

# 上投摩根策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

## (更新)摘要

生效日期：[2016年6月16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，并经中国证监会注册。
3. 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. 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。
5. 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。
6. 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。
7. 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。
8. 本招募说明书所载内容截止日为2016年12月15日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2016年9月30日。

二〇一七年一月

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：

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20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 20 层

法定代表人：穆矢

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人民币增加到二亿五千万人民币，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：穆矢

硕士研究生学历、高级经济师职称。

曾任天津市人大财经委办公室副主任、天津信托投资公司总裁助理、上海浦东发展银行天津分行副行长、行长、党委书记、总行风险管理总部总监、上海浦东发展银行党委委员、副行长。

现任上海浦东发展银行董事会秘书、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：Jed Laskowitz

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。

曾任摩根资产管理亚太区行政总裁。

现任摩根资产管理全球投资管理方案联席总监。

董事：Michael I. Falcon

学士学位（主修金融）。

曾任摩根资产退休业务总监。

现任摩根资产管理全球投资管理的亚太区行政总裁、亚太区基金业务总监、环球投资管理营运委员会成员、集团亚太管理团队成员、集团投资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。

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：陈兵

博士研究生，高级经济师。

曾任浦发银行总行个人银行总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。

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：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：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。

独立董事：刘红忠

国际金融系经济学博士

现任复旦大学金融研究中心副主任、复旦大学国际金融系教授。

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，东吴大学法学院副教授。

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：石恬华

台湾大学财务金融系学士及芝加哥大学布斯商学院硕士。

历任摩根资产管理集团台湾区摩根投顾总经理、摩根投信总经理等职务；现任摩根资产管理集团台湾区负责人暨摩根投信董事长，负责台湾区的资产管理业务。

监事：张军

曾任上投摩根基金管理有限公司交易部总监。

现任上投摩根基金管理有限公司国际投资部总监兼基金经理，管理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。

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。

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

基金经理帅虎先生，复旦大学硕士研究生，自 2007 年 5 月至 2010 年 6 月在海通证券担任分析师，自 2010 年 6 月至 2011 年 6 月为国投瑞银基金任投资经理。自 2011 年 8 月起加入上投摩根基金管理有限公司，自 2014 年 11 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 2014 年 12 月至 2016 年 3 月担任上投摩根智选 30 混合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民生需求股票型证券投资基金基金经理，自 2016 年 6 月起同时担任上投摩根策略精选灵活配置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，投资董事；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，国际投资部总监；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）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年，现有员工 110 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60% 以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基

金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2016 年 09 月 30 日，中国银行已托管 502 只证券投资基金，其中境内基金 471 只，QDII 基金 31 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

## 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：易会满

客户服务统一咨询电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(3) 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](http://www.boc.cn)

(4) 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](http://www.cmbchina.com)

(5) 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](http://www.bankcomm.com)

(6) 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](http://www.spdb.com.cn)

(7) 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](http://www.swhysc.com)

联系人：黄莹

(8) 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：李季

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

(9) 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

电话：(021) 53686888

传真：(021) 53686100

客户服务电话：021-962518

网址：www.962518.com

(10) 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

联系人：芮敏祺

电话：(021) 38676666 转 6161

传真：(021) 38670161

客户服务咨询电话：95521

网址：www.gtja.com

(11) 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

(12) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(13) 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](http://www.chinastock.com.cn)

(14) 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](http://www.csc108.com)

(15) 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](http://www.xyzq.com.cn)

(16) 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](http://www.htsec.com)

(17) 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](http://www.guosen.com.cn)

(18) 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: 李航

客户服务电话: 4008188118

网址: [www.guodu.com](http://www.guodu.com)

(19) 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

(20) 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](http://www.citicssd.com)

(21) 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

(22) 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

(23) 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

(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：上海市浦东新区南路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) 深圳众禄金融控股股份有限公司

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) 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：单丙焱

联系电话：021-20691832

传真：021—20691861

客服电话：400-820-2899

公司网站： [www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(27) 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](http://www.5ifund.com)

(28) 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仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 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：陈柏青

客服电话：400-0766-123

公司网站： [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(29) 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](http://www.1234567.com.cn)

(30) 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](http://licaike.hexun.com)

(31) 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](http://www.yilucaifu.com)

(32) 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](http://www.myfund.com)

(33) 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](http://www.leadbank.com.cn)

(34) 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: 冯修敏

客服电话: 400-820-2819

网站: [fund.bundtrade.com](http://fund.bundtrade.com)

(35) 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](http://www.lufunds.com)

(36) 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](http://www.chtfund.com)

