上投摩根阿尔法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:2005年10月11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. 本基金的基金名称自2015年7月21日起由上投摩根阿尔法股票型证券投资基金变更为上投摩根阿尔法混合型证券投资基金。该变更不涉及基金份额持有人权利义务关系的变化,亦不涉及投资目标、投资范围和投资策略的变更,对本基金的投资及基金份额持有人利益无实质性不利影响。
5. 本招募说明书所载内容截止日为2015年10月10日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2015年9月30日。

二零一五年十一月

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:
住所: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:2.5亿元人民币
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:
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JP 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;JP 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。
现任上海国际信托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:
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: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。
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: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、首席风险官;尚腾资本管理有限公司董事。
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。
本公司已于2013年4月19日发布公告,张军先生自2013年4月18日起,担任本公司副总经理一职。
5、本基金基金经理
李博先生,上海交通大学硕士,自2009年3月至2010年10月在中银国际证券有限公司是担任研究员,负责研究方面的工作,自2010年11月起加入上投摩根基金管理有限公司,担任基金经理助理兼行业专家一职,自2014年12月起担任上投摩根核心成长股票型证券投资基金基金经理, 自2015年8月起担任上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 自2015年9月起同时担任上投摩根阿尔法混合型证券投资基金基金经理。
本基金的历任基金经理为吕俊先生,任职时间为2005年10月11日至2006年4月18日;历任基金经理孙延群先生,任职时间为2005年11月15日至2009年7月6日;基金经理周晓文女士,任职时间为2007年8月8日至2009年9月17日;基金经理许运凯先生,任职时间为2009年9月17日至2010年11月18日;基金经理吴鹏先生,任职时间为2010年7月16日至2012年9月6日;基金经理王孝德先生,任职时间为2009年4月28日至2012年12月7日;基金经理欧宝林先生,任职时间为2012年11月至2014年1月;基金经理征茂平先生,任职时间为2014年1月3日至2015年2月16日;基金经理樊晟先生,任职时间为2014年12月23日至2015年9月25日。
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:王洪章
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。中国建设银行于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)。于2014年末,中国建设银行市值约为2,079亿美元,居全球上市银行第四位。
于2014年末,本集团资产总额167,441.30亿元,较上年增长8.99%;客户贷款和垫款总额94,745.23亿元,增长10.30%;客户存款总额128,986.75亿元,增长5.53%。营业收入5,704.70亿元,较上年增长12.16%;其中,利息净收入增长12.28%,净利息收益率(NIM)2.80%;手续费及佣金净收入占营业收入比重为19.02%;成本收入比为28.85%。利润总额2,990.86亿元,较上年增长6.89%;净利润2,282.47亿元,增长6.10%。资本充足率14.87%,不良贷款率1.19%,拨备覆盖率222.33%。
客户基础进一步夯实,全年公司机构有效客户和单位人民币结算账户分别新增11万户和68万户,个人有效客户新增1,188万户。网点“三综合”覆盖面进一步扩大,综合性网点达到1.37万个,综合柜员占比达到80%,综合营销团队1.75万个,网点功能逐步向客户营销平台、体验平台和产品展示平台转变。深化网点柜面业务前后台分离,全行超过1.45万个营业网点30类柜面实时性业务产品实现总行集中处理,处理效率提高60%。总分行之间、总分行与子公司之间、境内外以及各分行之间的业务联动和交叉营销取得重要进展,集团综合性、多功能优势逐步显现。
债务融资工具累计承销3,989.83亿元,承销额连续四年同业排名第一。以“养颐”为主品牌的养老金融产品体系进一步丰富,养老金受托资产规模、账户管理规模分别新增188.32亿元和62.34万户。投资托管业务规模增幅38.06%,新增证券投资基金托管只数和首发份额市场领先。跨境人民币客户数突破1万个、结算量达1.46万亿元。信用卡累计发卡量6,593万张,消费交易额16,580.81亿元,多项核心指标同业第一。私人银行业务持续推进,客户数量增长14.18%,金融资产增长18.21%。
2014年,本集团各方面良好表现,得到市场与业界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的100余项重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中,以一级资本总额位列全球第2;在英国《金融时报》全球500强排名第29位,新兴市场600强排名第3位;在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2;在美国《财富》杂志世界500强排名第38位。此外,本集团还荣获国内外重要媒体评出的诸多重要奖项,覆盖公司治理、社会责任、风险管理、公司信贷、零售业务、投资托管、债券承销、住房金融和信息科技等多个领域。
中国建设银行总行设投资托管业务部,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、监督稽核处等9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
赵砚甫,投资托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
张力铮,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部,并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务,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,投资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。
(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、QFII、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2015年6月末,中国建设银行已托管514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。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

