

上投摩根红利回报混合型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：中国银行股份有限公司

重要提示：

- 1.基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整；
- 2.本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险；
- 3.投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应当认真阅读本招募说明书；
- 4.基金的过往业绩并不预示其未来表现；
- 5.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。
- 6.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。
- 7.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、非上市公司，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。
- 8.本招募说明书所载内容截止日为2016年3月17日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2015年12月31日。

二〇一六年四月

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：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)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%和摩根富林明资产管理（英国）有限公司33%变更为目的的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由一亿五千万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：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。

现任摩根资产管理环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。

现任摩根资产管理环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、集团亚太管理团队核心成员、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：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、上海国际集团有限公司资本运营部副总经理。

现任上海国泰君安股份有限公司董事会办公室副主任。

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：

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 JPMorganAssetManagement(Japan)Ltd 总裁、首席运营官；JPMorganTrustBank 总裁、首席运营官以及基础架构总监；投资管理亚洲首席行政官。

现任摩根资产管理日本董事长。

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：

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。

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

基金经理征茂平先生，自 2001 年 3 月至 2004 年 3 月在上海证大投资管理有限公司任高级研究员从事证券研究的工作；2004 年 3 月至 2005 年 4 月在平安证券有限公司任高级研究员从事证券研究的工作；2005 年 5 月至 2008 年 5 月在大成基金管理有限公司任研究员从事成长股票组合的管理工作；2008 年 5 月起加入上投摩根基金管理有限公司，担任行业专家兼基金经理助理，自 2013 年 7 月起担任上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金基金经理，自 2013 年 9 月起同时担任上投摩根红利回报混合型证券投资基金基金经理，2014 年 1 月至 2015 年 2 月担任上投摩根阿尔法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整合驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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。

本基金历任基金经理王成先生，其任职日期为 2013 年 9 月 18 日至 2014 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，副总经理；杜猛，总经理助理兼国内权益投资一部投资总监；孙芳，总经理助理兼国内权益投资二部投资总监；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、基金托管人概况

（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2015年12月31日，中国银行已托管418只证券投资基金，其中境内基金390只，QDII基金28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

(2) 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

(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)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

(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

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 客户服务热线: 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

客户服务热线: 4008918918 (全国)、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：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼
法定代表人：杨德红
客服电话：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
客户服务电话：95525 联系人：刘晨
网址：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

(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

(15)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

(16)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

(17)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

(18)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

(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

(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：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

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.cnwww.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：单丙焯

联系电话：021-20691832

传真：021—20691861

客服电话：400-820-2899

公司网站：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

(28)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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(37)北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603

办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号温特莱中心 A 座 16 层

法定代表人：董浩

客服电话：400-068-1176

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：刘佳、张兰

（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：上投摩根红利回报混合型证券投资基金

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：

(1) A类基金份额申购费

■
本基金的申购费用由投资人承担，并应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(2) C类基金份额申购费

本基金C类基金份额不收取申购费用。

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：

(1) A类基金份额赎回费

■
赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

(2) C类基金份额赎回费

本基金C类基金份额的赎回费率如下表所示：

■
赎回费用由赎回C类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回C类基金份额时收取。对C类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

(3) C类基金份额销售服务费

本基金C类基金份额的销售服务费年费率为0.50%，基金销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.5%年费率计提。

3.基金转换

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

以追求稳健收益为目标，严格控制下行风险，力争为投资者创造长期稳定的投资回报。

(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,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产的0%-50%,其中不低于80%的股票资产投资于红利股;债券、现金等其他金融工具占基金资产的比例不低于50%,其中现金或到期日在一年期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。

2、股票投资策略

本基金将主要投资于具有良好盈利能力和持续成长能力的红利股票,红利股的投资比例不低于股票资产的80%。本基金将通过红利股筛选、公司质地评估和估值分析三个步骤精选个股,构建股票投资组合。

(1) 红利股筛选

本基金在股票选择上侧重于对红利股的投资,重点关注具有稳定的分红历史或未来具有较高分红预期的上市公司。本基金管理人将按照以下标准进行红利股的选择,满足以下条件之一的股票即可认定为红利股,构成本基金的红利股票池:

- 1) 具有稳定的分红政策,在过去的3年中,至少有2次分红(包括现金分红和股票分红);
- 2) 具有较高的分红回报,最近一年的股息率(最近一年的现金分红/股票的年均价(年均价=年成交额/年成交量))处于市场前50%;
- 3) 具有较强的分红意愿,最近一年的分红率(最近一年的现金分红总额/可分配利润)处于市场前50%;
- 4) 具有较高的分红预期,预计会推出较优厚的分红方案。

(2) 公司质地评估

上市公司未来的分红能力主要取决于公司的盈利能力和成长的可持续性。只有具有良好盈利能力和持续成长能力的公司才有可能具有稳定的分红预期。在红利股票池的基础上,本基金管理人将根据企业盈利能力、成长性和成长质量等定量指标,选择出具有良好盈利能力和分红预期的股票进行重点配置。采用的具体财务指标主要包括主营业务收入增长率、净利润增长率、净资产收益率,选取主营业务收入增长率、净利润增长率或净资产收益率高于行业或市场平均水平的上市公司。在此基础上,本基金将全面考察公司所处行业的产业竞争格局、公司商业模式、盈利增长模式、公司治理结构等基本特征,选择基本面良好、具有持续竞争优势的公司。

(3) 估值分析

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)、市盈率一长

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。

3、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。

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。

（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）股票等权益类资产占基金资产的 0%-50%，其中不低于 80% 的股票资产投资于红利股；债券、现金等其他金融工具占基金资产的比例不低于 50%；
- （2）本基金持有一家上市公司的股票，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上市公司发行的证券，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%；
- （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）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；
- （16）法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

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。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。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，则本基金在履行适当程序后不再受相

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) 依照法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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。

(五)业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×40%+中证综合债券指数收益率×60%

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资产的比例不低于 50%。本基金采用“沪深 300 指数”和“中证综合债券指数”作为股票和债券投资的比较基准，并将业绩比较基准中股票指数与债券指数的权重确定为 40%和 60%，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征得基金托管人同意、报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

(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。

(九)基金的投资组合报告

1.报告期末基金资产组合情况

■

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

■

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

■

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

■

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



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。

8 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 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。

10 投资组合报告附注

10.1 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。

10.2 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。

10.3 其他各项资产构成



10.4 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。

10.5 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。

10.6 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。



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、基金的销售服务费；
- 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。

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：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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：

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

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。

3、基金的销售服务费

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 0.5%。

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 0.5% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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，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 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）费用的调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调低基金管理费率或基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒体上公告。

（五）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2013年9月18日成立，至2016年3月17日运作满两年半。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2015年10月31日公告的《上投摩根红利回报混合型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2016年3月17日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2015年12月31日。

2、在“二、释义”中，根据基金合同的修订，更新了相关释义。

3、在“三、基金管理人”的“主要人员情况”中，对法定代表人、董事、监事、基金经理、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。

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，更新了代销机构及审计基金财产的会计师事务所的信息。

6、在“七、基金的申购、赎回和转换”中，更新了C类份额的申购费、赎回费与销售服务费信息。

7、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。

8、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。

9、在“十二、基金的收益与分配”中，根据基金合同的修订进行了更新。

10、在“十三、基金的费用与税收”中，根据基金合同的修订进行了更新。

11、在“十五、基金的信息披露”中，根据基金合同的修订进行了更新。

12、在“十八、基金合同的内容摘要”中，根据基金合同的修订进行了更新。

13、在“二十二、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。

2016年4月30日