(37) 北京乐融多源投资咨询有限公司

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：董浩

客服电话：400-628-1176

网站：www.jimufund.com

(38) 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

(39) 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：杨懿

客服电话：400-166-1188

网站：<http://8.jrj.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(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：上投摩根策略精选灵活配置混合型证券投资基金

基金类型：契约型开放式

#### 五、基金份额的申购、赎回和转换

##### 1、基金申购费

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. 基金赎回费

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：

持有期限 费率

7 日以内 1.50%

7 日以上（含），30 日以内 0.75%

30 日以上（含），一年以内 0.50%

一年以上（含），两年以内 0.35%



两年以上(含) , 三年以内 0.20%

三年以上(含) 0 %

### 3. 基金转换费

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

在严格的风险控制的前提下, 采用定性与定量的分析, 自下而上精选个股, 力争实现基金资产的长期增值。

### 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、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券、中小企业私募债券、证券公司发行的短期公司债券)、债券回购、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货、股票期权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)。

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 0%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后, 保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

### 三、投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金将综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素, 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深入分析, 重点关注包括 GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势, 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。

## 2、股票投资策略

本基金将主要通过运用主题轮动策略与行业轮动策略，结合“自下而上”精选个股，充分挖掘并把握市场中潜在的投资机会，力争把握经济发展与转型中的投资机会。

### （1）主题轮动策略

由于投资主题具有动态、前瞻、跨行业或跨地区等特征，本基金将通过对宏观经济中政策性、结构性等发展趋势进行前瞻性的研究与分析，挖掘并灵活投资于集中代表整个市场阶段发展趋势的上市公司。首先，本基金将从经济体制变革、产业结构调整、技术发展创新等多个角度出发，分析经济结构、产业结构或企业商业模式变化的根本性趋势以及导致上述根本性变化的关键性驱动因素，从而发掘经济发展过程中的投资主题。其次，通过对投资主题的全面分析和评估，明确所对应的主题行业与主题板块。最后，考虑到经济发展呈现多元化动态发展特征，而投资主题可能会随着社会和经济的发展而有所变化。本基金将通过紧密跟踪经济发展趋势及其内在驱动因素的变化，不断地挖掘和研究新的投资主题，并对投资方向做出适时调整，力争准确把握新旧投资热点的转换时机。

### （2）行业轮动策略

本基金对行业配置权重的确定或调整将从以下几个方面考虑：

1) 行业基本面比较。行业比较包括两个层面，行业生命周期和行业景气。行业生命周期由行业自身发展规律决定，主要受产业链、行业竞争结构等因素的影响；行业景气受宏观经济环境影响而表现不同，主要分析指标包括收入、利润、价格、产量、产能利用率、销量及增速等。

2) 行业市场估值比较。估值体现市场预期，行业间估值排序、行业自身估值水平都影响行业在市场中的表现。因此，对行业估值进行分析并把握相应投资机会是行之有效的手段，具体指标包括行业间估值比较、行业估值水平、行业的盈利调整等。

### （3）个股精选策略

本基金将通过系统和深入的基本面研究，采用“自下而上”的方法，运用定量与定性相结合的方法优选个股。

#### 1) 定量分析

从以下几个方面对个股进行定量分析：

盈利能力指标：盈利能力是指企业获取利润的能力，利润是经营者经营业绩和管理效能的集中体现。企业的盈利能力指标是本基金管理人在投资运作过程中重点关注的因素。本基金选取净资产收益率（ROE）、总资产报酬率（ROA）、主营业

务收入同比增长率、主营业务利润同比增长率等盈利分析指标作为衡量标准。

估值指标：企业的估值水平在一定程度上反应了其未来成长性以及当前投资的安全性。估值合理将是本基金选股的一个重要条件。本基金将根据各行业的不同特点，采用市盈率（P/E）、市净率（P/B）、市盈率相对盈利增长比例（PEG）等估值指标，并参考国际估值分析方法、结合国内市场特征对入选的上市公司股票进行综合评估入选，选取估值合理的个股。

## 2) 定性分析

从以下几个方面对个股进行定性分析：

行业发展前景及地位：公司所在行业发展趋势良好，具有良好的行业成长性；公司在行业中处于领先地位，或者在生产、技术、市场等一个或多个方面具有行业内领先地位，并在短时间内难以被行业内的其他竞争对手超越，在未来的发展中，其在行业或者细分行业中的地位预期会有较大的上升。

治理结构：公司治理结构良好，管理规范，已建立起市场化经营机制、决策效率高、对市场变化反应灵敏并内控有力。主要考核指标：财务信息质量、所有权结构、独立董事制度、信息披露制度等等。

