上投摩根强化回报债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

基金合同生效日期:2011 年 8 月 10 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。
4. 本招募说明书所载内容截止日为 2014 年 8 月 9 日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为 2014 年 6 月 30 日。

二零一四年九月

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:上海市浦东富城路 99 号震旦国际大楼 20 层
办公地址:上海市浦东富城路 99 号震旦国际大楼 20 层
法定代表人:陈开元
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%
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:

陈开元先生,董事长
大学本科学历。
先后任职于上海市财政局第三分局,共青团上海市财政局委员会,英国伦敦 Coopers & Lybrand 咨询公司等,曾任上海市财政局对外经济财务处处长、上海国际集团有限公司副总经理,现任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:许立庆
台湾政治大学工商管理硕士学位。
曾任摩根富林明台湾业务总经理、摩根资产管理亚太区行政总裁。
现任怡和（中国）有限公司主席、怡和管理有限公司董事;香港商会中国委员会副主席;富时台湾交易所台湾系列五十指数咨询委员会主席。

董事:Jed Laskowitz
获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。
曾负责管理 J.P Morgan 集团的美国基金业务。
现任摩根资产管理亚洲基金行政总裁及亚太区投资管理业务总监;J.P Morgan 集团投资管理及环球基金营运委员会成员;美国资金管理协会（MMI）董事会成员;纽约州大律师公会会员。

董事:杨德红
获复旦大学经济学学士,中欧工商管理学院 MBA。
现任上海国际集团有限公司副总经理。

董事:林彬
获中欧工商管理学院 MBA。
曾任香港沪光国际投资管理有限公司副总经理。
现任上海国际信托有限公司副总经理。

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机构处处长（挂职）、上海国际集团有限公司总裁助理。
现任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、董事长。

董事:章硕麟
获台湾大学商学硕士学位。
曾任怡富证券（台湾）投资顾问股份有限公司协理、摩根大通（台湾）证券副总经理、摩根富林明（台湾）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:
独立董事:周道炯
大学专科学历,曾就学于安徽省委马列夜大学、中共安徽省委中级党校进修班、中共中央高级党校培训班。
曾任中国证监会主席、中国建设银行行长、九届全国人大财经委委员。
现任 PECC 中国金融市场发展委员会顾问。周道炯先生长期从事证券金融市场监管工作,目前作为高级顾问为证券市场改革提供顾问咨询意见。

独立董事:刘红忠
国际金融系经济学博士,现任复旦大学国际金融系教授及系主任、中国金融学会理事、中国国际金融学会理事和上海市金融学会理事。

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。
历任台湾财政部常务次长。
现任台湾东吳大学法律研究所兼任副教授。

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:

监事长:郁忠民
研究生毕业,高级经济师。
历任华东政法学院法律系副主任;上海市证券管理办公室稽查处、机构处处长;上海国际集团有限公司投资管理部经理;上海证券有限责任公司副董事长、总经理、党委副书记。
现任上海国际集团金融管理总部总经理。

监事:Simon Walls
获伦敦大学帝国理工学院的数学学士学位。
历任 JPMorgan Asset Management（Japan）Ltd 总裁、首席运营官;JPMorgan Trust Bank 总裁、首席运营官以及基础架构总监。
现任摩根资产管理日本董事长以及投资管理亚洲首席行政官。

监事:张军
曾任上投摩根基金管理有限公司交易部总监。
现任上投摩根亚太优势股票型证券投资基金和上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金基金经理。

监事:万隽宸
曾任上海国际集团有限公司高级法务经理。
现任上投摩根基金管理有限公司总经理助理、风险管理部总监。

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（台湾）投资顾问股份有限公司协理、摩根大通（台湾）证券副总经理、摩根富林明（台湾）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。

4.其他高级管理人员情况:

侯明甫先生,副总经理。
毕业于台湾中国文化大学,获企业管理硕士。曾任职于台湾金鼎证券公司、摩根富林明（台湾）证券投资顾问股份有限公司、摩根富林明（台湾）证券股份有限公司、摩根富林明证券投资信托股份有限公司,主要负责证券投资研究、公司管理兼投资相关业务管理。

