

上投摩根智慧互联股票型证券投资基金

招募说明书(更新)摘要

基金合同生效日期：2015年6月9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：

1. 基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整；
2. 本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险；
3. 投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应当认真阅读本招募说明书；
4. 基金的过往业绩并不预示其未来表现；
5. 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。
6. 本招募说明书所载内容截止日为2015年12月8日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2015年9月30日。

二〇一六年一月

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：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% 变更为目的的 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。

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：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：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：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副总裁。

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党委书记、董事长。

董事：陈兵

博士研究生，高级经济师。

曾任上海浦东发展银行财富管理部总经理、上海国际信托有限公司副总经理兼董事会秘书。

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：胡越

硕士研究生，高级经济师。

曾任上海国际集团有限公司金融管理总部总经理助理。

现任上海国际集团有限公司资本运营部副总经理。

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：俞樵

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。

现任台湾东吴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；上海国际集团金融管理总部总经理。

现任上海国际信托有限公司监事长。

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混合型证券投资基金和上投摩根全球天然资源混合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、首席风险官；尚腾资本管理有限公司董事。

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。

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。

获上海财经大学工商管理硕士学位。

历任上海证券有限责任公司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。

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

郭晨先生，自 2007 年 5 月至 2008 年 4 月在平安资产管理有限公司担任分析师；2008 年 4 月至 2009 年 11 月在东吴基金管理有限公司担任研究员；2009 年 11 月至 2014 年 10 月在华富基金管理有限公司先后担任基金经理助理、基金经理，自 2014 年 10 月起加入上投摩根基金管理有限公司，自 2015 年 1 月起担任上投摩根中小盘混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 6 月起同时担任上投摩根智慧互联股票型证券投资基金基金经理，自 2015 年 8 月起同时担任上投摩根新兴服务股票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

侯明甫先生，副总经理；杜猛先生，投资一部投资总监；孙芳女士，投资二部投资总监；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；张军先生，基金经理；吴文哲先生，研究总监；黄栋先生，量化投资部总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（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：姜建清

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

（二）主要人员情况

截至 2015 年 9 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 205 人，平均年龄 30 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、先进的营运系统和专业的服务团队，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，展现优异的市场形象和影响力。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、安心账户资金、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 2015 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 496 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《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 49 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：

(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：姜建清

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

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：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

(6) 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) 52629999

传真：(021) 62569070 客服电话：95561

网址：www.cib.com.cn

(7) 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：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

国际互联网网址：www.swhysc.com

联系人：黄莹

(8) 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：李季

电话：010-88085858

传真：010-88085195 客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

联系人：李巍

(9) 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

(10) 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：芮敏祺

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

(11) 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

(12) 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：薛峰

客户服务电话：95525 联系人：刘晨

网址：www.ebscn.com

(13) 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

(14) 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

(15) 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：谢高得

客户服务热线：95562

公司网站：www.xyzq.com.cn

(16) 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

(17) 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：常喆

联系人：李航

客户服务电话：4008188118

网址：www.guodu.com

(18) 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：王东明

电话：010-60838888

传真：010-60833739

客户服务热线：010-95558

(19) 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

(20) 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：牛冠兴

客服电话：4008001001

公司网址：www.essence.com.cn

(21) 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

(22) 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

(23) 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

(24) 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 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

(25) 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: 单丙焯

联系电话: 021-20691832

传真: 021-20691861

客服电话: 400-820-2899

公司网站: www.erichfund.com

(26) 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

(27) 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

(28) 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

(29) 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

(30) 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

(31) 上海利得基金销售有限公司

注册地址： 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址： 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人： 沈继伟

客服电话： 4000676266

网站： www.leadbank.com.cn

(32) 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： 上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人： 冯修敏

客服电话： 400-820-2819

网站： fund.bundtrade.com

(33) 上海陆金所资产管理有限公司

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：郭坚

客服电话：400-821-9031

网站：www.lufunds.com

(34) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

客服电话：400-898-0618

网站：www.chtfund.com

(35) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603

办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号温特莱中心 A 座 16 层

法定代表人：董浩

客服电话：400-068-1176

网站：www.jimufund.com

(36) 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

(37) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：杨懿

客服电话：400-166-1188

网站：<http://8.jrj.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：廖海、刘佳

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：曹阳

经办注册会计师：陈玲、曹阳

四、基金概况

基金名称：上投摩根双核平衡混合型证券投资基金

基金类型：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
7 日以内	1.50%
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	0.20%
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

