上投摩根安全战略股票型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

生效日期:[2015 年 2 月 26 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,投资人认购(或申购)基金时应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。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。

4、基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

5、本基金可以参与中小企业私募债券的投资。中小企业私募债发行人为中小微、非上市企业,存在着公司治理结构相对薄弱、企业经营风险高、信息披露透明度不足等特点。投资中小企业私募债将存在违约风险和流动性不足的风险,这将在一定程度上增加基金的信用风险和流动性风险;、

6、本基金可以参加科创板股票的投资。基金资产投资于科创板股票,会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于流动性风险、退市风险、投资集中度风险、市场风险、系统性风险、股价波动风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票,基金资产并非必然投资于科创板股票。

7、本招募说明书根据中国证监会于 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定以及本基金的基金合同及托管协议的修订更新了相关章节。

8、本招募说明书所载内容截止日为 2020 年 2 月 25 日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为 2019 年 12 月 31 日。

二〇二〇年四月

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:中国(上海)自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 层

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 层

法定代表人:陈乐

总经理:王大智

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元人民币增加到二亿五千万元人民币,公司股东的出资比例不变。该变更事项于 2009 年 3 月 31 日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

基金管理人无任何受处罚记录。

二、主要人员情况

1.董事会成员基本情况:

董事长:陈乐

博士研究生,高级经济师。

曾任上海浦东发展银行大连分行资金财务部总经理,上海浦东发展银行总行资金财务部总经理助理,上海浦东发展银行总行个人银行总部管理会计部、财富管理部总经理,上海国际信托有限公司副总经理兼董事会秘书,上海国际信托有限公司党委副书记、总经理。

现任上海国际信托有限公司党委书记、总经理;上投摩根基金管理有限公司董事长。

董事:Paul Bateman

大学本科学位。

曾任 Chase Fleming Asset Management Limited 全球总监、摩根资产管理全球投资管理业务行政总裁。

现任摩根资产管理全球主席、资产管理营运委员会成员及投资委员会成员。

董事:Daniel J. Watkins

学士学位。

曾任欧洲业务副首席执行官、摩根资产欧洲业务首席运营官、全球投资管理运营总监、欧洲运营总监、欧洲注册登记业务总监、卢森堡运营总监、欧洲注册登记业务及伦敦投资运营经理、富林明投资运营团队经理等职务。

现任摩根资产管理亚洲业务首席执行官、资产管理运营委员会成员、集团亚太管理团队成员。

董事:Richard Titherington

牛津大学政治、哲学和经济硕士学位。

曾任摩根资产管理环球新兴市场股票投资部总监。

现任摩根资产管理董事总经理、新兴市场及亚太股票组别投资总监。

董事:王大智

学士学位。

曾任摩根资产管理香港及中国基金业务总监、摩根投信董事长暨摩根资产管理集团台湾区负责人。

现任上投摩根基金管理有限公司总经理。

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:丁蔚

硕士研究生。

曾就职于中国建设银行上海分行个人银行业务部副总经理,上海浦东发展银行个人银行总部银行卡部总经理,个人银行总部副总经理兼银行卡部总经理。

现任上海浦东发展银行总行零售业务部总经理。

董事:林仪桥

硕士研究生,会计师、经济师。

曾任浦发银行总行资金总部投资组合业务部总经理助理,浦发银行总行金融市场部总经理助理,海口分行行长助理(挂职),浦发银行总行金融机构部总经理助理。

现任浦发银行总行金融机构部副总经理和金融市场部(深圳)副总经理。

独立董事:刘红忠

国际金融系经济学博士。

现任复旦大学经济学院教授,复旦大学金融研究中心副主任;同时兼任华泰证券股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、中银万国期货有限责任公司、东海期货有限责任公司及兴业证券股份有限公司独立董事,上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事:汪棵

