

上投摩根中证消费服务领先指数证券投资 基金招募说明书（更新）摘要

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. 本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 9 月 24 日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为 2017 年 6 月 30 日。

二〇一七年十一月

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：

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
25 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%

JPMorganAssetManagement(UK)Limited49%

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一亿五千万万元人民币增加到二亿五千万万元人民币，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：

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 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总经理、党委副书记。

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。

基金管理人于 2017 年 7 月 29 日发布公告，章硕麟先生于 2017 年 7 月 28 日起代任公司董事长，代为履行公司董事长职务。

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：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，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：

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

黄栋先生，上海财经大学经济学硕士；2005年至2010年先后在东方证券、工银瑞信基金从事金融工程研究工作；2010年7月起加入上投摩根基金管理有限公司，主要负责金融工程研究方面的工作。2012年9月起担任上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金基金经理，2013年7月至2016年8月同时担任上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2015年6月起同时担任上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年8月起同时担任上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金基金经理，自2017年1月起同时担任上投摩根安瑞回报混合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安通回报混合型证券投资基金基金经理，自2017年8月起同时担任上投摩根优选多因子股票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，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)67595096

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)。

2017 年 6 月末，本集团资产总额 216,920.67 亿元，较上年末增加

7,283.62 亿元，增幅 3.47%。上半年，本集团实现利润总额 1,720.93 亿元，较上年同期增长 1.30%；净利润较上年同期增长 3.81%至 1,390.09 亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016 年，本集团先后获得国内外知名机构授予的 100 余项重要奖项。荣获《欧洲货币》2016 中国最佳银行，《环球金融》2016 中国最佳消费者银行、2016 亚太区最佳流动性管理银行，《机构投资者》人民币国际化服务钻石奖，《亚洲银行家》中国最佳大型零售银行奖及中国银行业协会年度最具社会责任金融机构奖。本集团在英国《银行家》2016 年世界银行 1000 强排名中，以一级资本总额继续位列全球第 2；在美国《财富》2016 年世界 500 强排名第 22 位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，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、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 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

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，资产托管业务部副总经理，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。

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。

黄秀莲，资产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。

原玘，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 2017 年二季度末，中国建设银行已托管 759 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。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》中国最佳托管银行、中国最佳次托管银行、最佳托管专家 QFII 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。

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

(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

(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

(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

(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

(7)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

(8)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

(9)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

(10)上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-20,22-27 层

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 15-20,22-

27 层

法定代表人：冀光恒

门户网站：www.srcb.com

客户服务电话：021-962999

(11)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

(12)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

(13)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

(14)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

(15)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

(16)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

(17)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

(18)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

(19)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

(20)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

(21)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

(22)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

(23)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

联系电话:0755-82492193

网址:www.htsc.com.cn

(24)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

(25)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

(26)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

(27)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

(28)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

(29)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

(30)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

(31)平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

(518048)

法定代表人：詹露阳

电话：021-38631117

传真：021-58991896

客服电话：95511-8

网址：<http://stock.pingan.com>

联系人：石静武

(32)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

(33)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

(34)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.cnwww.jjmmw.com

(35)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: 02120691861

客服电话: 400-820-2899

公司网站: www.erichfund.com

(36)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

(37)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

(38)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

(39)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

(40)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

(41)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

(42)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

(43)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

(44)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

(45)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

(46)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

(47)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

(48)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/>

(49)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

网站：www.xincai.com

客服电话：010-62675369

(50)北京肯特瑞财富投资管理有限公司

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：陈超

电话：4000988511/4000888816

网址：<http://fund.jd.com/>

(51)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

(52)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：李一梅

客户服务电话：400-817-5666

传真：010-88066552

(53)上海万得投资顾问有限公司

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：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号建工大厦 8 楼

法定代表人：王廷富

客户服务电话：400-821-0203

网址：www.520fund.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：021-51150298

传真：021-51150398

经办律师：张兰、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：上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

五、基金的申购费、赎回费和转换费

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 1.2%

人民币 100 万以上（含），500 万以下 0.8%

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

小于一年 0.5%

大于等于一年小于两年 0.2%

大于等于两年 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、且由同一注册登记机构办理注册登记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