经晓云女士,副总经理。
上海财经大学工商管理硕士,曾任职于上海证券（原上海财政证券）,先后担任总经理办公室副主任（主持工作）,市场管理部经理,经纪管理总部副总经理、总经理,负责证券经纪业务的管理和运作。

冯刚先生,副总经理。
北京大学管理科学硕士。曾任职于长城证券、华安基金和华泰联合证券（原联合证券）,从事投资银行、投资顾问和投资管理等相关工作;2004 年至 2010 年,任职于华宝兴业基金,先后任基金经理、国内投资部总经理。

陈星德先生,副总经理。
毕业于中国政法大学,获法学博士学位。曾任职于江苏省人大常委会、中国证监会、瑞士银行环球资产管理（香港）、国投瑞银基金管理有限公司,并曾担任上投摩根基金管理有限公司督察长一职。

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。

刘万方先生,督察长。
获经济学博士学位。曾任职于中国普天信息产业集团公司、美国 MBP 咨询公司、中国证监会。

5.本基金基金经理

基金经理,杨成先生,上海财经大学管理学硕士研究生,7 年证券、基金从业经验。2007 年至 2010 年期间任信诚基金管理有限公司固定收益分析师。2010 年 2 月起加入上投摩根基金管理有限公司,任基金经理助理。主要负责固定收益方面投研究的相关工作;2011 年 8 月起任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理,2013 年 2 月至 2014 年 3 月担任上投摩根轮动添利债券型证券投资基金基金经理,2013 年 7 月起任上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金经理,2013 年 12 月起同时任上投摩根双债增利债券型证券投资基金基金经理。

基金经理,赵峰先生,毕业于上海财经大学金融学专业,硕士学位,自 2003 年 4 月至 2006 年 5 月在申银万国证券研究所担任研究员负责债券研究方面的工作;自 2006 年 6 月至 2011 年 3 月在富国基金管理有限公司担任投资经理负责债券投资方面的工作;2011 年 4 月起加入上投摩根基金管理有限公司,担任固定收益部总监助理,主要负责固定收益产品研究方面的相关工作。自 2011 年 9 月 8 日起担任本基金基金经理;自 2012 年 6 月起同时担任上投摩根分红添利债券型证券投资基金基金经理,2013 年 7 月起任上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金经理,2013 年 8 月起同时任上投摩根岁岁金定期开放债券型证券投资基金基金经理,自 2014 年 6 月起同时任上投摩根优信增利债券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

冯刚先生,副总经理兼 A 股投资总监;侯明甫先生,副总经理;杨逸枫女士,投资副总监;王炫先生,研究部总监;王孝德先生,基金经理;董红波先生,基金经理;罗建辉先生,基金经理;张军先生,基金经理;杜猛先生,基金经理;孙芳女士,基金经理;孟晨波女士,货币市场投资部总监;赵峰先生,债券投资部总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人概况

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:王洪章
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
中国建设银行拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立,1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码:939）于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日,中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486 股（包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股）。

截至 2013 年 12 月 31 日,中国建设银行资产总额 153,632.10 亿元,较上年增长 9.95%;客户贷款和垫款总额 85,900.57 亿元,增长 14.35%;客户存款总额 122,230.37 亿元,增长 7.76%。营业收入 5,086.08 亿元,较上年增长 10.39%,其中,利息净收入增长 10.29%,净利息收益率（NIM）为 2.74%;手续费及佣金净收入 1,042.83 亿元,增长 11.52%,占营业收入比重为 20.50%。成本费用开支得到有效控制,成本收入比为 29.65%。实现利润总额 2,798.06 亿元,较上年增长 11.28%;净利润 2,151.22 亿元,增长 11.12%。资产质量保持稳定,不良贷款率 0.99%,拨备覆盖率 268.22%;资本充足率与核心一级资本充足率分别为 13.34%和 10.75%,保持同业领先。

中国建设银行在中国内地设有分支机构 14,650 个,服务于 306.54 万公司客户、2.91 亿个人客户,与中国经济战略性行业的主导企业和大量高端客户保持密切合作关系;在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、大阪、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、墨尔本、台北、卢森堡设有海外分行,拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建行欧洲、建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿等多家子公司。

