上投摩根稳进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:2015年1月27日
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司

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招募说明书;基金的过往业绩并不预示其未来表现。

2.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。

3.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。

4.本招募说明书摘要所载内容截止日为2015年7月26日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2015年6月30日。

二零一五年九月

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:上海市浦东富城路99号震旦国际大楼20层

办公地址:上海市浦东富城路99号震旦国际大楼20层

法定代表人:陈开元

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:

陈开元先生,董事长

大学本科学历。

先后任职于上海市财政局第三分局,共青团上海市财政局委员会,英国伦敦Coopers & Lybrand咨询公司等,曾任上海市财政局对外经济财务处处长、上海国际集团有限公司副总经理,现任上投摩根基金管理有限公司董事长。

董事:Paul Bateman

毕业于英国Leicester大学。

历任Chase Fleming Asset Management Limited全球总监,摩根资产管理全球投资管理业务CEO。

现任摩根资产管理全球主席、摩根资产管理委员会主席及投资委员会会员。同时也是摩根大通高管委员会资深成员。

董事:许立庆

台湾政治大学工商管理硕士学位。

曾任摩根富林明台湾业务总经理、摩根资产管理亚太区行政总裁。

现任怡和(中国)有限公司主席、怡和管理有限公司董事;香港商会中国委员会副主席;富时台湾交易所台湾系列五十指数咨询委员会主席。

董事:Jed Laskowitz

获美国伊萨卡学院学士学位(主修政治)及布鲁克林法学院荣誉法学博士学位。

曾负责管理J.P Morgan集团的美国基金业务。

现任摩根资产管理亚洲基金行政总裁及亚太区投资管理业务总监;J.P Morgan集团投资管理及环球基金营运委员会成员;美国资金管理协会(MMI)董事会成员;纽约州大律师公会会员。

董事:陈兵

博士研究生,高级经济师。

曾任上海浦东发展银行财富管理部总经理、上海国际信托有限公司副总经理兼董事会秘书。

现任上海国际集团有限公司党委副书记、副董事长、总经理。

董事:胡越

硕士研究生,高级经济师。

曾任上海国际集团有限公司金融管理总部总经理助理。

现任上海国际集团有限公司资本运营部副总经理。

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。

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党委书记、董事长。

董事:章硕麟

获台湾大学商学硕士学位。

曾任怡富证券(台湾)投资顾问股份有限公司协理、摩根大通(台湾)证券副总经理、摩根富林明(台湾)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: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。

历任台湾财政部常务次长。

现任台湾东吴大学法律研究所兼任副教授。

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。

独立董事:刘红忠

国际金融系经济学博士,现任复旦大学国际金融系教授及系主任、中国金融学会理事、中国国际金融学会理事和上海市金融学会理事。

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政策研究所所长。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。

2.监事会成员基本情况:

监事长:郁忠民

研究生毕业,高级经济师。

历任华东政法学院法律系副主任;上海市证券管理办公室稽查处、机构处处长;上海国际集团有限公司投资管理部经理;上海证券有限责任公司副董事长、总经理、党委副书记;上海国际集团金融管理总部总经理。

现任上海国际信托有限公司监事长。

监事:Simon Walls

获伦敦大学帝国理工学院的数学学士学位。

历任JPMorgan Asset Management (Japan) Ltd总裁、首席运营官;JPMorgan Trust Bank总裁、首席运营官以及基础架构总监。

现任摩根资产管理日本董事长以及投资管理亚洲首席行政官。

监事:张军

曾任上投摩根基金管理有限公司交易部总监。

现任上投摩根亚太优势混合型证券投资基金和上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金基金经理。

监事:万隽宸

曾任上海国际集团有限公司高级法务经理。

现任上投摩根基金管理有限公司总经理助理、风险管理及业务协作部总监。

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(台湾)投资顾问股份有限公司协理、摩根大通(台湾)证券副总经理、摩根富林明(台湾)证券股份有限公司董事长。

4.其他高级管理人员情况:

侯明甫先生,副总经理。

毕业于台湾中国文化大学,获企业管理硕士。曾任职于台湾金鼎证券公司、摩根富林明(台湾)证券投资顾问股份有限公司、摩根富林明(台湾)证券股份有限公司、摩根富林明证券投资信托股份有限公司,主要负责证券投资研究、公司管理兼投资相关业务管理。