采用定量及定性研究方法，自下而上优选互联网主题上市公司，通过严格的风险控制，力争实现基金资产的长期增值。

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、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 80%-95%，不低于 80%的非现金基金资产投资于与智慧互联主题相关的股票；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期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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

当前互联网概念不仅仅包含传统意义上的计算机、通讯等行业，而是体现在社会发展的方方面面，互联网的运用在创造新型商业模式、传统产业升级等方面发挥越来越重要的作用，融合了互联网平台与技术的传统企业将会以领先者的角色占领市场。同时，互联网作为知识密集型、低能耗、高附加值的代表，符合未来大力发展低碳经济的政策趋势，将成为推动经济发展的重要力量之一。

本基金将专注于互联网主题投资，对其相关行业的发展进行密切跟踪，充分把握互联网概念企业的投资机会，发掘与互联主题相关的上市公司中商业模式独特、竞争优势明显，具有长期持续增长模式、估值水平相对合理的优质上市公司，分享企业成长及变革带来的资本增值。

本基金所界定的“智慧互联”主题相关股票包含两个方面：1) 与互联网概念直接相关的行业，包含电子、计算机、传媒、通信等申万一级行业；2) 融合互联网思维，或运用互

联网概念和技术对企业进行变更/转型的传统企业，包括已发布公告或已实施相关方案的上市公司，以及预期将进行相关变革的上市公司。

上述上市公司将作为本基金的主要投资方向。本基金将根据对智慧互联需求变化和行业发展趋势的跟踪研究，适时调整智慧互联主题所覆盖的行业范围。此外，本基金将对申万一级行业分类标准进行密切跟踪，若日后该标准有所调整或出现更为科学的行业分类标准，本基金将在审慎研究的基础上，采用新的行业分类标准并重新界定智慧互联主题所覆盖的行业范围。

在具体操作上，本基金主要采取“自下而上”的选股策略，基于对互联网主题相关的上市公司盈利水平、成长性和估值水平的综合考量，使用定性与定量相结合的方法精选股票进行投资。

首先，使用定性方法，挑选能够利用互联网技术、互联网思维等对企业的产品服务、商业模式、供应链结构、企业治理等进行变革和创新，从而具有快速增长的企业。具体体现在考量研发团队技术实力强、互联技术的发展与应用前景广阔并且在技术上具有一定核心竞争力的公司，以及上市企业利用互联网技术或思维对产业供应链、商业模式产生变革或影响，并取得竞争优势进而创造利润增长的能力。同时，企业治理的好坏关系到公司战略、创新能力、盈利能力乃至估值水平。本基金将从上市公司的管理层评价、战略定位和管理制度体系方面对企业治理进行评价。

其次，使用定量分析的方法，通过财务和运营数据进行企业价值评估，挑选互联业务收入（或受益于移动互联趋势而新增的业务收入）增长率大于其传统业务增长率的企业。具体将通过评估上市公司创造利润的能力，主要参考的指标包括净资产收益率（ROE），毛利率，净利润，主营业务收入等；并通过 EPS 增长率和主营业务收入增长率等指标考察上市公司的成长能力。

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。

3、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、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。

5、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。

6、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。

7、资产支持证券投资策略

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。

8、股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的,参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下,选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判,并结合股指期货定价模型,选择估值合理的期权合约。基金管理人将建立股票期权交易决策部门或小组,按照有关要求做好人员培训工作,确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力,同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项。

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) 股票资产占基金资产的 80%-95%,不低于 80%的非现金基金资产投资于与智慧互联主题相关的股票;

(2) 本基金持有一家公司发行的证券,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%；

(15) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指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；

(16) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指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；

(17) 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 80%-95%；

(18) 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%；

(19) 本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

(20) 本基金开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

(21) 本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

(22) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约及股票期权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。