2013 年,本集团的出色业绩与良好表现受到市场与业界的充分认可,先后荣获国内外 102 项奖项,多项综合排名进一步提高,在英国《银行家》杂志“全球银行 1000 强排名”中位列第 5,较上年上升 2 位;在美国《福布斯》杂志发布的“2013 年度全球上市公司 2000 强排名”中,位列第 2,较上年上升 13 位。此外,本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、养老金、国际业务、电子商务和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部,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、监督稽核处等 9 个职能处室,在上海设有投资托管服务上海各分中心,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。

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:王洪章
客户服务电话:95533
传真:010-66275654

（2）中国农业银行股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址:北京市东城区建国门内大街 69 号
法定代表人:蒋超良
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com

（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 号客户服务电话:95566
法定代表人:田国立
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
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:牛锦明
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: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

（7）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）62629999
传真:（021）62569070 客服电话:95561
网址:www.cib.com.cn

（8）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:范一飞
联系电话:021-68475888
传真:021-68476111
客户服务热线:021-962888
网址:www.bankofshanghai.com

（9）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 8 号富华大厦 C 座
法定代表人:孔丹
24 小时客户服务热线:95558
网址:bank.ecitic.com

（10）中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街 2 号
法定代表人:董文标
24 小时客户服务热线:95568
网址:www.cmbc.com.cn

（11）华夏银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街 22 号
办公地址:北京市东城区建国门内大街 22 号
法定代表人:吴建
客户咨询电话:95577
网址:www.hxb.com.cn

（12）北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街甲 17 号首层
办公地址:北京市西城区金融大街丙 17 号
法定代表人:闫冰竹
电话:010-66223584
传真:010-66226045
客户服务电话:95526
公司网站:www.bankofbeijing.com.cn

（13）宁波银行股份有限公司
注册地址:宁波市鄞州区宁南南路 700 号
法定代表人:陆华裕
客户服务统一咨询电话:96528（上海、北京地区 962528）
网址:www.nbcb.com.cn

（14）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

（15）东莞农村商业银行股份有限公司
注册地址:东莞市南城路 2 号
办公地址:东莞市南城路 2 号
法定代表人:何沛良
客服电话:961122
网址:www.drcbank.com

（16）上海农村商业银行股份有限公司
注册地址:中国上海市浦东新区浦东大道 981 号
办公地址:上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-20、21-23 层
法定代表人:胡平西
门户网站:www.srcb.com
客户服务电话:021-962999

（17）中银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路 171 号
法定代表人:储晓明
电话:021-54033888
传真:021-54038844
客户服务电话:021-962505
网址:www.sywg.com

（18）上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路 336 号
法定代表人:龚德雄
电话:021-53519888
传真:021-53519888
客户服务电话:4008918918（全国）、021-962518
网址:www.962518.com

（19）国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路 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:万建华
联系人:丙敏祺
电话:（021）38676666 转 6161
传真:（021）38670161
客户服务咨询电话:400-8888-666
网址:www.gtja.com

（20）广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
统一客户服务热线:95575 或致电各地营业网点
公司网站:http://www.gf.com.cn

（21）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

（22）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:袁长清（代行）
电话:021-22169999
传真:021-22169134
联系人:刘晨
网址:www.ebsn.com

（23）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

（24）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

（25）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:谢商得
客户服务热线:95562
公司网站:www.xyzq.com.cn

（26）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

（27）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:齐晓燕
客户服务电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn

（28）国都证券有限责任公司
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:黄静
客户服务电话:4008188118
网址:www.guodu.com

（29）华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
客户咨询电话:025-84579897
联系电话:025-84457777-248
网址:www.htsc.com.cn

（30）中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市招商银行大厦 A 层
办公地址:北京朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 20
法定代表人:王东明
电话:010-84588888
传真:010-84865560
客户服务热线:010-95558

（31）东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层
法定代表人:潘鑫军
电话:021-63325888
传真:021-63326173
客户服务热线:95503
东方证券网站:www.dfzq.com.cn

（32）中信证券（浙江）有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层
法人代表:沈强
联系电话:0571-95548
公司网站:www.bigsun.com.cn
客户服务中心电话:0571-95548

（33）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

（34）华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层
办公地址:福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层
法定代表人:黄金琳
联系电话:0591-87383623
业务传真:0591-87383610
联系人:张腾
客户服务热线:0591-96326
公司网址:www.hfzq.com.cn

