

上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金（QDII）招募说明书（更新）摘要

基金合同生效日期：[2016年11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. 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。
4. 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。
5. 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。
6. 本招募说明书所载内容截止日为2017年11月10日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2017年9月30日。

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：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：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：

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、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电子银行部（移动金融部）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。曾经在加利伯利大学经济系、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：赵嵘嵘

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、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：

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

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，自 2016 年 11 月起同时担任上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

基金经理王丽军女士，硕士研究生，自 2000 年 7 月至 2003 年 9 月在深圳永泰软件公司任项目实施专员；2006 年 2 月至 2007 年 1 月在大公国际资信评估公司任行业评级部经理；2007 年 1 月至 2007 年 9 月在东吴基金管理公司任行业研究员；2007 年 9 月至 2009 年 5 月在申万巴黎基金管理公司任行业研究员；2009 年 10 月起加入上投摩根基金管理有限公司，任我公司基金经理助理/行业专家，自 2016 年 11 月起担任上投摩根中国世纪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

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。

原珏，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、境外投资顾问及境外托管人

一、境外投资顾问

本基金暂不设境外投资顾问。

但本基金可以按照法律、法规和监管部门的有关规定，增设境外投资顾问为本基金提供境外证券投资的建议或投资组合管理等服务，无需召开基金份额持有人大会，但须依照法律法规的规定在指定媒介上提前公告。

二、境外托管人

（一）境外资产托管人基本情况

名称：摩根大通银行（JPMorganBank,N.A.）

注册地址：1111PolarisParkway,Columbus,Ohio43240,U.S.A.

办公地址：270ParkAvenue,NewYork,NewYork10017-2070

法定代表人：JamesDimon

成立时间：1799年

总资产（截止 2017 年 6 月 30 日）：2.56 万亿美元
实收资本（截止 2017 年 6 月 30 日）：1,785 百万美元
托管资产规模（截止 2017 年 6 月 30 日）：22.1 万亿美元
信用等级：穆迪评级 Aa3（高级信用债券）

（二）境外资产托管人职责

- （1）安全保管基金的境外资产，及时办理清算、交割事宜。
- （2）准时将公司行为信息通知基金管理人和/或基金托管人，确保基金及时收取所有应得收入。
- （3）其他由基金托管人委托其履行的职责。

四、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：

A.人民币份额：

(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

(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)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

(7)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

(8)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

(9)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

(10)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

(11)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

(12)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

(13)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

(14)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

(15)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

(16)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.xyq.com.cn

(17)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

(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

(19)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

(20)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

(21)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

(22)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

(23)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: 王连志

客服电话: 4008001001

公司网址: www.essence.com.cn

(24)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

(25)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

(26)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

(27)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: 02120691861

客服电话: 400-820-2899

公司网站: www.erichfund.com

(28)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

(29)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

(30)上海万得基金销售有限公司

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

(31)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

(32)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

(33)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

(34)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

(35)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

(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)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