营运状况：公司营运状况良好，股东和管理层结构稳定；各项财务指标状况良好；公司具有清晰的发展战略等。

核心竞争力：公司主营业务可持续发展能力强，在行业中处于领先地位，具备核心竞争优势，比如专利技术、资源独占、销售网络垄断、独特的市场形象、较高的品牌认知度等。

风险因素考察：公司在技术、营销、内部控制等方面不存在较大风险，同时公司具备与规模扩张匹配的较强的管理能力。

## 3、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，自上而下进行组合构建，自下而上进行个券选择。

在组合构建上，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，对收益率曲线进行预测，对投资组合进行久期管理和信用管理，并定期对类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。

在个券选择上，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，对目标个券进行内部评级，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、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。

#### 5、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。

#### 6、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。

#### 7、股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。

本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股指期货定价模型，选择估值合理的期权合约。

基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，按照有关要求做好人员培训工作，确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。

#### 8、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) 股票资产占基金资产的 0%-95%；
- (2) 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%；
- (3) 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) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (5) 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%；
- (6) 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%；
- (7) 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%；
- (8) 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%；
- (9) 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%；
- (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%；
- (11) 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；

(12) 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；

(13) 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；

(14) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

(15) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(16) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

(17) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的 0%-95%；

(18) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(19) 本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

(20) 本基金开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

(21) 本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

(22) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，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。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商；

(23) 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%；

(24) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(25) 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，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。

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，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，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，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、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

中证 800 指数收益率\*60%+中债总指数收益率\*40%

中证 800 指数综合反映了沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，其成份股

由中证 500 和沪深 300 成份股共同构成，较好的反映了市场上不同规模特征股票的整体表现，适合作为本基金股票投资的比较基准。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。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，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 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高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险收益水平的基金产品。

## 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。

## 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 173,290,849.70 61.25

其中：股票 173,290,849.70 61.25

2 固定收益投资 --

其中：债券 --

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 --

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 108,606,589.26 38.39

7 其他各项资产 1,025,038.34 0.36



8 合计 282,922,477.30 100.00

## 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 -

-

C 制造业 95,981,520.19 34.06

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 155,316.74 0.06

F 批发和零售业 18,763,872.30 6.66

G 交通运输、仓储和邮政业 --

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 25,496,948.85 9.05

J 金融业 218,562.91 0.08

K 房地产业 --

L 租赁和商务服务业 2,516,295.93 0.89

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 22,001,479.92 7.81

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 8,156,852.86 2.89

S 综合 --

合计 173,290,849.70 61.50

## 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 300049 福瑞股份 1,000,055 23,681,302.40 8.40

2 300065 海兰信 639,742 23,542,505.60 8.36

3 300109 新开源 400,074 20,467,785.84 7.26

4	002640	跨境通	900,810	18,763,872.30	6.66
5	600749	西藏旅游	709,962	16,712,505.48	5.93
6	300104	乐视网	360,000	15,930,000.00	5.65
7	300367	东方网力	300,000	7,281,000.00	2.58
8	300302	同有科技	200,000	5,932,000.00	2.11
9	002292	奥飞娱乐	200,000	5,596,000.00	1.99
10	002343	慈文传媒	120,100	5,018,979.00	1.78

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 98,023.33

2 应收证券清算款 64,100.60

- 3 应收股利 -
- 4 应收利息 21,740.35
- 5 应收申购款 841,174.06
- 6 其他应收款 -
- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 1,025,038.34

#### 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中不存在流通受限情况。

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

## 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。

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

2016/6/16-2016/6/30 2.20% 0.63% 1.51% 0.52% 0.69% 0.11%

2016/6/16-2016/9/30 0.60% 0.81% 3.97% 0.50% -3.37% 0.31%

## 八、基金的费用

### 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 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，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 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。

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 2 日前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项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 九、招募说明书更新说明

本基金于 2016 年 6 月 16 日成立，至 2016 年 12 月 15 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 2016 年 5 月 5 日公告的《上投摩根策略精选灵活配置混合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 2016 年 12 月 15 日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为 2016 年 9 月 30 日。
- 2、在“三、基金管理人”的“主要人员情况”中，对董事、监事、其他高级管理人员以及投资决策委员会等信息进行了更新。
- 3、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的信息进行了更新。
- 4、在“五、相关服务机构”中，更新了代销机构的信息。
- 5、本基金的实际募集期是 2016 年 5 月 9 日至 2016 年 6 月 8 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。
- 6、在“八、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。
- 7、在“九、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。
- 8、新增了“二十二、其他应披露事项”一章，列示了本披露期间的其他重要事项。

2017 年 1 月 26 日