（35）中国国际金融有限公司
注册地址:北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
办公地址:北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
法定代表人:金立群
电话:010-65051166
传真:010-65058065
公司网址:www.cicc.com.cn
电话:021-58881690

（36）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:牛冠兴
客服电话:4008001001
公司网址:www.essence.com.cn

（37）财富里昂证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道 100 号 环球金融中心 9 楼
法定代表人:罗浩
电话:021-38784818
传真:021-68775878
联系人:倪丹
客户服务电话:68777877
公司网站:www.cf-clsa.com

（38）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

（39）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室
办公地址:上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室
法定代表人:汪静波
客服电话:400-821-5399
公司网站:www.noah-fund.com

（40）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

（41）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 1-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 1-J 单元
法定代表人:薛峰
客服电话:4006-788-887
公司网站:www.zlfund.cn 或 www.jjmmw.com

（42）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:敖泠
联系电话:021-58788678-8201
传真:021—58787698
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.erichfund.com

（43）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

（44）杭州数米基金销售有限公司
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼
法定代表人:陈柏青
客服电话:400-0766-123
公司网站:www.fund123.cn

（45）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

（46）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

（47）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

（48）一路财富（北京）信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702
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

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:国浩律师集团（上海）事务所
注册地址:上海市南京西路 580 号南证大厦 45 楼
负责人:倪俊骥
联系电话:021-52341668
传真:021-52341670
经办律师:宣伟华

（四）会计师事务所:

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址: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:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
法定代表人:吴港平
联系电话:8621-61233277
联系人:汪建
经办注册会计师:汪建、王灵

四、基金概况

基金名称:上投摩根强化回报债券型证券投资基金
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）
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:
A 类基金份额

申购金额区间	费率
人民币 100 万以下	0.8%
人民币 100 万以上（含）,500 万以下	0.4%
人民币 500 万以上（含）	每笔人民币 1,000 元

B 类基金份额的申购费率为 0
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:
A 类基金份额赎回费率

持有基金份额期限	费率
小于一年	0.1%
大于等于一年小于二年	0.05%
大于等于二年	0

B 类基金份额赎回费率

持有基金份额限制	费率
小于三十天	0.1%
大于等于三十天	0

3、基金转换
基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记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本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
本基金在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上,通过主动管理,力争获得超越业绩比较基准的投资收益率,实现基金资产的长期稳定增值。

（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,包括股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证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的相关规定。
本基金主要投资于国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购等固定收益品种。本基金可以参与一级市场新股申购或增发新股,以及在二级市场上投资股票、权证等权益类资产。
本基金的投资组合比例为:债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%;股票、权证等权益类品种投资比例不超过基金资产的 20%。本基金持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%,并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。
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。

