# 上投摩根转型动力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:2013 年 11 月 25 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;基金的过往业绩并不预示其未来表现;

2. 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。

3.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。

4. 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。

5. 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。

6. 本招募说明书摘要所载内容截止日为 2020 年 6 月 10 日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为 2020 年 3 月 31 日。

二零二零年七月

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 楼
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 楼
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投资有限公司 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: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、总行资产负债管理部总经理。
现任上海浦东发展银行总行信息科技部总经理。

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;同时兼任申银万国期货有限责任公司、东海期货有限责任公司、兴业证券股份有限公司、交银国际信托有限公司独立董事和锦江国际集团有限公司外部董事。

独立董事:汪棣
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。

独立董事:王学杰
华东政法大学法学学士、日本帝京大学民商法专业博士前期学位。
曾在日本 Sunroute 公司海外业务室专门从事有关亚太地区市场发展和设立企业的日常法律顾问工作。
现任上海市锦天城律师事务所高级合伙人、律师。

2.监事会成员基本情况:

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。

卢蓉女士,首席信息官
硕士研究生。
曾任第一创业摩根大通证券有限责任公司(现更名为第一创业证券承销保荐有限责任公司)信息技术部负责人、嘉实基金管理有限公司投研体系首席信息官。

5.本基金基金经理

张富盛先生,上海交通大学金融学学士,自 2007 年 8 月至 2010 年 3 月,在德勤华永会计师事务所担任高级税务咨询;自 2010 年 3 月至 2011 年 2 月,在中国国际金融有限公司担任分析师;自 2011 年 2 月至 2015 年 8 月在北京高华证券有限责任公司担任投资研究部经理; 自 2015 年 8 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。自 2018 年 3 月起担任上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自 2019 年 1 月起同时担任上投摩根动力精选混合型证券投资基金基金经理。

本基金的历任基金经理为罗建辉先生, 任职时间为 2013 年 11 月 25 日至 2015 年 1 月 30 日;卢扬先生,任职时间为 2014 年 10 月 30 日至 2016 年 10 月 21 日;孟亮先生,任职时间为 2016 年 10 月 21 日至 2019 年 3 月 29 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

(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)6759 5096

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)。

2018 年末,集团资产规模 23.22 万亿元,较上年增长 4.96%。2018 年度,集团实现净利润 2,556.26 亿元,较上年增长 4.93%;平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13%和 14.04%;不良贷款率 1.46%,保持稳中有降;资本充足率 17.19%,保持领先同业。

2018 年,本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》"2018 年中国最佳大型零售银行奖"、"2018 年中国全面风险管理成就奖";美国《环球金融》"全球贸易金融最具创新力银行"、《银行家》"2018 最佳金融创新奖"、《金融时报》"2018 年金龙奖一年度最佳普惠金融服务银行"等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志"2018 年中国最佳银行"称号,并在中国银行业协会 2018 年"陀螺"评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室,在安徽合肥设有托管运营中心,在上海设有托管运营中心上海分中心,共有员工 300 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

蔡亚蓉,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职,并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),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。

黄秀莲,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),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。

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。

原玎,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、存托业务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 2019 年二季度末, 中国建设银行已托管 924 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。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》"中国最佳托管银行"、4 次获得《财资》"中国最佳次托管银行"、连续 5 年获得中债登"优秀资产托管机构"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"、在 2017 年荣获《亚洲银行家》"最佳托管系统实施奖"。

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: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:上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址:上海市浦东新区银城中路 188 号
法定代表人:任德奇
电话:021-58781234
传真:021-58408483
联系人:王菁
客户服务热线:95559
公司网址: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)中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街 9 号
法定代表人:李庆萍
24 小时客户服务热线: 95558
网址:www.citicbank.com

(9)平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址:深圳市罗湖区深南东路 5047 号
法定代表人:谢永林
客户服务统一咨询电话:95511 转 3
网址:www.bank.pingan.com

(10)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

(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:杨玉成
客服电话:95523
网址: www.swhysc.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: 闫峻(代行)
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)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
客户服务电话: 95536
公司网址:www.guosen.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:张佑君
客户服务热线:95548
公司网址:www.cs.ecitic.com

(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:姜晓林
客户服务电话:95548
公司网址:www.sd.citics.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:黄炎勋
客服电话:95517
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: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

(25)平安证券股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层
办公地址: 深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层
法定代表人:何之江
客服电话:95511-8
网址: www.stock.pingan.com

(26)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:钱俊文
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

(27)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

(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
注册地址: 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
办公地址: 北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层
法定代表人: 赵学军
客服电话: 400-021-8850
公司网址: www.harvestwm.cn