经晓云女士,副总经理。

获上海财经大学工商管理硕士学位。

历任上海证券有限责任公司总经理办公室副主任(主持工作)、市场管理部经理,经纪管理总部副总经理、总经理,负责证券经纪业务的管理和运作。

陈星德先生,副总经理。

毕业于中国政法大学,获法学博士学位。曾任职于江苏省人大常委会、中国证监会、瑞士银行环球资产管理(香港)、国投瑞银基金管理有限公司,并曾担任上投摩根基金管理有限公司督察长一职。

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。

刘万方先生,督察长。

获经济学博士学位。

曾任职于中国普天信息产业集团公司、美国MBP咨询公司、中国证监会。

5. 本基金基金经理

聂曙光先生, 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。

6. 基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

侯明甫先生,副总经理;杜猛先生,投资一部投资总监;孙芳女士,投资二部投资总监;孟晨波女士,货币市场投资部总监;赵峰先生,债券投资部总监;张军先生,基金经理;黄栋先生,量化投资部总监;吴文哲先生,研究总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)

公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人:牛锡明

住所:上海市浦东新区银城中路188号

办公地址:上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码:200120

注册时间:1987年3月30日

注册资本:742.62亿元

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号

联系人:汤嵩彦

电话:021-95559

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业,成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2005年6月,交通银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2014年《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告,交通银行一级资本位列第19位,跻身全球银行20强;根据《财富》杂志发布的“世界500强公司”排行榜,交通银行位列第217位。2014年荣获《首席财务官》杂志评选的“最佳资产托管奖”。

截至2015年3月31日,交通银行资产总额达到人民币6.63万亿元,实现净利润人民币189.7亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二)主要人员情况

牛锡明先生,董事长、执行董事。

牛先生2013年10月至今任本行董事长、执行董事,2013年5月至2013年10月任本行董事长、执行董事、行长,2009年12月至2013年5月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系,获学士学位,1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业,获硕士学位,1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生,副董事长、执行董事、行长。

彭先生2013年11月起任本行副董事长、执行董事,2013年10月起任本行行长;2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理;2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长;2004年9月至2005年8月任本行副行长;2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理;2001年9月至2004年6月任本行行长助理;1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长,南宁分行行长,广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

刘树军先生,资产托管业务中心总裁。

刘先生2014年4月至今任本行资产托管业务中心总裁,2012年5月至2014年4月任本行资产托管部总经理,2011年10月至2012年5月任本行资产托管部副总经理。2011年10月前历任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书,农行总行信贷部工业信贷处处长,农行总行托管部及养老金中心副总经理,本行内蒙古分行副行长。刘先生为管理学硕士,高级经济师。

(三)基金托管业务经营情况

截止2015年二季度末,交通银行共托管证券投资基金132只。此外,还托管了基金公司特定客户资产管理计划、银行理财产品、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、信托计划、养老保障管理基金、企业年金基金、金库宝资产保管、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产、QDLP资金、证券公司客户资产管理计划、客户资金等产品。

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:王洪章

客户服务电话:95533

传真:010-66275654

(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:田国立

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)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:牛锡明

客户服务热线:95559

网址:www.bankcomm.com

(5)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:吉晓辉

联系人:虞谷云

联系电话:021-61618888

客户服务热线:95528

网址:www.spdb.com.cn

(6)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

电话:021-33389888

传真:021-33388224

客服电话:95523或4008895523

电话委托:021-962505

国际互联网网址: www.swhysc.com

联系人:黄莹

(7)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:许建平

电话:010-88085858

传真:010-88085195客户服务电话:400-800-0562

网址:www.hysec.com

联系人:李巍

(8)上海证券有限责任公司

注册地址:上海市西藏中路336号

法定代表人:龚德雄

电话:(021 53519888

传真:(021) 53519888

客户服务电话:4008918918(全国)、021-962518

网址:www.962518.com

(9)国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路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:万建华

联系人:芮敏祺

电话:(021) 38676666转6161

传真:(021) 38670161

客户服务咨询电话:400-8888-666

网址:www.gtja.com

(10)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

联系人:林生迎

客户服务电话:95565

网址:www.newone.com.cn

(11)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: 袁长清(代行)

电话: 021-22169999

传真: 021-22169134

联系人:刘晨

网址:www.ebscn.com

(12)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

联系人:田薇

电话: 010-66568430

传真:010-66568536

客服电话: 4008888888

网址:www.chinastock.com.cn

(13)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

电话:(010)65186758

传真:(010)65182261

联系人:魏明

客户服务咨询电话:400-8888-108;

