对投资价值,选择价格低于价值的上市公司,或是比较企业动态市盈率等指标,选择目前估值水平明显较低或估值合理的上市公司,主要考察指标为市盈率(P/E)、市净率(P/B)、PEG、EV/EBITDA等。
(2)定性分析
在定量分析的基础上,本基金将从以下几个方面,对公司基本面做进一步的定性分析,选择具备投资潜力的个股。
①行业地位突出、有市场定价能力。属于行业龙头,具有较高的市场占有率,对产品定价具有较强的影响力。
②具有核心竞争力。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显著优势, 从而能够获得超越行业平均的盈利水平和增长速度。
③主营业务突出,具有良好的盈利能力。主营业务收入占比较高,盈利能力高于行业平均水平,未来盈利具有可持续性。
④公司治理结构规范,管理能力强。已建立合理的公司治理结构和市场化经营机制,管理层对企业未来发展有着明确的方向和清晰的思路。
3、行业配置策略
本基金在精选个股的基础上,对股票投资组合进行适度均衡的行业配置。本基金将对宏观经济发展状况及趋势、行业周期性及景气度、行业相对估值水平等方面进行研究,判断各个行业的相对投资价值。在此基础上,参考整体市场的行业资产分布比例,确定和动态调整各个行业的配置比例。
4、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。
5、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。
6、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。
7、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)股票资产占基