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:王洪章
客户服务电话:95533
传真:010-66275654
(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:姜建清
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:蒋超良
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:田国立
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:牛锡明
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: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
(8)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@电话:(021)52629999@传真:(021)62569070客服电话:95561@网址:www.cib.com.cn
(9)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
联系电话:021-68475888
传真:021-68476111
客户服务热线:021-962888
网址:www.bankofshanghai.com
(10)中国光大银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦@法定代表人:唐双宁@电话:(010)63636153@传真:(010)63639709@客服电话:95595@联系人:李伟@网址:www.cebbank.com
(11)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:bank.ecitic.com
(12)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
(13)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
(14)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:闫冰竹
电话:010-66223584
传真:010-66226045
客户服务电话:95526
公司网站:www.bankofbeijing.com.cn
(15)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
(16)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
(17)广发银行股份有限公司
住所:广州市越秀区东风东路713号
办公地址:广州市农林下路83号
法定代表人:董建岳
电话:020-3832256
传真:020-87310955
客服电话:400-830-8003
网址:http://www.gdb.com.cn
(18)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
(19)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:胡平西
门户网站:www.srcb.com
客户服务电话:021-962999
(20)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
(21)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
(22)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
(23)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
(24)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
联系人:黄岚
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
(25)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
(26)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.ehscn.com
(27)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
(28)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
(29)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:兰荣
电话:021-38565785
联系人:谢高得
客户服务热线:95562
公司网站: www.xyzq.com.cn
(30)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
(31)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
电话:0755-82130833
传真: 0755-82133952
联系人:周杨
客户服务电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn
(32)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
(33)华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦@法定代表人:吴万善@客户咨询电话:025-84579897
联系电话:025-84457777-248@网址:www.htsc.com.cn
(34)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
(35)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
(36)财富证券有限责任公司
注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人:周晖
电话:0731-4403343
联系人:郭磊
公司网址:www.cfzq.com
(37)湘财证券有限责任公司
地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人:林俊波
电话:021-68634518
传真:021-68865680
联系人:钟康莺
开放式基金客服电话:400-888-1551
公司网址:www.xcsc.com
(38)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
(39)中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:唐新宇
开放式基金咨询电话:4006208888或各地营业网点咨询电话
开放式基金业务传真:021-50372474
网址:www.bocichina.com
(40)长城证券有限责任公司
住所、办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
电话:0755-83516289
传真:0755-83516199
客户服务热线:400 6666 888
网址:www.cgws.com
(41)德邦证券有限责任公司
办公地址:上海浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:姚文平
电话:021-68761616
客服电话:4008888128
网址:www.tebon.com.cn
(42)中国建银投资证券有限责任公司
住所、办公地址:深圳市益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-20楼
法定代表人:杨小阳
电话:(0755)82026521
传真:(0755)82026539
联系人:刘权
客户服务热线:400-600-8008
网址:www.cjis.cn
(43)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
联系电话:0591-87383623
业务传真:0591-87383610
联系人:张腾
客户服务热线:0591-96326
公司网址:www.hfzq.com.cn
(44)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
电话:010-65051166
传真:010-65058065
公司网址:www.cicc.com.cn
电话:021-58881690
(45)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
(46)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
电话:021-38784818
传真:021-68775878
联系人:倪丹
客户服务电话:68777877
公司网站:www.shhxzq.com
(47)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
(48)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市金山区卫清路7650号205室
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室
法定代表人:汪静波
客服电话:400-821-5399
公司网站: www.noah-fund.com
(49)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
(50)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
(51)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
(52)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
(53)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
公司网站:www.fund123.cn
(54)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
(55)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
(56)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
(57)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
(58)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
(59)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
(60)上海陆金所资产管理有限公司
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: 郭坚
客服电话:400-821-9031
网站:www.lufunds.com
(61)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人:梁越
客服电话:400-898-0618
网站:www.chtfund.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:通力律师事务所@注册地址:上海市浦东新区浦东南路528号,上海证券大厦南塔21楼
负责人:韩炯
联系电话:021-6881 8100@传真:021-6881 6880
经办律师:秦悦民
(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

