



## 上投摩根成长动力混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

二〇一六年六月

### 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

基金合同生效日期:2013年5月15日

**重要提示:**

1. 投资有风险,投资人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. 基金投资者购买基金并不等于将资金作为存款存入银行或者存款类金融机构,基金资产不属于基金一定盈利,也不保证最低收益
4. 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。基金合同和招募说明书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范性文件约定,承担作为基金份额持有人的权利和义务,应详细阅读基金合同。
5. 本基金可以参与中小企业私募债券的投资,中小企业私募债券发行人为中小、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,使得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风险和流动性风险。
6. 招募说明书所载内容截止日为2016年5月14日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2016年3月31日。

**一、基金管理人**  
(一)基本情况  
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20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20层  
法定代表人:陈伟  
成立日期:2004年5月12日  
总部注册资本: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金字[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。公司注册资本人民币壹亿元,股东及出资比例分别为上海国际信托有限公司67%、上投摩根资产管理(英国)有限公司33%。变更为目前51%和49%。  
2006年6月6日,基金管理人为“上投摩根基金明基基金管理有限公司”变更为“上投摩根基金管理有限公司”,重新申请于2006年4月29日获得中国证监会的批准,并于2006年6月12日在国家工商总局完成变更登记手续。  
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至一亿五千万人民币,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。  
基金管理人无任何处罚记录。

(二)主要人员情况  
1. 基金管理人高级管理人员情况:  
董事长:陈伟  
硕士研究生学历,高级经济师职称。  
曾任天津银行天津分行党委书记、天津信托投资公司总裁助理,上海浦东发展银行总行副行长、行长、党委书记、总行风险管理部总监,上海浦东发展银行党委常委、副行长。

现任上海浦东发展银行董事兼党委书记,上投摩根基金管理有限公司董事长。  
董事:  
Paul Berman  
曾任美国Lehman & Co. 董事。  
Francis Fleming Asset Management Limited全球总监,摩根资产管理全球投资管理集团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成员,同时也是摩根资产管理董事。

董事:Jed Lukowitz  
美国伊萨卡大学社会学(主修政治)及布鲁克林法学院犯罪学学士学位。  
曾任摩根资产管理亚太区行政总裁。

现任摩根资产管理亚太区行政管理及法律事务部联席总监。  
董事:Michael I. Fakon  
学士学位(主修金融)。  
曾任摩根资产管理退休业务总监。

现任摩根资产管理环境及社会责任管理的亚太区行政总裁、亚太区基金业务总监,环球投资管理委员会成员,集团资产管理团队成员,集团投资委员会亚太区运营委员会主席。

董事:潘卫东  
硕士研究生学历,高级经济师。  
曾任上海浦东发展银行办公室金融管理处处长(挂职)、上海国际集团有限公司副总裁。

现任上海浦东发展银行办公室金融管理处处长、上海国际信托有限公司党委书记、董事长。

董事:陈兵  
硕士研究生学历,高级经济师。  
曾任浦发银行总行人银行总风险管理部总经理,上海国际信托有限公司副总经理兼董事。

现任上海国际信托有限公司党委副书记、副董事长、总经理。

董事:曹建彪  
基金从业资格,高级经济师。  
曾任上海国际集团有限公司金融管理部总经理助理,上海国际集团有限公司资本运营部副经理。

现任上海国际君安股份有限公司董事会办公室副主任。

董事:曹建彪  
获清华大学硕士学位。  
曾任招商证券股份有限公司副经理(现名摩根大通证券)、摩根基金明基证券投资基金的董事长。

现任上投摩根基金管理有限公司总经理。

独立董事:俞敏  
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政策研究所所长,曾经在加里利大学经济学院、新加坡国立大学经济学院、复旦大学经济学院等单位任教。

独立董事:曹建彪  
国际金融学硕士学位。  
现任复旦大学金融研究中心副主任、复旦大学国际金融系教授。

独立董事:戴立宁  
获台湾大学硕士学位及美国哈佛大学金融硕士学位。  
曾任台湾清大财务处处长,东吴大学法学院副教授。

现任北京大学光华管理学院及光华管理学院教授。

独立董事:李存修  
获美国加州大学柏克利分校企管博士(主修财务)、企管硕士、经济硕士学位。  
曾任美国加州大学柏克利分校系支持特教授。

2. 基金经理情况:  
基金经理:曹建彪  
曾任上海浦东发展银行总行副行长、副董事长、副行长。

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  
客服电话:95579  
网站:www.boc.cn

