

上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

基金合同生效日期:2018年1月19日
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
【重要提示】
本基金于【2017】年【8】月【9】日经中国证券监督管理委员会证监许可【2017】1469号文注册。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。
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。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。

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。
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。

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。

本基金的目标客户不包括特定的机构投资者,保证公平对待每一位投资者。
本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金投资管理过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等。

本基金可以参与中小企业私募债券的投资。中小企业私募债券发行为中小、非上市公司,存在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券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。

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,包括但不限于流动性风险、退市风险、投资风险、估值风险、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。

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,属于较高风险收益水平的基金产品。

投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。本招募说明书摘要所载内容截止日为2019年12月28日,及基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2019年9月30日。

二〇二〇年一月

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号震旦国际大厦25层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区富城路99号震旦国际大厦25层
法定代表人:陈兵
总经理:王大智
成立日期:2004年5月12日
实缴资本:贰亿伍仟万元人民币
股东名称、股权结构及持股比例:
上海国际信托投资有限公司 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,基金管理完成了股东之间的股权转让事项。公司注册资本保持不变,股东及出资比例分别为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。

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。

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银行业务行政总裁。
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。
曾任欧洲业务首席副执行官,摩根资产管理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副执行官、资产管理运营委员会成员、集团亚太管理团队负责人。

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: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结构处处长(挂职)、上海国际集团有限公司副总裁,上海国际信托有限公司党委书记。
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兼任总行战略发展部总经理。

董事:丁蔚
硕士研究生。
曾任上海浦东发展银行总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。
独立董事:俞樾
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金融与治理中心主任。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,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、申银万国期货有限责任公司、东海期货有限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:戴立宁
获台湾大学法学硕士学位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:汪祺
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。

2.监事会成员基本情况:
监事会主席:赵峰嵘
硕士研究生,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。
曾任高伟绅律师事务所(香港)任职律师多年。
现任摩根大通集团中国财务总监。
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资产配置证券投资基金(QDII)。

监事:万旉宸
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,尚腾资产管理(香港)有限公司董事。
现任尚腾资产管理(香港)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,消费金融中心总经理,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,获世界经济硕士学位。
曾任华夏兴业基金研究员;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。
历任上海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
基金经理施毓文先生,北京大学经济学硕士,2012年7月起加入上投摩根基金管理有限公司,先后担任助理研究员、研究员/基金经理助理、基金经理,主要承担量化支持方面的工作。自2017年1月至2019年9月担任上投摩根安丰回报混合型证券投资基金基金经理,2017年1月至2018年10月担任上投摩根安泽回报混合型证券投资基金基金经理,自2017年12月起同时担任上投摩根标普港股通低波动红利指数型证券投资基金基金经理,自2018年2月至2019年4月同时担任上投摩根安隆回报混合型证券投资基金基金经理,2018年2月至7月担任上投摩根安腾回报混合型证券投资基金基金经理,2018年4月起同时担任上投摩根富时达市场REITs指数型证券投资基金(QDII)基金经理,2018年9月起同时担任上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金经理,自2019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2019年12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、上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根优选多因子股票型证券投资基金及上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金基金经理。
本基金历任基金经理黄栋,其任职日期为2018年1月19日至2019年12月27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,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;任毅,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,组合基金投资部总监兼投资经理;孟鸣,基金经理兼资深投资组合经理;叶承熹,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

(一)基金托管人基本情况
名称: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
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:陈四清
注册资本:人民币35,640,625,708.9万元
联系电话:010-66105799
联系人:郭明
(二)主要人员情况
截至2019年9月,中国工商银行资产托管部共有员工208人,平均年龄33岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况
作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的技术系统、专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,提供优良的市场形象及影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2019年9月,中国工商银行共托管证券投资基金1006只,自2003年以来,本行连续十六年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的68项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

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(信息截止日至2019年12月10日):
(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
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)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:高国富
客户服务热线:95528
网址:www.spdb.com.cn
(6)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.swhyc.com
(7)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
(8)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
(9)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:上海市静安区新闻路669号博华大厦21楼
法定代表人:杨德红
客户服务咨询电话:95521
网址:www.gtja.com
(10)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
(11)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:周健男
客服热线:95525
网址:www.ebscn.com
(12)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
(13)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.cs.c108.com
(14)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
(15)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:靳庆杰
客户服务电话:4008188118
网址:www.guodun.com
(16)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:张君
客户服务热线:95548
(17)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:姜晓军
客户服务电话:95548
公司网址:www.sd.citics.com
(18)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.aesnc.com.cn
(19)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
长江证券客户服务热线:www.95579.com
(20)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
(21)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
(22)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.niayi-fund.com
(23)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.enhfund.com
(24)北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区后厂峪镇安居福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:闫振刚
客服电话:400-818-8000
公司网站:www.myfund.com
(25)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
(26)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
(27)上海煜星基金销售有限公司
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.jiyfund.com.cn
(28)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
(29)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
(30)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:上海市浦东新区南汇东路1118号鄂尔多斯大厦903-906室
客服电话:400-700-9665
公司网站:www.ehowbuy.com
(31)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J单元
法定代表人:薛峰
客服电话:4006-788-887
公司网站:www.zlfund.com www.jimw.com
(32)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:400-076-6123
公司网站:www.fund123.cn

(33)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
(34)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
(35)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
(36)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
(37)珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区华山路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
(38)北京新浪乐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
(39)北京肯瑞瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市丰台区海润东二街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:4000988511/400888816
网站: http://fund.jd.com/
(40)中金金牛(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号环球财富中心A座5层
法定代表人:钱昊斐
客服电话:4000-909-998
网址:www.jinlc.com
(41)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:上海市浦东新区浦东南路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:刘佳、姜亚卫
四、审计会计师事务所
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:薛雯、沈兆杰

四、基金概况

基金名称:上投摩根量化多因子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
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),或申购费用 = 固定申购费金额
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元以下	1.5%
人民币100元以上(含),500元以下	1.0%
人民币500元以上(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有关规定制定并公告,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
采用量化投资对基金资产进行积极管理,力争获取超越业绩基准的投资收益。

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,包括国内依法发行的上市公司的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市),权证、债券(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、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、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0%-95%,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及股票期权保证金后,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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

本基金通过基金管理人量化投资团队开发的“量化多因子模型”进行股票选择并据此构建股票投资组合。“量化多因子模型”在实际运行过程中将进行定期动态调整,力争股票配置最优化,以期持续超越业绩比较基准收益率的投资目标。