上投摩根丰瑞债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

注册文号:中国证监会证监许可[2017]1341号文
注册日期:[2017年7月25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;
2. 基金的过往业绩并不预示其未来表现;
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。
5.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。
6. 本招募说明书摘要所载内容截止日为2018年5月26日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2018年3月31日。

二零一八年七月

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:Jed Laskowitz
政治学士学位和法学博士学位。
曾任资产管理多资产解决方案联席总监、资产管理亚太区行政总裁。
现任摩根资产及财富管理智能解决方案行政总裁、摩根资产及财富管理营运及投资委员会成员、资产管理营运委员会成员、财富管理营运委员会成员。
董事:Michael I. Falcon
金融学学士学位。
曾任摩根资产退休业务总监。
现任摩根资产管理亚太区行政总裁、资产管理营运委员会成员、集团亚太管理团队成员、集团资产管理亚太区营运委员会主席。
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。
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: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。
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。
2. 监事会成员基本情况:
监事会主席:赵静峵
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: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:
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。
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。
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。
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月起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。
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;赵峰,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:彭纯
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路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:陆志俊
电话:95559
交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国的发钞行之一。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2017年英国《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11位,较上年上升2位;根据2017年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜,交通银行营业收入位列第171位。
截至2018年3月31日,交通银行资产总额为人民币92667.97亿元。2018年1–3月,交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币200.91亿元。
交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称“托管中心”)。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
彭纯先生,董事长、执行董事,高级会计师。
彭先生2018年2月起任本行董事长、执行董事,2013年11月起任本行执行董事。2013年11月至2018年2月任本行副董事长、执行董事,2013年10月至2018年1月任本行行长;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。
袁庆伟女士,资产托管业务中心总裁,高级经济师。
袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁;2007年12月至2015年8月,历任本行资产托管部总经理助理、副总经理,本行资产托管业务中心副总裁;1999年12月至2007年12月,历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长,会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系,获得学士学位,2005年于新疆财经学院获硕士学位。
(三)基金托管业务经营情况
截至2018年3月31日,交通银行共托管证券投资基金350只。此外,交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产和QDLP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) 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
(2) 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
(3) 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
(4) 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
(5) 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
(6) 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
(7) 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
(8) 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
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:沈兆杰
经办注册会计师:薛竟、沈兆杰
四、基金概况
基金名称:上投摩根丰瑞债券型证券投资基金
基金的类别:债券型证券投资基金
基金的运作方式: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),或申购费用=固定申购费金额
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

C类基金份额不收取申购费。
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日该类基金份额净值
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:

持有期限	费率
0–7日(不含)	1.5%
7日(含)–180日	0.1%
180日以上(含)	0 %

C类基金份额:

持有期限	费率
0–7日(不含)	1.5%
7日(含)–30日	0.5%
30日以上(含)	0%

3、基金管理人可以根据相关法律法规以及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
在合理充分的定量分析及定性研究基础上,在风险可控的原则下,通过参与债券类资产的投资运作,力争获取超越基准的稳健回报。
二、投资范围
本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、地方政府债、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等,及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。
本基金不直接投资于股票和权证,但可参与可转换债券(含可分离交易的可转换债券)、可交换债券的投资。因所持可转换债券转股形成的股票、因所持可交换债券换股所形成的股票、因所持有股票所派发的权证以及因投资于可分离交易可转债而产生的权证,应在其可交易之日起的10个交易日内卖出。
基金的投资组合比例为:本基金的债券投资比例不低于基金资产的80%,现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%,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,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。
三、投资策略
1、债券类属配置策略
本基金将对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势,评估不同债券板块之间的相对投资价值,确定债券类属配置策略,并根据市场变化及时进行调整。
2、久期管理策略
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。
3、收益率曲线策略
本基金资产组合中的长、中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置。本基金在确定固定收益资产组合平均久期的基础上,将结合收益率曲线变化的预测,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。
4、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。
5、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。
6、中小企业私募债券投资策略
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,通过自上而下的宏观环境分析、市场指标分析结合自下而上的基本面分析和估值分析,精选个券构建组合。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。
7、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。
8、证券公司短期公司债券投资策略
本基金投资证券公司短期公司债券,将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。判断景气和精选标的主要通过固定收益团队协作研究实现,通过自上而下的宏观环境分析、市场指标分析结合自下而上的基本面分析和投资价值分析,两者前后呼应,相辅相成,为资产配置作决策依据,并在此基础上构建投资组合,定期回顾并调整投资组合。
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)本基金的债券投资比例不低于基金资产的80%;
(2) 本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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、应收申购款等;
(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%;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%;
(4)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%;
(5)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%;
(6)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%;
(7)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%;
(8)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;
(9)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%;
(10)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%,在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不展期;
(11)本基金总资产不得超过基金净资产的140%;
(12)本基主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。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;
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;
(13)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;
(14)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,除上述第(2)、(8)、(12)、(13)项外,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。
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。
如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。如法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制,但须提前公告,不需要经基金份额持有人大会审议。
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)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出资;
(6)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;
(7)法律、行政法规和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,遵循基金份额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或变更上述禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或按变更后的规定执行。
五、业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:中证综合债券指数收益率
中证综合债券指数涵盖了在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间债券市场交易、信用评级在投资级以上的国债、金融债、企业债、央票及短期融资券,具有一定的投资代表性。基于指数的权威性和代表性以及本基金的投资范围和投资理念,选用该业绩比较基准能够真实、客观的反映本基金的风险收益特征。
如果今后法律法规发生变化,或者上述比较基准指数停止编制或更改名称,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金管理人在与基金托管人协商一致,并履行适当程序后调整或变更业绩比较基准并及时公告,而无须召开基金份额持有人大会。
六、风险收益特征
本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
本基金风险收益特征会定期评估并在公司网站发布,请投资者关注。
七、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方牟取任何不当利益。
八、基金的投资组合报告
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	–	–
	其中:股票	–	–
2	固定收益投资	1,665,197,217.98	64.89
	其中:债券	1,665,197,217.98	64.89
	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	516,200,000.00	20.12
	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	351,663,144.48	13.70
7	其他各项资产	33,128,323.30	1.29
8	合计	2,566,188,685.76	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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
本基金本报告期末未持有股票。
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	10,462,430.00	0.47
2	央行票据	–	–
3	金融债券	108,460,787.98	4.90
	其中:政策性金融债	108,460,787.98	4.90
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	1,546,274,000.00	69.80
9	其他	–	–
10	合计	1,665,197,217.98	75.16

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	111892677	18甘肃银行CD037	2,000,000	197,720,000.00	8.92
2	111715497	17民生银行CD497	2,000,000	195,400,000.00	8.82
3	111813020	18浙商银行CD020	1,500,000	146,700,000.00	6.62
4	111796701	17包商银行CD055	1,100,000	105,006,000.00	4.74
5	111892699	18广西北部湾银行CD027	1,000,000	98,830,000.00	4.46

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。
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。
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.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。
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。
11.投资组合报告附注
11.1报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。
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。
11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,224.24
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	33,118,099.06
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	33,128,323.30

11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票无流通受限情况。
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。
七、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。
1. 上投摩根丰瑞债券A:

阶段	净值增长率①	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
2017年11月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日	0.43%	0.02%	0.29%	0.03%	0.14%	–0.01%
2018年1月1日至2018年3月31日	1.40%	0.03%	2.03%	0.04%	–0.63%	–0.01%

2. 上投摩根丰瑞债券C:

阶段	净值增长率①	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
2017年11月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日	0.43%	0.02%	0.29%	0.03%	0.14%	–0.01%
2018年1月1日至2018年3月31日	1.37%	0.03%	2.03%	0.04%	–0.66%	–0.01%

八、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、销售服务费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、基金的账户开户费用、账户维护费用;
10、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
本基金的管理费年费率为0.3%。管理费的计算方法如下:
H=E×0.3%÷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
基金管理费每日计提,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5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,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。
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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.1%÷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
基金托管费每日计提,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5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,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。
3、销售服务费
本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.1%。
C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.1%年费率计提, 计算方法如下:
H=E×0.1%÷当年天数
H 为C 类基金份额每日应计提的销售服务费
E 为C 类基金份额前一日基金资产净值
基金销售服务费每日计提,按月支付,由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,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,管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。
销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。
销售服务费的使用范围不包括基金募集期间的上述费用。
上述“一、基金费用的种类”中第4–10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,由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。
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协商一致并履行适当程序后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、销售服务费率等相关费率。
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。
九、招募说明书更新部分说明
上投摩根丰瑞债券型证券投资基金于2017年11月27日成立,至2018年5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2017年11月18日公告的《上投摩根丰瑞债券型证券投资基金招募说明书》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2018年5月26日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2018年3月31日。
2、在“三、基金管理人”的“基金管理人概况”中,对基金管理人的注册地址和法定代表人的信息进行了更新。
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、基金经理以及投资决策委员会