(5) 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  
法定代表人:李建强  
客户服务中心电话:95555  
网站:www.cmbchina.com

(6) 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:牛锡明  
客服电话:95558  
网站:www.bankcomm.com

(7) 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:李海  
客服电话:021-33388888  
网站:www.spdb.com.cn

(8) 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南路981号  
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号中融融玉蓝大厦15-20 21-25层  
法定代表人:黄光伟  
客服电话:021-962585  
网站:www.urcb.com

(9) 上海农村商业银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区浦东南路981号  
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号中融融玉蓝大厦15-20 21-25层  
法定代表人:黄光伟  
客服电话:021-962585  
网站:www.urcb.com

(10) 上海农村商业银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区浦东南路981号  
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号中融融玉蓝大厦15-20 21-25层  
法定代表人:黄光伟  
客服电话:021-962585  
网站:www.urcb.com

(11) 上海农村商业银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区浦东南路981号  
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号中融融玉蓝大厦15-20 21-25层  
法定代表人:黄光伟  
客服电话:021-962585  
网站:www.urcb.com

(12) 上海农村商业银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区浦东南路981号  
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号中融融玉蓝大厦15-20 21-25层  
法定代表人:黄光伟  
客服电话:021-962585  
网站:www.urcb.com

(13) 上海农村商业银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区浦东南路981号  
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号中融融玉蓝大厦15-20 21-25层  
法定代表人:黄光伟  
客服电话:021-962585  
网站:www.urcb.com

(14) 上海农村商业银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区浦东南路981号  
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号中融融玉蓝大厦15-20 21-25层  
法定代表人:黄光伟  
客服电话:021-962585  
网站:www.urcb.com

(15) 上海农村商业银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区浦东南路981号  
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号中融融玉蓝大厦15-20 21-25层  
法定代表人:黄光伟  
客服电话:021-962585  
网站:www.urcb.com

(16) 上海农村商业银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区浦东南路981号  
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号中融融玉蓝大厦15-20 21-25层  
法定代表人:黄光伟  
客服电话:021-962585  
网站:www.urcb.com

(17) 上海农村商业银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区浦东南路981号  
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号中融融玉蓝大厦15-20 21-25层  
法定代表人:黄光伟  
客服电话:021-962585  
网站:www.urcb.com

(18) 上海农村商业银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区浦东南路981号  
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号中融融玉蓝大厦15-20 21-25层  
法定代表人:黄光伟  
客服电话:021-962585  
网站:www.urcb.com

(19) 上海农村商业银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区浦东南路981号  
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号中融融玉蓝大厦15-20 21-25层  
法定代表人:黄光伟  
客服电话:021-962585  
网站:www.urcb.com

公司网站:www.fund123.cn  
(3) 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190号2号楼2层  
法定代表人:李超  
客服电话:400-1818-188  
网站:www.1234567.com

(4) 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:4009000222,010-20835588  
网站:icake.hexun.com

(5) 一路财富(北京)信息科技有限公司  
注册地址:北京市西城区阜成门大街2号万商国际大厦208室  
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万商国际大厦208室  
法定代表人:吴昊  
客服电话:400-010-1566  
网站:www.yilucaifu.com

(6) 上海利得基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区临潼路5475号1033室  
办公地址:上海市虹口区临潼路5475号1033室  
法定代表人:沈捷  
客服电话:4006076266  
网站:www.lidifund.com

(7) 上海汇付金融服务有限公司  
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室  
办公地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室  
法定代表人:冯鹤  
客服电话:021-96251819  
网站:www.fundbuds.com

(8) 上海海金资产管理股份有限公司  
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09单元  
法定代表人:李俊  
客服电话:400-821-9031  
网站:www.haifund.com

(9) 北京天天基金销售有限公司  
注册地址:北京市西城区太平桥大街北15号1122室  
办公地址:北京市西城区太平桥大街北15号1122室  
法定代表人:梁越  
客服电话:400-888-0618  
网站:www.chitfund.com

(10) 北京恒泰证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
办公地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
法定代表人:杨晓  
客服电话:400-886-1176  
网站:www.yingmi.com

(11) 北京恒泰证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
办公地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
法定代表人:杨晓  
客服电话:400-886-1176  
网站:www.yingmi.com

