

上投摩根轮动添利债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

重要提示：
1. 投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书;
2. 基金的过往业绩并不预示其未来表现;
3. 本招募说明书依据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准...

一、基金管理人
(一)基金管理人概况
1. 基金管理人名称:上投摩根基金管理有限公...
2. 基金管理人住所:上海浦东新区富城路99号...
3. 基金管理人法定代表人:陈开元

二、基金托管人
(一)基金托管人概况
1. 基金托管人名称:中国建设银行股份有限公司
2. 基金托管人住所:北京市西城区金融大街25号
3. 基金托管人法定代表人:王洪章

三、基金的募集
(一)募集基本情况
1. 基金募集日期:2013年2月4日
2. 基金募集规模:人民币100亿元

四、基金的投资
(一)投资目标
本基金在有效控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极主动的资产管理,追求基金资产的长期稳定增值...

(二)投资范围
本基金投资于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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市...)

(三)投资策略
本基金采取自上而下的资产配置策略,通过对国内外宏观经济运行状况、财政状况与货币政策走向、市场利率走势...)

(四)业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证全债指数收益率*60%+沪深300指数收益率*40%

(五)风险收益特征
本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,预期风险和预期收益高于货币市场基金...

(六)基金管理人职责
1. 依法募集基金,办理基金份额的发售和申购、赎回业务;
2. 办理基金备案手续;

(七)基金费用
1. 基金管理费:按前一日基金资产净值0.8%的年费率计提;
2. 基金托管费:按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提;

(八)基金收益分配
1. 基金收益分配原则:本基金收益分配应遵循基金份额持有人利益优先原则;
2. 基金收益分配对象:本基金收益分配对象为基金份额持有人;

(九)基金转换
1. 基金转换业务规则:投资者可在同一基金管理人管理的不同基金之间进行转换;
2. 基金转换费用:基金转换费用由转出基金的赎回费用和转入基金的手续费组成;

(十)基金申购与赎回
1. 申购赎回原则:“未知价”原则、“金额申购、份额赎回”原则;
2. 申购赎回费率:申购费率随申购金额增加而递减;

(十一)基金销售
1. 基金销售机构:包括直销机构和代销机构;
2. 基金销售费用:包括销售服务费、申购赎回费等;

(十二)基金合同
1. 基金合同生效:基金募集达到法定人数且验资合格;
2. 基金合同变更:须经基金份额持有人大会决议;

(十三)基金终止
1. 基金终止情形:基金资产净值连续60个工作日低于0.5亿元;
2. 基金终止程序:由基金管理人召集基金份额持有人大会;

(十四)基金信息披露
1. 信息披露义务人:基金管理人、基金托管人;
2. 信息披露原则:真实性、准确性、完整性、及时性、公平性;

(十五)基金合同争议解决
1. 争议解决方式:仲裁;
2. 仲裁机构:上海国际经济贸易仲裁委员会;

(十六)基金合同摘要
1. 基金合同摘要:包括基金合同全文摘要;
2. 基金合同摘要索取:投资者可向基金管理人索取;

(十七)基金合同全文
1. 基金合同全文:包括基金合同全文;
2. 基金合同全文索取:投资者可向基金管理人索取;

(十八)基金合同全文
1. 基金合同全文:包括基金合同全文;
2. 基金合同全文索取:投资者可向基金管理人索取;

(十九)基金合同全文
1. 基金合同全文:包括基金合同全文;
2. 基金合同全文索取:投资者可向基金管理人索取;

(二十)基金合同全文
1. 基金合同全文:包括基金合同全文;
2. 基金合同全文索取:投资者可向基金管理人索取;

(二十一)基金合同全文
1. 基金合同全文:包括基金合同全文;
2. 基金合同全文索取:投资者可向基金管理人索取;