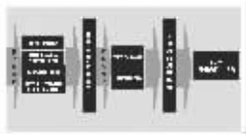
四、基金概况

基金名称:上投摩根阿尔法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
本基金采用哑铃式投资技术(Barbell Approach),同步以“成长”与“价值”双重量化指标进行股票选择。在基于由下而上的择股流程中,精选个股,纪律执行,构造出相对均衡的不同风格类资产组合。同时结合公司质量、行业布局、风险因子等深入分析,对资产配置进行适度调整,努力控制投资组合的市场适应性,以求多空环境中都能创造超越业绩基准的主动管理回报。
(二)投资理念
实践表明,价值投资(Value Strategies)和成长投资(Growth Strategies)在不同的市场环境中都存在各自发展周期,并呈现出一定的适应性。本基金将价值投资和成长投资有机结合,以均衡资产混合策略建立动力资产组合,努力克服单一风格投资所带来的局限性,并争取长期获得主动投资的超额收益。
(三)投资范围
本基金的投资范围为股票、债券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许的其它投资品种。股票投资范围为所有在国内依法发行的A股,债券投资的主要品种包括国债、金融债、企业债、可转换债券等,货币市场工具包括短期票据、回购、银行存款以及一年以内(含一年)的国债、金融债、企业债等。在正常情况下,本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的60-95%,其它为5-40%,并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。
如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。
(四)投资策略
本基金充分借鉴摩根资产管理集团全球行之有效的投资理念和技术,依据中国资本市场的具体特征,引入集团在海外市场成功运作的“Dynamic Fund”基金产品概念。具体而言,本基金将以量化指标分析为基础,通过严格的证券选择,积极构建并持续优化“哑铃式”资产组合,结合严密的风险监控,不断谋求超越业绩比较基准的稳定回报。
1、股票选择策略
1)选取价值/成长因子
传统做法,基金经理人为追求较佳业绩,通常会采取“多头时买进成长型股票”、“空头时转进价值股”的策略。不过,随着经济景气循环缩短、市场变化日益加速,多空判断越来越不易。本基金透过财务指标及严格选股,纪律式定期调整投资组合,在于克服人性弱点、保留投资智慧,积极争取主动管理报酬。
其中,投资策略的重点即贯彻“哑铃式投资”,即投资布局的搭配形同哑铃,强调两端投资,价值与成长性能平衡。同步执行价值与成长选股策略,兼顾价值与成长型股票,可以较好控制组合市场适应性,一定程度上能够排除对景气误判概率,以求多空环境中都能创造主动管理回报。

什么是价值?
什么是成长?
什么是动力组合?
依据市场景气循环及相关环境变化,基金管理人将动态检视上述价值因子与成长因子的有效性,在严谨量化分析基础上,予以进行适度调整。
2)计算股票风格等级
为合理辨别上市公司价值和成长特征,本基金根据现代统计学的基本理论,将各风格因子进行数据标准化。经过科学计算后,最终得到每一只股票的风格等级。本基金将最具价值特征的股票风格等级定为0,最具成长特征的股票风格等级定为100,所有排名被分别分配到各风格衡量中。具体流程见下图。



每家上市公司的价值和成长因子都配有一个风格排名,用其确定价值和成长因子排名。获得价值和成长因子序列后, 个股的总体风格排名经过算术平均后即得出。这样,依据个股价值与成长属性的排序筛选股票,并进而形成相对均衡的风格类资产组合。
通过执行数据标准化的程序,在摒弃异常数据的同时,可以更加合理的多层面评估上市公司价值和成长特征,基金管理人不仅能够深入鉴别股票可投资性能,增加投资组合的长期稳定效益,也可以借助风格因子的追踪调整及投资组合的重新平衡,更好地判断市场方向与把握市场中价值与成长的变换节奏。
3)创造主动管理报酬
本基金以量化指标进行个股筛选,然后研究团队将对个股进行基本面审核,结合跟踪误差的紧密监控,以求不论指数高低、市场多空皆创造主动管理回报,从而不仅改善市场环境中的负面影响, 也努力达到投资者利用基金产品进行理财的目标。本基金拥有三重主动管理报酬来源,分别是:
1量化指标分析:
运用多重量化模型,以“成长”、“价值” 指标进行严谨的股票筛选;
通过数据标准化过程,计算每一只股票的风格等级并排序;
依据市场环境及基金管理人实践经验,可对风格指标进行合理调整。
2基本面分析
研究团队对入选个股进行基本面审核;
在两类风格股票池中,所有个股进行策略性分类:优质级、品质级、转型级和交易级;
依据上述结论,调整步骤一中的个股名单。
3核心库确认
投研团队根据行业布局、风险因子等进行最后阶段筛选;
紧密监控组合跟踪误差,及时反馈组合变化信息;
确认核心库后,将定期重复上述步骤,对组合进行调整。

2、固定收益类投资策略
本基金以股票投资为主,为控制股票投资风险,优化组合流动性管理,本基金会适度考虑配置防御性资产,进行债券、货币市场工具等品种的投资。对于此类资产的选择,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投资,并主要通过类属配置与券种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、供求变化等因素的综合分析,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