(12) 北京恒泰证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
办公地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
法定代表人:杨晓  
客服电话:400-886-1176  
网站:www.yingmi.com

(13) 北京恒泰证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
办公地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
法定代表人:杨晓  
客服电话:400-886-1176  
网站:www.yingmi.com

(14) 北京恒泰证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
办公地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
法定代表人:杨晓  
客服电话:400-886-1176  
网站:www.yingmi.com

(15) 北京恒泰证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
办公地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
法定代表人:杨晓  
客服电话:400-886-1176  
网站:www.yingmi.com

(16) 北京恒泰证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
办公地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
法定代表人:杨晓  
客服电话:400-886-1176  
网站:www.yingmi.com

(17) 北京恒泰证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
办公地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
法定代表人:杨晓  
客服电话:400-886-1176  
网站:www.yingmi.com

(18) 北京恒泰证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
办公地址:北京市西城区恒泰国际大厦10层1006号  
法定代表人:杨晓  
客服电话:400-886-1176  
网站:www.yingmi.com

证,在对公司基本面和财务报表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成长性的可转换债券,获取稳健的投资回报。

5. 中小企业私募债券的投资  
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,风险控制措施和信用风险、流动性风险管理,其中,投资决策流程和风险控制制度需经董事会批准,并经信用评级、流动性风险管理等各环节。本基金对中小企业私募债券的投资主要来自于以下判断:新债发行周期和目前下行情势的两个角度出发,结合信用评级和信用评估进行,同时通过有规律的风险监测实现对投资组合风险的有效管理。

6. 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,寻求其合理估值水平,谨慎投资,以追求较稳定的当期收益。

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。套期保值的主要采用流动性好、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授权机制,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. 基金资产净值及基金份额净值  
(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上市公司发行的证券,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) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约保证金的交易保证金后,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;

(10) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(11) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(12) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(13) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(14) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(15) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(16) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;

(17) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(18) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(19) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(20) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(21) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(22) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;

(23) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(24) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(25) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(26) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(27) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(28) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;

(29) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(30) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(31) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(32) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(33) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(34) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;

(35) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(36) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(37) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(38) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(39) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(40) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;

(41) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(42) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(43) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(44) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(45) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(46) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;

(47) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(48) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(49) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(50) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(51) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(52) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;

(53) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(54) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(55) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(56) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(57) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(58) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;

(59) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(60) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(61) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(62) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(63) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(64) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;

(65) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(66) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(67) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(68) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(69) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;  
(70) 本基金管理人管理的基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其所持有的该类资产支持证券规模的10%;

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	000558	莱茵体育	799,018	15,005,558.04	8.45
2	000859	苏宁环球	2,074,864	9,751,860.80	5.49
3	600178	华信实业	625,813	6,750,086.42	3.80
4	600718	中航工业	284,000	5,810,640.00	3.27
5	600118	中国国航	157,100	5,608,470.00	3.16
6	600730	中航高科	134,855	4,883,552.40	3.09
7	602299	圣农发展	202,656	5,449,414.84	3.07
8	600584	长电科技	261,700	4,891,173.00	2.76
9	300359	金通灵	66,300	4,870,398.00	2.74
10	600136	道博股份	69,376	4,187,535.36	2.36

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	3,201,600.00	1.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	企业债;政策性金融债	-	-
5	企业债	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转债	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,201,600.00	1.80

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019509	15国债09	32,000	3,201,600.00	1.80

6. 报告期内本基金前十名重仓股票投资情况  
7. 报告期内本基金前十名重仓债券投资情况  
8. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
9. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
10. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
11. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
12. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
13. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
14. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
15. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
16. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
17. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
18. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
19. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
20. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
21. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
22. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
23. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
24. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
25. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
26. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
27. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
28. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
29. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
30. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
31. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
32. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
33. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
34. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
35. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
36. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
37. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
38. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
39. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
40. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
41. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
42. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
43. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
44. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
45. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
46. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
47. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
48. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
49. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
50. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
51. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
52. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
53. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
54. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
55. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
56. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
57. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
58. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
59. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
60. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
61. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
62. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
63. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
64. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
65. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
66. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
67. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
68. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
69. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
70. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
71. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
72. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
73. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
74. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
75. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
76. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
77. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
78. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况  
79. 报告期内本基金前十名重仓衍生品投资情况