基金合同生效日期:2013年2月4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

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:95599
网址:www.bankcomm.com
(6) 上海浦东东复路200号
(7) 上海浦东新区世纪大道1588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:95599
网址:www.bankcomm.com
(6) 上海浦东东复路200号
(7) 上海浦东新区世纪大道1588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:95599
网址:www.bankcomm.com
(6) 上海浦东东复路200号
(7) 上海浦东新区世纪大道1588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:95599
网址:www.bankcomm.com
(6) 上海浦东东复路200号
(7) 上海浦东新区世纪大道1588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:95599
网址:www.bankcomm.com
(6) 上海浦东东复路200号
(7) 上海浦东新区世纪大道1588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:95599
网址:www.bankcomm.com
(6) 上海浦东东复路200号
(7) 上海浦东新区世纪大道1588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:95599
网址:www.bankcomm.com
(6) 上海浦东东复路200号
(7) 上海浦东新区世纪大道1588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:95599
网址:www.bankcomm.com
(6) 上海浦东东复路200号
(7) 上海浦东新区世纪大道1588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:95599
网址:www.bankcomm.com
(6) 上海浦东东复路200号
(7) 上海浦东新区世纪大道1588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:95599
网址:www.bankcomm.com
(6) 上海浦东东复路200号
(7) 上海浦东新区世纪大道1588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:95599
网址:www.bankcomm.com
(6) 上海浦东东复路200号
(7) 上海浦东新区世纪大道1588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:95599
网址:www.bankcomm.com
(6) 上海浦东东复路200号
(7) 上海浦东新区世纪大道1588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:95599
网址:www.bankcomm.com
(6) 上海浦东东复路200号
(7) 上海浦东新区世纪大道1588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:95599
网址:www.bankcomm.com
(6) 上海浦东东复路200号
(7) 上海浦东新区世纪大道1588号

(4) 注册地址:北京一路西路
(5) 办公地址:北京市西城区车公庄大街9号...
(6) 法定代表人:吴尚志

基金管理人可根据相关法律法规的要求,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)
名称:上海海泰律师事务所
注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号...
负责人:李海

四、基金概况
(一)基金名称:上投摩根轮动添利债券型证券投资基金
(二)基金运作方式:契约型开放式
(三)基金的组织形式:有限责任公司
(四)基金的投资目标
本基金在有效控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极主动的资产管理,追求基金资产的长期稳定增值...

五、基金的申购费、赎回费和转换费
1. 基金申购费用 = (申购金额 × 申购费率) / (1 + 申购费率)
2. 基金赎回费用 = (赎回金额 × 赎回费率) / (1 + 赎回费率)
3. 基金转换费用 = 净申购金额 - 申购费用 - 申购费用

六、基金的投资
(一)投资目标
本基金在有效控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极主动的资产管理,追求基金资产的长期稳定增值...

(二)投资范围
本基金投资于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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市...)

(三)投资策略
本基金采取自上而下的资产配置策略,通过对国内外宏观经济运行状况、财政状况与货币政策走向、市场利率走势...)

(四)业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证全债指数收益率*60%+沪深300指数收益率*40%

(五)风险收益特征
本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,预期风险和预期收益高于货币市场基金...

(六)基金管理人职责
1. 依法募集基金,办理基金份额的发售和申购、赎回业务;
2. 办理基金备案手续;

(七)基金费用
1. 基金管理费:按前一日基金资产净值0.8%的年费率计提;
2. 基金托管费:按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提;

(八)基金收益分配
1. 基金收益分配原则:本基金收益分配应遵循基金份额持有人利益优先原则;
2. 基金收益分配对象:本基金收益分配对象为基金份额持有人;

(九)基金转换
1. 基金转换业务规则:投资者可在同一基金管理人管理的不同基金之间进行转换;
2. 基金转换费用:基金转换费用由转出基金的赎回费用和转入基金的手续费组成;

(十)基金申购与赎回
1. 申购赎回原则:“未知价”原则、“金额申购、份额赎回”原则;
2. 申购赎回费率:申购费率随申购金额增加而递减;