本基金在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；

(23) 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%；

(24) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(25) 法律法规和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，不需要经基金份额持有人大会审议。

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) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

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

中证 800 指数收益率×85%+中债总指数收益率×15%

中证 800 指数综合反映了沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，其成份股由中证 500 和沪深 300 成份股共同构成，较好的反映了市场上不同规模特征股票的整体表现，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

本基金属于股票型基金产品，预期风险和收益水平高于混合型基金、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。

七、基金管理人代表基金行使相关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、基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

（九）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	1,319,013,720.50	61.85
	其中：股票	1,319,013,720.50	61.85
2	固定收益投资	72,518,300.20	3.40
	其中：债券	72,518,300.20	3.40
	资产支持证 券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备 付金合计	728,480,829.60	34.16
6	其他各项资产	12,423,293.83	0.58
7	合计	2,132,436,144.13	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	7,429,881.26	0.35
B	采矿业	-	-
C	制造业	924,117,291.56	43.56
D	电力、热力、燃 气及水生产和供 应业	70,679,978.70	3.33
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,106,708.21	0.52

G	交通运输、仓储和邮政业	908,820.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	175,654,384.25	8.28
J	金融业	-	-
K	房地产业	10,314,232.00	0.49
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	47,721,007.36	2.25
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	34,556,722.90	1.63
R	文化、体育和娱乐业	36,524,694.26	1.72
S	综合	-	-
	合计	1,319,013,720.50	62.17

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	300367	东方网力	3,042,615.00	171,512,207.55	8.08

2	002236	大华股份	2,025,861.00	68,494,360.41	3.23
3	600893	中航动力	1,508,822.00	61,650,466.92	2.91
4	601126	四方股份	2,308,126.00	61,003,770.18	2.88
5	002701	奥瑞金	2,632,253.00	55,935,376.25	2.64
6	000958	东方能源	2,096,784.00	55,355,097.60	2.61
7	000902	新洋丰	2,361,927.00	52,552,875.75	2.48
8	601388	怡球资源	3,237,500.00	50,602,125.00	2.39
9	300284	苏交科	2,193,061.00	47,721,007.36	2.25
10	300359	全通教育	589,036.00	46,168,641.68	2.18

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	46,663,140.00	2.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	25,855,160.20	1.22
	其中：政策性金融债	25,855,160.20	1.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	72,518,300.20	3.42

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019509	15 国债 09	465,700	46,663,140.00	2.20

2	018001	国开 1301	256,220	25,855,160.20	1.22
---	--------	---------	---------	---------------	------

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8. 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。

9. 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、处罚的情形。

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。

3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,218,157.92
2	应收证券清算款	9,028,062.27
3	应收股利	-
4	应收利息	1,754,138.36
5	应收申购款	422,935.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,423,293.83

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。

5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值(元)	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情况 说明
1	601388	怡球资源	50,602,125.00	2.39	筹划重大事项

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
基金成立日 -2015/09/30	-31.30%	2.54%	-35.08%	2.95%	3.78%	-0.41%

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；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 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、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：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，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 5 个工作日内、按照指定的账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。

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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，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 5 个工作日内、按照指定的账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。

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、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

九、招募说明书更新说明

本基金于 2015 年 6 月 9 日成立，至 2015 年 12 月 8 日运作满半年。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》、《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 2015 年 5 月 21 日公告的《上投摩根智慧互联股票型证券投资基金招募说明书》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 2015 年 12 月 8 日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为 2015 年 9 月 30 日。

2、在“三、基金管理人”的“主要人员情况”中，对董事、监事、其他高级管理人员以及投资决策委员会等信息进行了更新。

3、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的信息进行了更新。

4、在“五、相关服务机构”中，更新了代销机构的信息。

5、本基金的实际募集期是 2015 年 5 月 25 日至 2015 年 6 月 5 日，根据本基金的实际募集情况，在“六、基金的募集及基金合同的生效”中更新了相关内容。

6、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。

7、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。

8、新增了“二十二、其他应披露事项”一章，列示了本披露期间的其他重要事项。

2016 年 1 月 22 日