美国加州大学洛杉矶分校金融专业工商管理硕士学位,并先后获得美国加州注册会计师执照和中国注册会计师证书。

曾担任普华永道金融服务部合伙人及普华永道中国投资管理行业主管合伙人。

现担任招商证券股份有限公司、复星联合健康保险股份有限公司、亚太财产保险有限公司及 51 信用卡有限公司独立董事、中国台湾旭昶生物科技股份有限公司监事。

独立董事:曾翀

英国特许公认会计师公会资深会员。

曾任香港赛马会集团财务总监,香港证监会产品咨询委员会委员,协康会名誉司库和执行委员会和投资小组委员会成员,戴麟趾爵士康乐基金、警察子女教育信托基金和警察教育及福利信托基金投资咨询委员会主席,香港房屋协会资金管理特设委员会成员,以及另类投资管理协会(AIMA)全球投资者指导委员会成员。

现为独立顾问,宝积资本控股有限公司独立非执行董事以及安联环球投资香港有限公司兼职顾问。

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:梁斌

学士学位。

曾在高伟绅律师事务所(香港)任职律师多年。

现任摩根大通集团中国法律总监。

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:

王大智先生,总经理

学士学位。

曾任摩根资产管理香港及中国基金业务总监、摩根投信董事长暨摩根资产管理集团台湾区负责人。

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。

刘鲁旦先生,副总经理。

博士研究生。

历任华夏基金管理有限公司固定收益总监、中国国际金融股份有限公司资产管理部固定收益总监 / 董事总经理。

邹树波先生,督察长。

获管理学学士学位。

曾任天健会计师事务所高级项目经理,上海证监局主任科员,上投摩根基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监。

5. 本基金基金经理

陈思郁女士自 2008 年 5 月至 2009 年 8 月在国泰君安研究所担任研究员,自 2009 年 9 月起加入上投摩根基金管理有限公司,历任行业专家、基金经理助理,现任国内权益投资部基金经理,自 2015 年 8 月起担任上投摩根双核平衡混合型证券投资基金基金经理,自 2016 年 10 月起同时担任上投摩根安全战略股票型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理卢扬先生,其任职日期为 2015 年 2 月 26 日至 2016 年 10 月 21 日;历任基金经理李德辉先生,其任职日期为 2018 年 3 月 30 日至 2019 年 7 月 19 日。

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;刘鲁旦,副总经理兼债券投资总监;张军,投资董事、国际投资部总监、投资绩效评估总监兼高级基金经理;朱晓龙,研究部总监兼基金经理;陈圆明,绝对收益投资部总监兼基金经理;聂曙光,债券投资部总监兼资深基金经理;孟晨波,总经理助理 / 货币市场投资部总监兼资深基金经理;任翔,固收研究部总监兼基金经理;钟维伦,资深投资经理;刘凌云,组合基金投资部总监兼基金经理;张文峰,组合基金投资部副总监兼投资经理;孟鸣,基金经理兼资深投资组合经理;叶承焘,投资经理;陈晨,投资经理。

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:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人:刘连舸

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:许俊

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 2019 年 12 月 31 日,中国银行已托管 764 只证券投资基金,其中境内基金 722 只,QDII 基金 42 只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 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

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:田国立

客户服务电话:95533

网址:www.ccb.com

(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:陈四清

客户服务统一咨询电话:95588

网址:www.icbc.com.cn

(3)中国银行股份有限公司

注册地址: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

法定代表人:刘连舸

客服电话:95566

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:彭纯

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:郑杨

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:金煜

客户服务热线:95594

网址:www.bankofshanghai.com

(8)江苏银行股份有限公司

办公地址:南京市中华路 26 号

法定代表人:夏平

电话:95319

网址:www.jsbchina.cn

(9)东莞农村商业银行股份有限公司

地址:广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

法定代表人:王耀球

客服电话:961122

网址:www.drcbank.com

(10)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

客服电话:95523

网址: www.swhysc.com

(11)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:李琦

客户服务电话:400-800-0562

网址:www.hysec.com

(12)上海证券有限责任公司

注册地址:上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

办公地址:上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人:李俊杰

客户服务电话:021-962518

网址:www.shzq.com

(13)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:上海市静安区新闸路 669 号 博华大厦 21 楼