(十一)基金销售
1. 基金销售机构:包括直销机构和代销机构;
2. 基金销售费用:包括销售服务费、申购赎回费等;

(十二)基金合同
1. 基金合同生效:基金募集达到法定人数且验资合格;
2. 基金合同变更:须经基金份额持有人大会决议;

(十三)基金终止
1. 基金终止情形:基金资产净值连续60个工作日低于0.5亿元;
2. 基金终止程序:由基金管理人召集基金份额持有人大会;

(十四)基金信息披露
1. 信息披露义务人:基金管理人、基金托管人;
2. 信息披露原则:真实性、准确性、完整性、及时性、公平性;

(十五)基金合同争议解决
1. 争议解决方式:仲裁;
2. 仲裁机构:上海国际经济贸易仲裁委员会;

(十六)基金合同摘要
1. 基金合同摘要:包括基金合同全文摘要;
2. 基金合同摘要索取:投资者可向基金管理人索取;

(十七)基金合同全文
1. 基金合同全文:包括基金合同全文;
2. 基金合同全文索取:投资者可向基金管理人索取;

(十八)基金合同全文
1. 基金合同全文:包括基金合同全文;
2. 基金合同全文索取:投资者可向基金管理人索取;

(十九)基金合同全文
1. 基金合同全文:包括基金合同全文;
2. 基金合同全文索取:投资者可向基金管理人索取;

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活动:
(1)承销证券;
(2)向他人贷款或者提供担保;

(3)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;
(4)依照法律法规规定,由中国证监会规定禁止的其他活动;
(5)法律法规及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。

中信标普全球指数涵盖了在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间债券市场交易、剩余期限在一年以上、面值余额在一亿元以上、信用评级在投资级以上、国债、企业债、可转债和黄金等,具有一定的投资代表性,基于该指数的权重和代表,以及本基金的投资范围和理念,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。

若未来市场发生变化导致业绩基准不再适用或本基金,基金管理人可根据市场发展状况及本基金的资产配置和业绩比较基准的业绩比较基准,业绩基准的变更须经基金管理人(基金托管人)协商一致,并报中国证监会备案,基金管理人应在调整前2个工作日内至少一种中国证监会指定媒体上公告,并在更新的招募说明书中列明。

(六)风险控制特征
本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于股票型基金和股票基金。

(七)基金管理人代表基金份额持有人行使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份额持有人行使股东权利,保护基金份额持有人的利益;
2. 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;

(八)基金的融资、融券
本基金可以根据国家的有关规定进行融资融券。
(九)报告期末基金资产组合情况
(一)报告期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

注:截至2014年6月30日,上投摩根轮动添利债券型证券投资基金资产净值为294,214,772.82元,上投摩根添利基金A类份额净值为0.957元,累计基金份额净值为0.957元;上投摩根轮动添利基金C类份额净值为0.957元,累计基金份额净值为0.957元。

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末持有股票:
(三)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

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

(五)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
(六)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
(七)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

(八)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
(九)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(十)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(十一)投资组合报告附注
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、通报批评等情况;
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;

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
(一)基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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。

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五名债券投资明细
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十名资产支持证券投资明细

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
(九)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(十)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(十一)投资组合报告附注
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、通报批评等情况;
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;

Table with 5 columns: 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, ①-③, ②-④

7.基金投资组合报告
(一)基金投资组合报告
1. 报告期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 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, ①-③, ②-④

8.基金投资组合报告
(一)基金投资组合报告
1. 报告期末基金资产组合情况

(二)基金投资组合报告
1. 报告期末基金资产组合情况

(三)基金投资组合报告
1. 报告期末基金资产组合情况

(四)基金投资组合报告
1. 报告期末基金资产组合情况

(五)基金投资组合报告
1. 报告期末基金资产组合情况

上投摩根基金管理有限公司
2014年9月17日