(38)一路财富（北京）信息科技股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

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

(39)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：李兴春

客服电话：400-921-7755

网站：www.leadbank.com.cn

(40)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

(41)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

(42)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：周斌

客服电话：400-898-0618

网站：www.chtfund.com

(43)北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：胡伟

客服电话：400-618-0707

网站：www.hongdianfund.com

(44)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

(45)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/

(46)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

客服电话：010-62675369

网站：www.xincai.com

(47)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：江卉

客服电话：4000988511/4000888816

网址：http://fund.jd.com/

B.美元份额：

本基金美元份额（美元现钞与美元现汇）暂不通过代销机构销售。

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：021-51150298

传真：021-51150398

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：沈兆杰

经办注册会计师：薛竞、沈兆杰

五、基金份额的申购、赎回和转换费用

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：

人民币份额：

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

美元现钞份额：

申购金额区间 费率

美元 16 万以下 1.5%

美元 16 万以上（含），80 万以下 1.0%

美元 80 万以上（含） 每笔美元 160 元

美元现汇份额：

申购金额区间 费率

美元 16 万以下 1.5%

美元 16 万以上（含），80 万以下 1.0%

美元 80 万以上（含） 每笔美元 160 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：

持有期限 费率

7 日以内 1.5%

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 0.2%

三年以上（含） 0%

3、基金分别计算并披露不同类别份额对应的基金份额净值。人民币份额的基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数，美元份额的基金份额净值以人民币份额的基金份额净值为基础，按照计算日的估值汇率进行折算，人民币份额的基金份额净值精确到 0.001 元，美元份额的基金份额净值精确到 0.001 美元，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担；T 日的基金份额净值在 T+1 日计算，并在 T+2 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

4、申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

5、赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，人民币份额赎回金额单位为人民币元，美元份额赎回金额单位为美元。上述计算结果均按四舍五入，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

6、申购费用由投资人承担，不列入基金财产。

7、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。对持续持有期少于30日的基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于30日但少于3个月的基金份额持有人收取的赎回费，将赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期不少于3个月但少于6个月的基金份额持有人收取的赎回费，将赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期不少于6个月的基金份额持有人，将赎回费总额的25%计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

8、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

9、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金的销售费率。

10、本基金同时设立人民币份额和美元份额。人民币份额以人民币计价并进行申购、赎回；美元份额以美元计价并进行申购、赎回。基金管理人可以在不违反法律法规规定的情况下，设立以其它币种计价的基金份额以及接受其它币种的申购、赎回，其他外币基金份额申赎的原则、费用等届时由基金管理人确定并提前公告。

六、基金的投资

一、投资目标

本基金采用定量及定性研究方法，自下而上优选在中国境内及香港、美国等海外市场上市的中国公司，通过严格风险控制，力争实现基金资产的长期增值。

二、投资范围

本基金主要投资于：

1、国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、股票期权、权证、资产支持证券、股指期货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；

2、在香港、美国等海外证券市场（已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区）挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、房地产信托基金；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等固定收益投资工具；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；法律法规允许的、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括ETF等）；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品。

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。

本基金主要投资于在中国境内及香港、美国等海外证券市场（已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区）上市的中国企业股票，中国企业是指满足以下三个条件之一的上市公司：1）上市公司注册地在中国（包含中国内地及香港）；2）上市公司至少50%的主营业务收入或利润来自于中国；3）控股公司，其子公司的注册地及主要经营活动在中国。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的0%-95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、权证、资产支持证券等金融工具；权证投资占基金资产净值的0-3%。其中不低于80%的非现金基金资产应投资于与本基金所定义的在中国境内及香港、美国等海外证券市场（已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区）上市的中国企业股票。每个交易日日终在扣除需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券合计不低于基金资产净值的5%。

本基金的投资市场包含中国境内及香港、美国等海外市场（已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区），其中投资于中国境内市场的比例为0-90%，投资于香港、美国等海外市场（已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区）的比例为5%-50%。

三、投资策略

本基金将在中国境内及香港、美国等海外市场中挖掘中国企业股票投资机遇，跨市场全球配置优质中国上市公司，同时注重股票资产在各市场的配置，并考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险，通过品种和仓位的动态调整降低资产波动的风险。

1、各市场资产配置策略

本基金综合考虑不同市场的宏观经济环境、增长和通胀背景、不同市场的估值水平和流动性因素、相关公司所处的发展阶段、盈利前景和竞争环境以及其他影响投资组合回报及风险的重要要素将基金资产在中国境内及香港、美国等海外市场之间进行配置。另外，本基金将根据各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的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：