网址:www.csc108.com

(14)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

电话:021-23219000

联系人:李笑鸣

客服电话:95553

公司网址:www.htsec.com

(15)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

联系人:黄静

客户服务电话:4008188118

网址:www.guodu.com

(16)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

电话:010-60838888

传真:010-60833739

客户服务热线:010-95558

(17)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

电话:021-63325888

传真:021-63326173

客户服务热线:95503

东方证券网站:www.dfzq.com.cn

(18)中信证券(浙江)有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法人代表:沈强

联系电话:0571-95548

公司网站:www.bigsun.com.cn

客户服务中心电话:0571-95548

(19)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

联系人:吴忠超

电话:0532-85022326

传真:0532-85022605

客户服务电话:95548

公司网址:www.citicssd.com

(20)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:牛冠兴

客服电话:4008001001

公司网址:www.essence.com.cn

(21)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:胡运钊

客户服务热线:95579或4008-888-999

联系人:李良

电话:027-65799999

传真:027-85481900

长江证券客户服务网站:www.95579.com

(22)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

(23)深圳众禄基金销售有限公司

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

(24)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

联系人:单丙烨

联系电话:021-20691832

传真:021—20691861

客服电话:400-089-1289

公司网站: www.erichfund.com

(25)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

(26)杭州数米基金销售有限公司

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人:陈柏青

客服电话:400-0766-123

公司网址:www.fund123.cn

(27)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

(28)一路财富(北京)信息科技有限公司

注册地址: 北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702

办公地址: 北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208

法定代表人: 吴雪秀

客服电话:400-001-1566

网站: www.yilucaifu.com

(29)北京展恒基金销售有限公司

注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层

法定代表人:闫振杰

联系电话:010-62020088

传真:010-62020035

客服电话: 4008886661

公司网址:www.myfund.com

(30)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: 沈继伟

客服电话:4000676266

网站:www.leadbank.com.cn

(31)和讯信息科技有限公司

注册地址: 北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址: 北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人: 王莉

客服电话:4009200022,021-20835588

网站:licaike.hexun.com

(32)上海汇付金融服务有限公司

注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室

办公地址:上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼

法定代表人:张晶

客服电话:400-820-2819

网站:fund.bundtrade.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)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有限公司

注册地址: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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法定代表人:吴港平

联系电话:8621-61233277

联系人:汪棣

经办注册会计师:汪棣、王灵

四、基金概况

基金名称:上投摩根稳进回报混合型证券投资基金

基金类型:契约型开放式

五、基金的投资

(一)投资目标

在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定回报。

(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、资产支持证券、债券回购、银行存款等)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:股票资产占基金净资产的0-50%;债券、现金等其他金融工具占基金净资产的比例不低于50%,其中现金及到期日一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证投资占基金资产净值的0-3%。

(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合理期限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

本基金将灵活运用久期策略、期限结构配置策略、信用策略、回购策略、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、回购及市场拆借利率等,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)信用策略

本基金将深入挖掘信用债的投资价值,在承担适度风险的前提下追求较高收益。本基金将利用内部信用评级体系对债券发行人及其发行的债券进行信用评估,并结合外部评级机构的信用评级,分析违约风险以及合理信用利差水平,判断债券的投资价值,谨慎选择债券发行人基本面良好、债券条款优惠的信用债进行投资。

(4)回购策略

本基金将通过对回购利率和现券收益率以及其他投资品种收益率的比较,通过回购融入短期资金滚动操作,投资于收益率高于回购成本的债券以及其他获利机会,从而获得杠杆放大收益,并根据市场利率水平以及对利率期限结构的预期等,对回购放大的杠杆比例适时进行调整。

(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)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。

3、股票投资策略

本基金将采用“自下而上”的个股精选策略,重点投资于具有良好基本面和较高成长潜力的公司。在具体操作上,本基金将综合运用定量分析与定性分析的手段,对个股投资价值进行深入挖掘。首先,本基金将基于公司财务指标分析公司的基本面价值,选择财务和资产状况良好且盈利能力较强的公司。具体的考察指标包括成长性指标(主营业务收入增长率、息税折旧前利润增长率、现金流)、盈利指标(毛利率、净资产收益率、投资回报率、企业净利润率)等指标。结合相关财务模型的分析,初步筛选出财务健康、成长性良好的优质股票。其次,本基金将深入剖析影响公司未来投资价值的驱动因素,从公司所处行业的投资价值、核心竞争力、主营业务成长性、公司治理结构、经营管理能力、商业模式、受益于经济转型的程度等多角度对股票进行定性分析。

为了避免投资估值过高的股票,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,综合利用市盈率法(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、定期检视投资组合与分红目标