法定代表人:贺青

客户服务咨询电话:95521

网址:www.gtja.com

(14)招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人:霍达

客户服务电话:95565

网址:www.newone.com.cn

(15)光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址:上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人: 周健男

客服热线:95525

网址:www.ebscn.com

(16)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 2-6 层

法定代表人:陈共炎

客服电话: 4008888888

网址:www.chinastock.com.cn

(17)中信建投证券股份有限公司

注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址:北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人:王常青

客户服务咨询电话:400-8888-108

网址:www.csc108.com

(18)海通证券股份有限公司

注册地址:上海市广东路 689 号

法定代表人:周杰

客服电话:95553

公司网址:www.htsec.com

(19)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:翁振杰

客户服务电话:4008188118

网址:www.guodu.com

(20)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:张佑君

客户服务热线:95548

公司网址:www.cs.ecitic.com

(21)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:姜晓林

客户服务电话:95548

公司网址:www.sd.citics.com

(22)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:95517

公司网址:www.essence.com.cn

(23)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:李新华

客户服务热线:95579 或 4008-888-999

长江证券客户服务网站:www.95579.com

(24)平安证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层 -64 层

办公地址:深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层 -64 层

法定代表人:何之江

客服电话:95511-8

网址: www.stock.pingan.com

(25)东海证券股份有限公司

注册地址:江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址:上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人:陈耀庭

电话:021-20333333

传真:021-50498825

联系人:王一彦

客服电话:95531;400-8888-588

网址:www.longone.com.cn

(26)诺亚正行基金销售有限公司

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

(27)上海长量基金销售有限公司

注册地址:上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址:上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人:张跃伟

客服电话:400-820-2899

公司网站: www.erichfund.com

(28) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址:北京市朝阳区安苑路 11 号邮电新闻大厦 6 层

法定代表人:闫振杰

客服电话:400-818-8000

公司网站: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:毛淮平

客户服务电话:400-817-5666

(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:上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人:王廷富

客户服务电话:400-799-1888

网址:www.520fund.com.cn

(31)上海基煜基金销售有限公司

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人:王翔

咨询电话:400-820-5369

网站:www.jiyufund.com.cn

(32)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

(33)中信期货有限公司

办公地址:深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层

1301-1305 室、14 层

法定代表人: 张皓

电话:400-990-8826

网站: www.citicsf.com

(34)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

(35)深圳众禄基金销售股份有限公司

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

(36)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五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 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:祖国明

客服电话:400-0766-123

公司网站:www.fund123.cn

(37)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:上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人:其实

客服电话:400-1818-188

网站: www.1234567.com.cn

(38)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

(39)上海陆金所基金销售有限公司

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:胡学勤

客服电话:400-821-9031

网站:www.lufunds.com

(40)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:郑毓栋

客服电话:400-618-0707

网站: www.hongdianfund.com

(41)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

(42)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

(43)北京肯特瑞基金销售有限公司

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/

(44)中证金牛(北京)投资咨询有限公司

注册地址:北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址: 北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人:钱昊旻

客服电话:4008-909-998

网址:www.jnlc.com

(45)奕丰基金销售有限公司

注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人:TEO WEE HOWE

客服电话:400-684-0500

网址:www.ifastps.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:沈兆杰

经办注册会计师:薛竞、沈兆杰

四、基金的概况

基金名称:上投摩根安全战略股票型证券投资基金

基金运作方式:契约性开放式

五、基金的申购费、赎回费和转换费

1、基金申购份额的计算

净申购金额 = 申购金额 /(1+申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

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

通过系统和深入的基本面研究,重点投资于与安全战略相关行业的上市公司,分享中国经济增长模式转变带来的投资机会,在控制风险的前提下力争实现基金资产的稳定增值。

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、货币市场工具、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(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:股票资产占基金资产的 80%-95%,投资于安全战略相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%;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;权证占基金资产净值的 0-3%;每个交易日日终在扣除股指期货保证金后,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%。