（1）中国境内市场投资策略

本基金将专注投资于影响国民经济的龙头行业、经济转型和产业升级过程中的重点行业和具备成长潜力的新兴行业，包括国企改革、一带一路、工业 4.0、互联网+、节能环保、高端装备制造、新一代信息技术、生物、新材料、新能源、新能源汽车、金融创新、文化创新、消费升级等相关行业。本基金将对精选行业的发展进行密切跟踪，充分把握经济发展和转型过程中的投资机会，发掘上市公司中商业模式独特、竞争优势明显，具有长期持续增长模式、估值水平相对合理的优质上市公司，分享企业成长及变革带来的资本增值。

1) 个股选择

本基金采取自下而上的个股精选策略，通过对企业基本面的分析和研究，挖掘具有较强竞争力和持续成长能力的上市公司，主要评估因素包括：

定性分析：主要从公司所在行业的发展特点及公司的行业地位、公司的核心竞争力、公司的经营能力和治理结构等方面进行分析。

定量分析：主要从公司的盈利能力、增长能力、偿债能力、营运能力以及估值水平等方面进行分析。

2) 行业配置

在以自下而上的个股精选策略为主的基础上，本基金通过对宏观经济运行趋势、产业环境、产业政策和行业竞争格局等多因素的分析 and 预测，确定宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，得出各行业的相对投资价值与投资时机，并采取适度均衡的行业配置策略，全面覆盖主要行业。本基金将动态跟踪行业景气度和估值水平，确定或调整行业配置比例，构建组合，并推进个股在组合层面的不断优化。

具体操作中，本基金从经济周期因素评估、行业政策因素评估和行业基本面指标评估（包括行业生命周期、行业发展趋势和发展空间、行业内竞争态势、行业收入及利润增长情况等）三个方面评估各行业。本基金重点关注的行业包括：影响国民经济的龙头行业、经济转型和产业升级过程中的重点行业和具备成长潜力的新兴行业。

（2）香港、美国等海外市场投资策略

对于境外投资，本基金将结合宏观基本面，包含资金流向等对海外市场上市公司进行初步判断，并结合产业趋势以及公司发展前景自下而上进行布局，从公司商业模式、产品创新及竞争力、主营业务收入来源和区域分布等多维度进行考量，挖掘优质企业。

首先，本基金将自上而下地甄选行业，通过对行业政策、景气度、估值吸引力比较、市场预期、行业动量指标等标准确定行业配置方案；

其次，本基金通过多种策略的研究和运用优选出国内稀缺股、对标中国市场严重低估的中小市值股、具有较高知名度的大型集团股、AH 高溢价股、相关主题概念股等备选企业；

最后，通过自下而上方法分析个股，结合各项定量和定性指标挑选出最具上涨潜力的标的。

3、债券投资策略

本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。

4、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。

5、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。

6、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在投资权证时，将对权证标的证券基本面的深入研究，结合权证定价模型及其隐含波动率等指标，寻求其合理的估值水平，谨慎投资，以追求较稳定的当期收益。

7、金融衍生品投资策略

本基金可本着谨慎和风险可控的原则，适度投资于经中国证监会允许的各类金融衍生产品，如期货、期权、权证、远期合约、掉期以及其他衍生工具。本基金投资于金融衍生品主要是为了避险和增值、管理汇率风险，以便更好地实现基金的投资目标。本基金投资于各类金融衍生品的全部敞口不高于基金资产净值的100%。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在更新招募说明书中公告。

四、投资限制

1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，除中国证监会另有规定外，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 购买不动产；
- (5) 购买房地产抵押按揭；
- (6) 购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- (7) 购买实物商品；
- (8) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%；
- (9) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品以及法律法规及中国证监会另有规定的除外；
- (10) 参与未持有基础资产的卖空交易；
- (11) 购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
- (12) 直接投资与实物商品相关的衍生品；
- (13) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (14) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- (15) 当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

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的原则，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，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

2、投资组合限制

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%，其中不低于 80% 的非现金基金资产应投资于与本基金所定义的在中国境内及香港、美国等海外市场（已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区）上市的中国企业股票；