本基金将每季度检视基金投资组合,通过对业绩表现分析、归因分析、绩效检验报告等评估基金绩效和风险,以便基金经理调整投资决策提高投资业绩。本基金将根据绩效分析和风险分析结果,动态调整组合的资产配置、行业配置、债券类属配置、债券杠杆水平等。同时,本基金将在对基金实际投资运作进行充分分析的基础上,结合对未来宏观、中观、微观环境的理性判断与合理预期,检视基金年度分红目标,在市场环境发生重大变化导致原先设定的分红目标不再适应未来市场环境时,本基金将对年度分红目标进行相应调整。

5、资产支持证券投资策略

本基金将在严格控制组合投资风险的前提下投资于资产支持证券。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。

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。

(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)股票资产占基金净资产的0-50%;债券、现金等其他金融工具占基金净资产的比例不低于50%;

(2)保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

(3)本基金持有一家上市公司发行的证券,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)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(6)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%;

(7)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%;

(8)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%;

(9)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%;

(10)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%;

(11)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%;

(12)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;

(13)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;

(14) 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;

(15)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;

(16)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%;

(17)本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

(18)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、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。期间,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)向其基金管理人、基金托管人出资;

(5)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;

(6)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。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(五) 业绩比较基准

一年期银行定期存款利率(税后)+1%

本基金是混合型基金,基金在运作过程中将维持0%-50%的权益类资产,债券、现金等其他金融工具占基金净资产的比例不低于50%。

上述“一年期银行定期存款收益率”是指当年1 月1 日中国人民银行公布并执行的一年期“金融机构人民币存款基准利率”。《基金合同》生效日所在年度以《基金合同》生效日中国人民银行公布并执行的一年期“金融机构人民币存款基准利率”为准。

本基金追求基金资产的稳健增值,力争为投资者提供稳定的现金分红。上述业绩比较基准能够较好地衡量本基金的投资策略及其投资业绩,也较好地体现了本基金的投资目标与产品定位,并易于被投资者理解与接受。

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

本基金属于混合型基金产品,预期风险和收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金 ,属于中等风险收益水平的基金产品。

(七)基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

(八) 基金管理人代表基金行使相关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相关权利,保护基金份额持有人的利益;

2.有利于基金财产的安全与增值;

3.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;

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。

(九) 、基金的投资组合报告

9.1 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	24,329,466.52	12.56
	其中:股票	24,329,466.52	12.56
2	固定收益投资	49,645,709.78	25.63
	其中:债券	49,645,709.78	25.63
	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	50,000,000.00	25.81
	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	59,353,617.30	30.64
7	其他各项资产	10,406,148.06	5.37
8	合计	193,734,941.66	100.00

9.2 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	1,603,638.00	0.95
C	制造业	20,618,204.52	12.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,098,502.00	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	1,009,122.00	0.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	24,329,466.52	14.39

9.3 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	600689	上海三毛	549,851	10,529,646.65	6.23
2	300353	东土科技	83,265	4,811,884.35	2.85
3	300349	金卡股份	52,206	2,345,093.52	1.39
4	002003	伟星股份	134,000	2,166,780.00	1.28
5	601918	国投新集	104,200	1,603,638.00	0.95
6	600511	国药股份	21,800	1,098,502.00	0.65
7	600125	铁龙物流	65,400	1,009,122.00	0.60
8	000786	北新建材	40,000	764,800.00	0.45

9.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	17,236,208.00	10.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	21,112,562.98	12.49
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	5,539,038.80	3.28
8	其他	5,757,900.00	3.41
9	合计	49,645,709.78	29.37

9.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019321	13国债21	120,000	12,068,400.00	7.14
2	127100	15新交投	100,000	10,098,000.00	5.97
3	132001	14宝钢EB	30,000	5,547,900.00	3.28
4	010303	03国债(3)	30,000	3,009,000.00	1.78
5	113501	洛钼转债	20,000	2,788,800.00	1.65

9.6 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。

9.7 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。

9.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9.9 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。