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

国家安全战略的目的在于应对国家各领域各方面的安全需求,包括但不限于维护国家主权和领土完整的国防需求;维护社会秩序和人民生命财产安全的公共安全需求;维护社会生产生活要素的环境安全、食品安全和信息安全需求等,因此,可以将国家安全大致归纳为国土及公共安全、环境安全、食品安全以及信息安全等四个方面。本基金所指安全战略相关行业,是指其经营生产内容与上述四方面国家安全需求具有一定相关性的上市公司所属行业。

本基金将通过系统和深入的基本面研究,重点投资于与国家安全战略相关行业的上市公司,分享中国经济增长模式转变带来的投资机会。本基金将不低于 80%的非现金基金资产投资于国家安全战略相关行业。

根据本基金投资理念及投资目标,本基金在中信证券一级行业分类中选取了以下与安全战略主题相关的行业,包括:国防军工、机械、电子元器件、有色金属、基础化工、电力及公用事业、电力设备、食品饮料、农林牧渔、通信、计算机、石油石化、煤炭、医药等。

上述行业内的上市公司将作为本基金的主要投资方向。另外,本基金将通过对安全战略需求变化和行业发展趋势的跟踪研究,适时调整安全战略主题所覆盖的行业范围。此外,本基金将对中信证券行业分类标准进行密切跟踪,若日后该标准有所调整或出现更为科学的行业分类标准,本基金将在审慎研究的基础上,采用新的行业分类标准并重新界定安全战略主题所覆盖的行业范围。

在具体操作上,本基金将主要采用"自下而上"的方法,在备选行业内部通过定量与定性相结合的分析方法,综合分析上市公司的业绩质量、成长性和估值水平等,精选具有良好成长性、估值合理的个股。本基金将首先采用定量的方法分析公司的财务指标,考察上市公司的盈利能力、盈利质量、成长能力、运营能力以及负债水平等方面,初步筛选出财务健康、成长性良好的优质股票。此外,本基金将从公司所处行业的投资价值、核心竞争力、主营业务成长性、公司治理结构、经营管理能力、商业模式、受益于经济转型的程度等多角度对股票进行定性分析。

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—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、行业配置策略

由于安全战略主题涉及多个行业及其子行业,我们将从行业生命周期、行业景气度、行业竞争格局等多角度,综合评估各个行业的投资价值,对基金资产在行业间分配进行安排。

(1)行业景气度分析

行业的景气度受到宏观经济形势、国家产业政策、行业自身基本面等多因素的共同影响,本基金将分析经济周期的不同阶段对各行业的影响,并综合考虑国家产业政策、消费者需求变化、行业技术发展趋势等因素,判断各个行业的景气度。本基金将重点关注景气良好或长期增长前景看好的行业。

(2)行业生命周期分析

本基金将分析各行业所处的生命周期阶段,重点配置处于成长期与成熟期的行业,对处于幼稚期的行业保持积极跟踪,对处于衰退期的行业则予以回避。部分行业从大类行业看处于衰退期,但其中某些细分行业通过创新转型获得新的成长动力,本基金也将对这些细分行业的公司进行投资。

(3)行业竞争格局

主要分析行业的产品研发能力和行业进入壁垒,重点关注具有较强技术研发能力和较高的行业进入壁垒的行业。

4、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,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。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。

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。

7、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。

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 80%-95%,其中不低于 80%的非现金基金资产投资于安全战略相关行业股票;

(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)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该公司可流通股票的 15%;

(5)本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该公司可流通股票的 30%;

(6)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%;

(7)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%;

(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)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%;

(10)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%;

(11)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%;

(12)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%;

(13)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;

(14)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;

(15)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;

(16)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