(2) 本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%。银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，在基金托管账户的存款可以不受上述限制；

(3) 本基金持有一家公司或机构发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司或机构发行的证券，不超过该证券的 10%；同一公司境内外上市的总股本将合并计算；

(5) 本基金在境外投资中，持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不受上述限制；

(6) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的 10%，持有货币市场基金可以不受上述限制；

(7) 同一基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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%；

(11) 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%；

(12) 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%；

(13) 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%；

(14) 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%；

(15) 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；

(16) 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；

(17) 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；

(18) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%；前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；

(19) 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%；

(20) 本基金在投资境内股指期货时，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；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；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）不得超过基金资产的 95%；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%；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；

（21）本基金在投资境内股票期权时，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%；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；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需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%；

（23）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（24）法律法规和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

3、金融衍生品投资

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

（1）本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

（2）本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

（3）本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

2) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

3) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

（4）基金管理人应当在本基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

（5）本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

4、本基金可以参与证券借贷交易、并且应当遵守下列规定：

（1）所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

（2）应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

（3）借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

（4）除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

1) 现金；

2) 存款证明；

3) 商业票据；

4) 政府债券；

5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

（5）本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

（6）基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

5、基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

（1）所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用

评级。

(2) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

(3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

(4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

(5) 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

6、基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

7、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 个工作日内进行调整，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。

五、业绩比较基准

中证中国内地企业 400 指数 60%+中债总指数收益率 40%

中证中国内地企业 400 指数基于全球市场上市的中国内地企业，选取沪深 300 指数样本公司以及最大的 100 家其他境外市场上市企业组成成分，能较好体现境内外上市中国内地企业的表现，是适合作为全球市场中国概念股投资业绩比较基准的指数。

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。若标的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、指数编制方法变化等），则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。

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、基金的境外投资顾问

本基金暂不设境外投资顾问。

但本基金可以按照法律、法规和监管部门的有关规定，增设境外投资顾问为本基金提供境外证券投资的建议或投资组合管理等服务，无需召开基金份额持有人大会，但须依照法律法规的规定在指定媒介上提前公告。

九、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(人民币元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 183,743,635.48 82.22

其中：普通股 157,581,902.52 70.52

存托凭证 26,161,732.96 11.71

优先股 --

房地产信托 --

2 基金投资 --

3 固定收益投资 --

其中：债券 --

资产支持证券 --

4 金融衍生品投资 --

其中：远期 --

期货 --

期权 --

权证 --

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 货币市场工具 --

7 银行存款和结算备付金合计 38,356,607.96 17.16

8 其他各项资产 1,367,444.61 0.61

9 合计 223,467,688.05 100.00

2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区） 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例（%）

中国 85,681,621.40 38.78

中国香港 71,900,281.12 32.54

美国 26,161,732.96 11.84

合计 183,743,635.48 83.17

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定，ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别 公允价值（人民币元） 占基金资产净值比例（%）