（三）投资策略
1、资产配置策略
本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%,对股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%。本基金将遵循自上而下的配置原则,以宏观经济分析和政策分析为基础,根据对宏观经济运行趋势、国家财政政策与货币政策、市场流动性水平、债券市场和股票市场估值水平等因素的综合分析,对各大类资产的预期风险和收益进行动态评估,从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例,并跟踪影响资产配置策略的各种因素的变化,对大类资产配置比例进行动态优化管理。
本基金将通过对固定收益类金融工具的主动管理,力争获取稳定的债券投资收益。此外,本基金将根据对股票市场的趋势研究及新股（增发）申购收益率的预测,适度参与一级市场和二级市场的股票投资,在严格控制风险的前提下,力求提高基金的整体收益率。
2、债券投资策略
本基金将采用积极主动的债券投资策略,以中长期利率分析为核心,结合宏观经济周期、宏观政策方向、收益率曲线形态、债券市场供求关系等分析,实施积极的债券投资组合管理。在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。
（1）债券类资产配置策略
1）久期调整策略
本基金将根据对市场利率的变化趋势的预判,相应的调整债券组合的久期。本基金通过对影响债券投资的宏观经济变量和宏观经济政策等因素的综合分析,预测未来的市场利率的变动趋势,判断债券市场对上述因素及其变化的反应,并提此积极调整债券组合的久期。在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益,在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。
2）收益率曲线策略
在确定债券组合的久期后,本基金主要采用收益率曲线策略决定组合的期限结构配置。收益率曲线策略,即通过考察市场收益率曲线的动态变化及预期变化,寻求在一段时期内获取因收益率曲线形状变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益的策略。
本基金将对债券市场收益率期限结构进行分析,预测收益率期限结构的变化方式,根据收益率曲线形态变化确定合理的组合期限结构,包括采用子弹策略、哑铃策略和梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,以从长期、中期和短期债券的相对价格变化中获利。
3）类属配置策略
本基金根据市场和类属资产的信用水平,在判断各类属的利率期限结构与国债利率期限结构应具有的合理利差水平基础上,将市场组分为交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债等子市场。结合各类属资产的市场容量、信用等级和流动性特点,运用修正的均值-方差等模型,对投资组合类属资产进行最优化配置和调整,确定类属资产的最优权重。
（2）个券选择
在确定债券组合久期、期限结构和类属配置的基础上,本基金对影响个别债券定价的主要因素,包括流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、税赋、含权等因素进行分析,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。
对于企业债、短期融资券等信用类债券,本基金将运用内部信用评估体系,对债券发行人以及债券的信用风险进行度量,进而确定信用风险利差。通过对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断,选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债券进行投资。
（3）动态增强策略
在以上债券投资策略的基础上,本基金还将根据债券市场的动态变化,运用骑乘收益率曲线策略、息差策略和互换策略,进行适当的主动投资,以提高债券组合的收益。
1）骑乘收益率曲线策略
在预期未来收益率曲线变动较为平稳的情况下,通过分析收益率曲线各期限段的利差情况,本基金可以买入收益率曲线最突起部位所在剩余期限的债券,这一期限的收益率水平此时处于相对较高的位置,随着债券剩余期限的缩短,债券的剩余期限将缩短,收益率水平将下降,从而可获得资本利得收益。
2）息差策略
息差策略是指通过不断正回购融资并持续买入债券的操作,只要回购资金成本低于债券收益率,就可以达到杠杆放大的套利目标。
3）互换策略
债券互换就是同时买入和卖出具有相近特性的两个以上债券品种,从而获取收益率差的行为。不同债券品种在利息、久期、流动性、税收特性、违约风险和衍生条款等方面的差别,决定了债券互换的可行性和潜在获利可能。
（4）可转换债券的投资策略
可转换债券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。可转换债券的价值主要取决于其作为普通债券的基础价值和内含期权价值。本基金在对可转换债券的发行条款和发行公司的基本面深入分析的基础上,采用可转换债券定价模型对其投资价值进行评估,选择具有较高投资价值的可转换债券,获取稳健的投资回报。
（5）资产支持证券投资
本基金将在严格控制组合投资风险的前提下投资于资产支持证券。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。
3、股票投资策略
（1）一级市场股票投资策略
本基金管理人将深入分析上市公司基本面,并参考同类公司的估值水平,评估股票的投资价值,从而判断一、二级市场价差的大小。本基金还将综合考虑资金成本、新股申签率、新股上市后的股价涨幅统计、股票锁定期间、在有效控制风险的前提下,制定新股申购策略。本基金对于通过新股申购所获得的股票,将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低决定持有或者卖出。
（2）二级市场股票投资策略
本基金的股票类资产作为整体基金投资组合管理的辅助工具,为投资者提供适度参与股票市场、获取超额收益的机会。当本基金管理人判断市场出现明显的投资机会时,本基金可直接参与股票二级市场的投资,在严格控制风险的前提下,争取超额收益。
本基金将采用自上而下的行业分析和自下而上的个股精选,精选行业和个股,以获取绝对收益。在行业配置方面,本基金将通过对行业周期、行业景气度、国家产业政策、行业估值水平等因素的综合分析,在此基础上进行行业优选。在个股选择方面,本基金将综合分析上市公司的行业地位、核心竞争优势、盈利能力、公司治理结构等因素,精选具有良好成长性、估值水平合理的股票进行投资。
4、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。
（四）业绩比较基准
中信标普全债指数。
中信标普全债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的国债、企业债、可转债和金融债,具有一定的投资代表性。基于指数的权威性和代表性以及本基金的投资范围和投资理念,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此