9.10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。

9.11投资组合报告附注

9.11.1本基金投资的上海三毛企业(集团)股份有限公司(以下简称:上海三毛,股票代码:600689)于2014年12月23日收到中国证券监督管理委员会上海监管局 (以下简称: 证监局)《行政处罚书》(沪【2014】4号),主要内容为:1. 证监局认定上海三毛存在违法事实:上海三毛的重要控股子公司上海三毛进出口有限公司(以下简称:三进公司)发生外商应收账款逾期,并预计后续还可能有大额应收账款发生逾期,对上海三毛2012年度及以后的经营业绩产生重大影响,属于《证券法》第六十七条所述的重大事件;对于前述重大事件,上海三毛没有及时披露,直至2013年3月23日才予以公告,并直至4月8日才发布因该重大事件导致公司2012年度经营业绩预亏公告;上海三毛的前述行为违反了《证券法》第六十七条关于上市公司应及时披露重大事件的规定,构成了《证券法》第一百九十三条第一款所述的违法行为。韩家红、蔡伯承为直接负责的主管人员,朱建忠为其他直接责任人员。2. 证监局决:(1) 对上海三毛给予警告,并处以30万元罚款;(2) 对韩家红、蔡伯承给予警告,并分别处以10万元罚款;(3) 对朱建忠给予警告,并处以5万元罚款。

对上述股票投资决策程序的说明:本基金管理人在投资上海三毛前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库,由研究员跟踪并分析。上述事件发生后,本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

除上述股票外,本基金投资的其余前九名证券的发行主体本期未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。

9.11.2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。

9.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	137,677.91
2	应收证券清算款	6,319,678.07
3	应收股利	-
4	应收利息	893,704.89
5	应收申购款	3,055,087.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,406,148.06

9.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113501	洛钼转债	2,788,800.00	1.65
2	110030	格力转债	1,152,780.00	0.68
3	128009	歌尔转债	79,390.00	0.05

9.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600689	上海三毛	10,529,646.65	6.23	筹划重大事项
2	000786	北新建材	764,800.00	0.45	筹划重大事项
3	300349	金卡股份	2,345,093.52	1.39	筹划重大事项
4	002003	伟星股份	2,166,780.00	1.28	筹划重大事项
5	300353	东土科技	4,811,884.35	2.85	筹划重大事项

9.11.6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。

六、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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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-2015/06/30	20.10%	1.23%	1.61%	0.01%	18.49%	1.22%

七、基金的费用与税收

(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、诉讼费和仲裁费;

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、证券账户开户费用、账户维护费用;

9、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1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.2%÷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3-8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)费用调整

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前按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。

(五)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。

八、其他应披露事项

上投摩根稳进回报混合型证券投资基金于2015年1月27日成立,至2015年7月26日运作满半年。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2014年12月29日公告的《上投摩根稳进回报混合型证券投资基金》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2015年7月26日, 基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2015年6月30日。

2、在“二、释义”中,对“《运作办法》”的定义进行了更新。

3、在“三、基金管理人”的“主要人员情况”中,对董事、独立董事、监事、其他高级管理人员、基金经理以及投资决策委员会等信息进行了更新。

4、在“四、基金托管人”中,对基金托管人的信息进行了更新。

5、在“五、相关服务机构”中,对代销机构的信息进行了更新。

6、本基金的实际募集期是2015年1月5日至2015年1月23日,根据本基金的实际募集情况,在“六、基金的募集及基金合同的生效”中更新了相关内容。

7、在“九、基金的投资”的“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“十、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、基金资产的估值”的“(三)估值方法”中,对固定收益品种的估值方法进行了更新。

10、新增了“二十三、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。

上投摩根基金管理有限公司
2015年9月9日

关于新增交通银行为上投摩根医疗健康股票型证券投资基金代销机构的公告

上投摩根基金管理有限公司已与交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)签订销售代理协议,现决定自2015年9月9日起,新增交通银行为上投摩根医疗健康股票型证券投资基金的代销机构。

有关上投摩根医疗健康股票型证券投资基金发行、销售的具体事宜请仔细阅读本基金的招募说明书、发售公告及基金合同等相关法律文件。

投资者可通过以下途径咨询有关详情:

1、交通银行

各营业网点

客户服务电话:95559

公司网址:www.bankcomm.com

2、上投摩根基金管理有限公司

客服电话:400-889-4888

网址:www.CIFM.com

特此公告。

上投摩根基金管理有限公司
2015年9月9日

上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票雏鹰农牧(002477)估值调整的公告

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(【2008】38号文),并参照中国证券投资基金业协会《关于停牌股票估值的参考方法》。经与托管行协商一致,本公司决定对旗下基金(不包括ETF基金)所持有的停牌股票雏鹰农牧(002477)自2015年9月8日起采用指数收益法进行估值。

待上述股票复牌且其交易体现了活跃市场交易特征后,将恢复为采用当日收盘价格进行估值,届时不再另行公告。

特此公告。

上投摩根基金管理有限公司
2015年9月9日