本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，以实现中证消费服务领先指数的有效跟踪。

(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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、货币市场工具、资产支持证券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等，其中股票投资占基金净资产的 90%-95%，投资于中证消费服务领先指数成分股和备选成分股的资产不低于股票资产的 90%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

(三)投资策略

本基金采用完全复制策略，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用

其他方法建立实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。

1.资产配置策略

为了实现跟踪误差最小化，本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%，将不低于 90%的股票资产投资于中证消费服务领先指数的成份股及其备选成份股。

2.股票投资策略

（1）投资组合构建

本基金通过完全复制策略进行被动式指数化投资，根据中证消费服务领先指数成份股的基准权重构建股票资产组合，对于因法规限制、流动性限制而无法交易的成份股，将采用与被限制股预期收益率相近的股票或股票组合进行相应的替代。在初始建仓期或者为申购资金建仓时，本基金按照中证消费服务领先指数各成份股所占权重逐步买入。在买入过程中，本基金采取相应的交易策略降低建仓成本，力求跟踪误差最小化。在投资运作过程中，本基金以标的指数权重为标准配置个股，并根据成份股构成及其权重的变动进行动态调整。

（2）投资组合调整

1) 定期调整

本基金所构建的投资组合将定期根据所跟踪标的指数成份股的调整进行相应的跟踪调整。中证消费服务领先指数的样本股每半年调整一次，分别在每年 1 月和 7 月的第一个交易日，每次样本股调整数量不超过样本总数的 10%。指数调整方案公布后，本基金将及时对现有组合的构成进

行相应的调整，若成分股的集中调整短期内会对跟踪误差产生较大影响，将采用逐步调整的方式。

2) 不定期调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据标的指数权重比例的变化，进行相应调整。

当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置，基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益，选择相关股票进行适当的替代。

本基金将根据申购和赎回情况对股票投资组合进行调整，保证基金正常运行，从而有效跟踪标的指数。

3) 股票替代

通常情况下，本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量。但在如标的指数成份股流动性严重不足或停牌、标的指数成份股因法律法规的相关规定而为本基金限制投资的股票等特殊情况下，本基金可以选择其他股票或股票组合对标的指数中的成份股进行替换。

在选择替代股票时，为尽可能的降低跟踪误差，本基金将采用定性与定量相结合的方法，在对替代股票与被替代股票的基本面、股价技术面等指标相关性分析的基础上，优先从标的指数成份股及备选成份股中选择基本面良好，流动性充裕的股票进行替代投资。

3. 债券投资策略

对于债券类资产的选择，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。

(四)业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：**95%中证消费服务领先指数收益率+5%税后银行活期存款收益率**

由于本基金为完全复制型指数基金，跟踪标的为中证消费服务领先指数，同时本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此本基金以中证消费服务领先指数收益率和税后银行活期存款收益率的复合收益率作为基金的业绩比较基准符合本基金的特性。

如果指数公司变更或者停止中证消费服务领先指数编制及发布，或者上述标的指数由其它指数代替，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，进行适当的程序变更本基金的标的指数及投资对象，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若中证消费服务领先指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管

理人应就变更中证消费服务领先指数召开基金份额持有人大会，并在通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案且在指定媒体上刊登公告。若中证消费服务领先指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。并应及时在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

(五)风险收益特征

本基金为指数型基金，长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金等，为高风险、高收益产品。

(六)投资限制

1.组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

(1)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%；

(2)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；

(3)本基金股票投资占基金净资产的 90%-95%，投资于中证消费服务领先指数成分股和备选成分股的资产不低于股票资产的 90%；

(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；

(8)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%；

(9)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；

(10)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；

(11)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。

如果法律法规对本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。

因证券市场波动、上市公司合并、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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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)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，但是国务院另有规定的除外；

(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他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；

(7)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；

(8)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；

(9)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。

（七）公司的投资决策流程

严格的投资决策流程是本基金进行投资组合和控制投资风险的制度保障。

本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制，投资决策委员会是本基金管理人最高的投资决策机构。

投资决策基本原则是依据本基金合同所制定投资基本方针、投资范围及投资限制等，拟订基金投资策略及执行投资计划。适度控制风险及资产安全，并追求投资利得的合理增长，最大限度地保障基金持有人的利益。