(33)东亚银行(中国)有限公司
办公地址:上海浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 29 楼
法定代表人:李国宝
客服电话:95382
网站:www.hkbea.com.cn

(34)国金证券股份有限公司
办公地址:成都市青羊区东城根上街 95 号
法定代表人:冉云
电话:95310
网址:www.gjzq.com.cn

(35)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

(36)中国人寿保险股份有限公司
办公地址:中国北京市西城区金融大街 16 号
法定代表人:王滨
客服电话:95519
公司网址:www.e-chinalife.com

(37)中信证券华南股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层
办公地址:广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层
法定代表人:胡伏云
客户服务热线:95396
公司网址:www.gzs.com.cn

(38)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

(39)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

(40)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

(41)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

(42)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

(43)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

(44)北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室
法定代表人:何静
客服电话:400-618-0707
网站: www.hongdianfund.com

(45)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

(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)北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157
办公地址: 北京市通州亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 15 层
法定代表人: 王苏宁
客服电话:95118
网址: kenterui.jd.com

(48)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

(49)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

(50)北京百度百盈基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101
办公地址:北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼
法定代表人:葛新
客户服务热线:95055
公司网站:www.baiyingfund.com

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,并在基金管理人网站公示。

(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:021-5115 0298
传真:021-5115 0398
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:沈兆杰
经办注册会计师:薛竞、沈兆杰

四、基金概况

基金名称:上投摩根转型动力混合型证券投资基金
基金类别:混合型证券投资基金
运作方式:契约型开放式

五、基金份额的申购、赎回和转换

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 | 1.5% |
| 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 |
|---|---|
| 七日以内 | 1.5% |
| 七日以上(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

通过投资于符合政策扶植和经济发展方向, 具有长期发展潜力的上市公司,充分把握中国未来经济转型带来的投资机会, 力争实现基金资产的长期稳健增值。

(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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含中期票据、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债等)、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(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%-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%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持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%, 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

中国经济已进入新的发展阶段, 经济转型将是中国经济发展的必经之路,产业结构的调整以及发展方式的转变将带来新的投资机会, 符合经济发展方向、获得政策扶持的行业和公司能够分享经济转型带来的红利。本基金将以经济转型作为行业配置和个股选择的主线,重点投资于受益于经济转型和政策扶持、具有良好基本面和持续成长能力的上市公司,力争实现基金资产的长期稳定增值。

1、资产配置策略

本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法,在股票、债券和现金等资产类别之间进行相对灵活的配置,强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析的有机结合进行前瞻性的决策。

本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,预测宏观经济的发展趋势,并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率,主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例,动态优化投资组合,以规避或控制市场风险,提高基金收益率。

2、行业配置策略

在行业配置层面,本基金将运用"自上而下"的方法,通过对国内外宏观经济、经济结构转型的方向、国家经济政策、产业政策导向的深入研究,挖掘受益于国家经济转型、具有较大成长空间的行业。具体而言,本基金将持续关注国家财政及货币政策等宏观经济政策、产业振兴计划等政府产业政策导向,深入分析相关政策对行业结构所产生的影响,筛选出符合政策扶持方向、代表未来经济发展方向的行业。

在此基础上,本基金将对影响行业发展的内外部因素进行分析预测,重点分析行业基本面情况、行业所处生命周期、行业景气度、行业内外竞争格局、行业盈利前景及成长空间等,在此基础上判断行业的可持续发展能力,从而确定本基金的行业配置。

3、股票投资策略

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。

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。

(4)流动性管理:本基金通过紧密关注申购/赎回现金流情况、季节性资金流动、日历效应等,建立组合流动性预警指标,实现对基金资产的结构化管理,以确保基金资产的整体变现能力。

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、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,将通过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。

8、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。

(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%-95%;
(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%;
(8)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%;
(9)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%;
(10) 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%;
(11)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;
(12)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;
(13) 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;
(14) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%;

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(15) 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;
(16)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%;
(17)本基金在任何交易日日终,持有的买入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;
(18)本基金在任何交易日日终,持有的卖出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;
(19)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)占基金资产的 0%-95%;
(20)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%;
(21)本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当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, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

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;
(22) 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%;
(23) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;
(24) 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%;
(25) 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%;
(26)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、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,除上述第(11)、(14)、(21)、(23)项外,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。

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。

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)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。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(五) 业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%

沪深 300 指数是中证指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数,是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好,同时公信力较好的股票指数,适合作为本基金股票投资的比较基准。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地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。