互联网软件与服务 38,127,411.73 17.26

商业银行 32,449,741.95 14.69

保险 18,120,496.04 8.20

汽车 13,795,079.76 6.24

家庭耐用消费品 12,048,410.00 5.45

金属与采矿 11,957,137.00 5.41

房地产管理和开发 6,682,575.90 3.02

酒店、餐馆与休闲 6,448,919.40 2.92

媒体 6,434,568.00 2.91

饮料 6,395,442.20 2.89

制药 6,066,387.00 2.75

电子设备、仪器和元件 6,015,083.00 2.72

机械制造 5,559,600.00 2.52

食品 4,669,500.00 2.11

综合消费者服务 4,659,482.50 2.11

食品与主要用品零售 4,313,801.00 1.95

合计 183,743,635.48 83.17

注：行业分类标准：MSCI

4 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及存托凭证投资明细

序号 公司名称（英文） 公司名称（中文） 证券代码 所在证

券市场 所属国家

（地区） 数量

（股） 公允价值（人民币元） 占基金资产净值比例（%）

1 PingAnInsurance(Group)CompanyofChinaLtd 中国平安 601318CH 上海证券交易所 中国 346,445.00
18,120,496.04 8.20

2 IndustrialCommercialBankofChina 工商银行 601398CH 上海证券交易所 中国 3,030,075.00 16,826,549.36 7.62

3 TencentHoldingsLtd 腾讯控股 700HK 香港交易所 中国香港 58,200.00 16,625,161.27 7.53

4 ChinaMerchantsBankCoLtd 招商银行 600036CH 上海证券交易所 中国 633,700.00 15,623,192.59 7.07

5 AlibabaGroupHoldingLtd 阿里巴巴集团 BABAUS 纽约证券交易所 美国 13,219.00 15,152,397.71 6.86

6 GeelyAutomobileHoldingsLtd 吉利汽车 175HK 香港交易所 中国香港 738,000.00 13,795,079.76 6.24

7 GreeElectricAppliancesInc 格力电器 000651CH 深圳交易所 中国 317,900.00 12,048,410.00 5.45

8 SunacChinaHldgsLtd 融创中国 1918HK 香港交易所 中国香港 220,000.00 6,682,575.90 3.02

9 GalaxyEntertainmentGroupLtd 银河娱乐 27HK 香港交易所 中国香港 138,000.00 6,448,919.40 2.92

10 ThinkKingdomMediaGroupLtd 新经典 603096CH 上海证券交易所 中国 107,100.00 6,434,568.00 2.91

5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7 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。

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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

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中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

10.3 其他资产构成

序号 名称 金额(人民币元)

1 存出保证金 75,192.45

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 130,701.37

4 应收利息 4,995.07

5 应收申购款 1,156,555.72

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,367,444.61

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。

阶段 净值增长率 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 --

2016/11/11-2016/12/31 -0.90% 0.30% -2.59% 0.44% 1.69% -0.14%

2017/01/01-2017/09/30 29.97% 0.79% 15.04% 0.34% 14.93% 0.45%

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,含境外托管人的托管费;

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、期货交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用;

7、基金的银行汇划费用和外汇兑换交易的相关费用;

8、证券、期货账户开户费用、账户维护费用;

9、基金依照有关法律规定应当缴纳的,购买或处置证券有关的任何税费;

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

基金的管理费包含基金管理人的管理费和境外投资顾问的投资顾问费(如有)两部分,其中境外投资顾问的投资顾问费在境外投资顾问与基金管理人签订的投资顾问合同中进行约定。

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:

$$H = E \times 1.5\% \times \text{当年天数}$$

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。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,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。

2、基金托管人的托管费

基金的托管费包含基金托管人的托管费和境外托管人的托管费两部分。

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.3%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.3\% \times \text{当年天数}$$

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。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，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。

上述一、基金费用的种类中第3—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。除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

九、基金概况

基金名称：上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

十、招募说明书更新部分说明

上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金于2016年11月11日成立，至2017年11月10日运作满一年。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6月24日公告的《上投摩根中国世纪灵活配置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.在三、基金管理人的主要人员情况中，对董事长、董事、监事、其他高级管理人员及投资决策委员会成员信息进行了更新。
- 2.在四、基金托管人中，更新了托管人的相关信息。
- 3.在五、境外投资顾问及境外托管人中，更新了境外托管人的信息。
- 4.在六、相关服务机构中，更新了相关服务机构的有关信息。
- 5.在八、基金份额的申购、赎回和转换中，更新了人民币份额的申购、赎回的限额。
- 6.在九、基金的投资的风险收益特征中，更新了相应描述；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.在十、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.在二十三、其他应披露事项中，列举了本基金报告期内与基金运作有重大关系的公告。

上投摩根基金管理有限公司

2017年12月25日