公司投资决策采用投资决策委员会集体决策与基金经理授权决策相结合的分级模式。由投资决策委员会决定资产配置、投资原则等宏观决策；由基金经理负责组合构建、品种选择、时机选择等具体决策。

本基金的具体投资决策流程如下：

- 1、基金的投资是建立在深入的研究分析基础上的，本基金将依托公司强大的内部研究平台，并整合外部券商的研究成果，由研究员在实地调研和案头分析的基础上提供研究报告供投资决策委员会和基金经理参考。
- 2、投资决策委员会是基金投资管理的核心决策机构。投资决策委员会将定期或不定期召开会议，在依照有关法律法规与基金合同所确定的投资限制纲领的范围内，分析评价投资操作绩效，并在对现有资产配置进行总结的基础上，作出资产配置决议，确定证券评级模式，作为基金经理进行投资操作的依据。
- 3、基金经理根据投资决策委员会的决策，在其授权范围内构建投资组合并负责组织实施、追踪和调整，以实现基金的投资目标。

- 4、交易部执行基金经理的交易指令，并对交易情况及时作出反馈。
- 5、风险管理部定期和不定期对基金进行风险和绩效评估，并提供相关报告。

(八) 基金管理人代表基金行使股东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股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2.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；
- 3.有利于基金财产的安全与增值；
- 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)基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

(十) 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	19,239,623.18	92.68
---	------	---------------	-------

其中：股票	19,239,623.18	92.68
-------	---------------	-------

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 1,507,281.49 7.26

7 其他各项资产 12,240.00 0.06

8 合计 20,759,144.67 100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 积极投资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 50,424.00 0.25

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 --

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 208,706.40 1.02

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 259,130.40 1.26

2.2 指数投资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 7,822,649.13 38.07

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 1,124,982.09 5.47

G 交通运输、仓储和邮政业 141,306.00 0.69

H 住宿和餐饮业 32,520.00 0.16

I 信息传输、软件和信息技术服务业 3,339,028.24 16.25

J 金融业 3,825,201.92 18.62

K	房地产业	--
L	租赁和商务服务业	733,307.08 3.57
M	科学研究和技术服务业	--
N	水利、环境和公共设施管理业	682,143.72 3.32
O	居民服务、修理和其他服务业	--
P	教育	--
Q	卫生和社会工作	273,685.00 1.33
R	文化、体育和娱乐业	1,005,669.60 4.89
S	综合	--
	合计	18,980,492.78 92.37

3. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1 期末指数投资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	600887	伊利股份	47,056	1,015,939.04	4.94
---	--------	------	--------	--------------	------

2	600519	贵州茅台	2,048	966,348.80	4.70
---	--------	------	-------	------------	------

3	601318	中国平安	16,018	794,652.98	3.87
---	--------	------	--------	------------	------

4	000858	五粮液	14,045	781,744.70	3.80
---	--------	-----	--------	------------	------

5	600276	恒瑞医药	13,478	681,852.02	3.32
---	--------	------	--------	------------	------

6	600518	康美药业	23,222	504,846.28	2.46
7	600050	中国联通	64,838	444,140.30	2.16
8	002304	洋河股份	4,574	397,068.94	1.93
9	000538	云南白药	4,110	385,723.50	1.88
10	600036	招商银行	15,580	372,517.80	1.81

3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票 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	300315	掌趣科技	15,665.00	127,826.40	0.62
2	600654	*ST 中安	6,000.00	80,880.00	0.39
3	300267	尔康制药	4,400.00	50,424.00	0.25

注：本基金对*st 中安的投资是按照其所占中证消费服务领先指数的权重来进行，中证消费服务领先指数在 2017.6.12 进行了成分股调整，原成分股*ST 中安被调出，因故本基金将该股票调整为积极投资股票。截止至 2017.6.30 该股票处于停牌状态。