(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 ,属于较高风险收益水平的基金产品。

根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》,基金管理人和相关销售机构已对本基金重新进行风险评级,风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征,但由于风险等级分类标准的变化,本基金的风险等级表述可能有相应变化,具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

(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 | 419,715,196.56 | 79.14 |
| | 其中:股票 | 419,715,196.56 | 79.14 |
| 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 | 110,071,601.17 | 20.76 |
| 7 | 其他各项资产 | 544,938.44 | 0.10 |
| 8 | 合计 | 530,331,736.17 | 100.00 |

2、报告期末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 | 8,924,874.09 | 1.69 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 331,539,370.02 | 62.87 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 5,723,588.46 | 1.09 |
| F | 批发和零售业 | 13,232,955.61 | 2.51 |
| 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 | 11,715,096.10 | 2.22 |
| J | 金融业 | 5,350,891.21 | 1.01 |
| K | 房地产业 | 15,086,274.18 | 2.86 |
| L | 租赁和商务服务业 | 4,475,520.00 | 0.85 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 17,683,056.18 | 3.35 |
| 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 | 5,983,570.71 | 1.13 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 419,715,196.56 | 79.59 |

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

| 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 | 300750 | 宁德时代 | 288,105 | 34,684,960.95 | 6.58 |
| 2 | 300014 | 亿纬锂能 | 508,841 | 29,568,750.51 | 5.61 |
| 3 | 002475 | 立讯精密 | 719,382 | 27,451,617.12 | 5.21 |
| 4 | 000661 | 长春高新 | 40,000 | 21,920,000.00 | 4.16 |
| 5 | 002594 | 比亚迪 | 331,700 | 19,892,049.00 | 3.77 |
| 6 | 600276 | 恒瑞医药 | 205,500 | 18,912,165.00 | 3.59 |
| 7 | 603259 | 药明康德 | 193,760 | 17,533,342.40 | 3.32 |
| 8 | 601012 | 隆基股份 | 677,100 | 16,819,164.00 | 3.19 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 14,300 | 15,887,300.00 | 3.01 |
| 10 | 000876 | 新 希 望 | 504,600 | 15,859,578.00 | 3.01 |

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序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序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序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 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。

11.2 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。

11.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 409,182.67 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 28,118.39 |
| 5 | 应收申购款 | 107,637.38 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 544,938.44 |

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 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无流通受限情况。

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 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2013 年 11 月 25 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日 | 0.40% | 0.09% | -2.30% | 0.82% | 2.70% | -0.73% |
| 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 | -7.57% | 1.19% | 42.82% | 0.97% | -50.39% | 0.22% |
| 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 96.66% | 2.79% | 5.37% | 1.99% | 91.29% | 0.80% |
| 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | -25.81% | 1.82% | -9.39% | 1.12% | -16.42% | 0.70% |
| 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 27.47% | 1.31% | 16.57% | 0.51% | 10.90% | 0.80% |
| 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | -38.35% | 1.71% | -19.01% | 1.07% | -19.34% | 0.64% |
| 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 58.08% | 1.28% | 29.07% | 0.99% | 29.01% | 0.29% |
| 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 31 日 | 4.82% | 2.36% | -7.50% | 1.55% | 12.32% | 0.81% |

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;
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用,但法律法规、中国证监会另有规定的除外;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、证券账户开户费用、银行账户维护费用;
9、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

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×1.5%÷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×0.25%÷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。

上述"一、基金费用的种类中第 3-8 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)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

九、其他应披露事项

上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金于 2013 年 11 月 25 日成立。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》、《公开募集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 2020 年 4 月 15 日公告的《上投摩根转型动力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、在重要提示中,更新内容截止日为 2020 年 6 月 10 日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为 2020 年 3 月 31 日。
2、在"二、释义"中,对银行业监督管理机构的定义进行了更新。
3、在"三、基金管理人"的"主要人员情况"中,对董事、独立董事、监事及高级管理人员的信息进行了更新。
4、在"三、基金管理人"的"内部控制制度"中,对基金管理人的风险管理体系的信息进行了更新。
5、在"四、基金托管人"中,对基金托管人的信息进行了更新。
6、在"五、相关服务机构"中,更新了代销机构的相关信息。
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"八、基金的投资"的"风险收益特征"中,对风险收益特征进行了补充说明。
9、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。
10、在"十六、风险揭示"中,新增了有关科创板股票的投资风险披露。
11、在"二十二、其他应披露事项"中,列示了报告期内需披露的与基金运作有关的重大事项。

上投摩根基金管理有限公司
2020 年 7 月