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名的前五名债券投资
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名的前十名资产支持
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名的前五名权证投资
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 本基金投资的中安消股份有限公司（以下简称*st 中安，股票代码 600654）于 2016 年 12 月 24 日公告称：*st 中安于 2016 年 12 月 22 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）调查通知书（编号为：沪证专调查字 20161102 号），因涉嫌违反证券法律法规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对*st 中安进行立案调查。截至目前，*st 中安生产经营情况正常。尚不清楚涉及调查事项的具体范围、具体发生时间、调查事项具体类型及事项影响程度。

对上述股票投资决策程序的说明：本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，以实现中证消费服务领先指数的有效跟踪。本基金采用完全复制策略，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。本报告期内，*st 中安是中证消费服务领先指数的成份股，本基金对*st 中安的投资是按照其所占中证消费服务领先指数的权重来进行，本报告期内，本基金对*st 中安的投资未违反上述原则。

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末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没有超出基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

1	存出保证金	587.14
---	-------	--------

2	应收证券清算款	-
---	---------	---

3	应收股利	-
---	------	---

4	应收利息	310.22
---	------	--------

5	应收申购款	11,342.64
---	-------	-----------

6	其他应收款	-
---	-------	---

7	待摊费用	-
---	------	---

8	其他	-
---	----	---

9	合计	12,240.00
---	----	-----------

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。

11.5.1 期末指数投资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	600050	中国联通	444,140.30	2.16	筹划重大事项
---	--------	------	------------	------	--------

11.5.2 期末积极投资前五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	600654	*ST 中安	80,880.00	0.39	筹划重大事项
2	300267	尔康制药	50,424.00	0.25	筹划重大事项

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。

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
----	---------	------------	-----------	--------------

2012/09/25-2012/12/31	2.40%	0.98%	4.42%	1.17%	-2.02%	-0.19%
-----------------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------

2013/01/01-2013/12/31	12.15%	1.24%	11.87%	1.25%	0.28%	-0.01%
-----------------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

2014/01/01-2014/12/31	20.41%	1.01%	21.01%	1.02%	-0.60%	-0.01%
-----------------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

2015/01/01-2015/12/31	21.89%	2.40%	22.75%	2.27%	-0.86%	0.13%
-----------------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

2016/01/01-2016/12/31 -11.65% 1.43% -11.24% 1.34% -0.41% 0.09%

2017/01/01-2017/6/30 10.36% 0.55% 11.05% 0.56% -0.69% -0.01%

八、费用概览

(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.基金财产拨划支付的银行费用；
- 4.基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5.基金份额持有人大会费用；
- 6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7.基金的证券交易费用；
8. 基金的开户费用；
9. 标的指数许可使用费；
- 10.在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
- 11.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(三)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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计提。

计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \times \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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，支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。

计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \times \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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，支付日期顺延。

3. 标的指数使用许可费

在通常情况下，基金标的指数许可使用基点费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H=E$ 标的指数许可使用基点费率当年天数，

根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，本基金标的指数许可使用基点费年费率为 0.02%， H 为每日应计提的基金标的指数许可使用基点费， E 为前一日基金资产净值。

自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用基点费每日计提，按季支付。基金设立当年，不足 3 个月的，按照 3 个月收费。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，标的指数许可使用基点费的收取下限为每季（自然季度）人民币 50,000 元，当季标的指数许可使用基点费不足 50,000 元的，按照 50,000 元支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年 1 月，4 月，7 月，10 月的前十个工作日内将上季度标的指数许可使用基点费从基金财产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

4.除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四)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。

(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、招募说明书更新部分说明

本基金于 2012 年 9 月 25 日成立，至 2017 年 9 月 24 日运作满五年。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 5 月 8 日公告的《上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金招募说明书（更新）》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 2017 年 9 月 24 日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为 2017 年 6 月 30 日。
- 2、在三、基金管理人的主要人员情况中，对董事、监事、基金经理、其他高级管理人员的信息进行了更新。
- 3、在四、基金托管人中，对托管人的基本信息进行了更新。
- 4、在五、相关服务机构中，对代销机构及会计师事务所的信息进行了更新。
- 5、在七、基金份额的申购、赎回和转换中，更新了基金的最低申购赎回限额。

6、在八、基金的投资的基金的投资组合报告中，更新了风险收益特征的描述，并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、在二十一、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。

2017年11月8日