
上投摩根核心优选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：2012 年 11 月 28 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. 本基金的基金名称自 2015 年 7 月 21 日起由上投摩根核心优选股票型证券投资基金变更为上投摩根核心优选混合型证券投资基金。该变更不涉及基金份额持有人权利义务关系的变化，亦不涉及投资目标、投资范围和投资策略的变更，对本基金的投资及基金份额持有人利益无实质性不利影响。
5. 本招募说明书摘要所载内容截止日为 2017 年 5 月 27 日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为 2017 年 3 月 31 日。

二零一七年七月

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 20 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 20 楼

法定代表人：穆矢

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% 和摩根富林明资产管理（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一亿五千万万元人民币增加到二亿五千万万元人民币，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：穆矢

硕士研究生学历、高级经济师职称。

曾任天津市人大财经委办公室副主任、天津信托投资公司总裁助理、上海浦东发展银行天津分行副行长、行长、党委书记、总行风险管理总部总监、上海浦东发展银行党委委员、副行长。

现任上海浦东发展银行董事会秘书、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

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。

曾任摩根资产管理亚太区行政总裁。

现任摩根资产管理环球投资管理方案联席总监。

董事：Michael I. Falcon

学士学位（主修金融）。

曾任摩根资产退休业务总监。

现任摩根资产管理环球投资管理的亚太区行政总裁、亚太区基金业务总监、环球投资管理营运委员会成员、集团亚太管理团队、集团投资管理亚太区营运委员会主席。

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。

曾任浦发银行总行个人银行总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。

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：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。

现任上海浦东发展银行总行资产负债管理部总经理。

董事：章硕麟

获台湾大学商学硕士学位。

曾任怡富证券股份有限公司副总经理（现名摩根大通证券）、摩根富林明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：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。

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。

曾任台湾财政部常务次长，东吴大学法学院副教授。

现任北京大学法学院及光华管理学院兼职教授。

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。

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。曾经在加利伯利大学经济系、新加坡国立大学经济系、复旦大学金融系等单位任教。

2. 监事会成员基本情况：

监事会主席：赵峥嵘

硕士学位，高级经济师。

历任工商银行温州分行副行长、浦发银行温州分行副行长、行长及杭州分行行长等职务。

现任上海国际信托有限公司监事长、党委副书记。

监事：石恬华

台湾大学财务金融系学士及芝加哥大学布斯商学院硕士。

历任摩根资产管理集团台湾区摩根投顾总经理、摩根投信总经理等职务；现任摩根资产管理集团台湾区负责人暨摩根投信董事长，负责台湾区的资产管理业务。

监事：张军

曾任上投摩根基金管理有限公司交易部总监。

现任上投摩根基金管理有限公司国际投资部总监兼基金经理，管理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。

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。

曾任怡富证券股份有限公司副总经理（现名摩根大通证券）、摩根富林明证券股份有限公司董事长。

4. 其他高级管理人员情况：

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。

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。

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。

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，孙芳女士，华东师范大学经济学硕士，2003 年 7 月至 2006 年 10 月任华宝兴业基金行业研究员；自 2006 年 12 月起加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任行业专家、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、副总经理兼投资副总监。自 2011 年 12 月起担任上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金经理，2012 年 11 月起担任上投摩根核心优选混合型证券投资基金基金经理，2014 年 2 月至 2015 年 7 月同时担任上投摩根核心成长股票型证券投资基金基金经理，自 2014 年 12 月起同时担任上投摩根行业轮动混合型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理为李佳嘉女士，任职日期为 2015 年 8 月 11 日至 2016 年 10 月 28 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；朱晓龙，研究总监；孟晨波，总经理助理兼货币市场投资部总监；赵峰，债券投资部总监；张军，国际投资部总监；黄栋，量化投资部总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人概况

（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：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)。

资产负债稳步增长。2016 年末，本集团资产总额 20.96 万亿元，较上年增加 2.61 万亿元，增幅 14.25%，其中客户贷款总额 11.76 万亿元，较上年增加 1.27 万亿元，增幅 12.13%。负债总额 19.37 万亿元，较上年增加 2.47 万亿元，增幅 14.61%，其中客户存款总额 15.40 万亿元，较上年增加 1.73 万亿元，增幅 12.69%。

核心财务指标表现良好。积极消化五次降息、利率市场化等因素影响，本集团实现净利润 2,323.89 亿元，较上年增长 1.53%。手续费及佣金净收入 1,185.09 亿元，在营业收入中的占比较上年提升 0.83 个百分点。平均资产回报率 1.18%，加权平均净资产收益率 15.44%，净利息收益率 2.20%，成本收入比为 27.49%，资本充足率 14.94%，均居同业领先水平。

2016 年，本集团先后获得国内外知名机构授予的 100 余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016 中国最佳银行”，《环球金融》“2016 中国最佳消费者银行”、“2016 亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016 年“世界银行 1000 强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第 2；在美国《财富》

2016 年世界 500 强排名第 22 位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，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、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，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。

（二）主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，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，资产托管业务部副总经理，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。

原玗，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 2017 年一季度末，中国建设银行已托管 719 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。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”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”。

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：易会满

客户服务统一咨询电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（3） 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

（4） 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

（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

法人代表：李建红

客户服务中心电话：95555

网址： 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

客户服务热线：95559

网址： 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：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

(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

(10) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路8号中融碧玉蓝天大厦15-20, 22-27层

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, 22-27层

法定代表人：冀光恒

门户网站： www.srcb.com

客户服务电话：021-962999

(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：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

(12) 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

(13) 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

电话：(021 53686888

传真：(021) 53686100

客户服务电话：021-962518

网址：www.962518.com

(14) 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：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

电话：(021) 38676666 转 6161

传真：(021) 38670161

客户服务咨询电话：95521

网址：www.gtja.com

(15) 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

(16) 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

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

网址：www.ebscn.com

(17) 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

(18) 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

(19) 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

(20) 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

(21) 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： 周杨

客户服务电话： 95536

公司网址: www.guosen.com.cn

(22) 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

(23) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人：周易

客户咨询电话：95597

联系电话：0755-82492193

网址： www.htsc.com.cn

(24) 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

(25) 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

(26) 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

(27) 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

(28) 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

(29) 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

(30) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层（518048）

法定代表人：詹露阳

电话：021-38631117

传真：021-58991896

客服电话：95511-8

网址：<http://stock.pingan.com>

联系人：石静武

(31) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋 2 楼

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

公司网站：www.noah-fund.com

(32) 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

(33) 深圳众禄金融控股股份有限公司

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

(34) 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: 单丙烨

联系电话: 021-20691832

传真: 021-20691861

客服电话: 400-820-2899

公司网站: www.erichfund.com

(35) 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

(36) 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仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 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: 陈柏青

客服电话: 400-0766-123

公司网站: www.fund123.cn

(37) 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

(38) 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

(39) 星展银行（中国）有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号 1301、1801 单元

法定代表人：葛甘牛

咨询电话：400-820-8988

网站：www.dbs.com.cn

(40) 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

(41) 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

(42) 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

(43) 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

(44) 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

(45) 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

(46) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

法定代表人：董浩

客服电话：400-628-1176

网站：www.jimufund.com

(47) 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

(48) 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/>

(49) 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

网站：www.xincai.com

客服电话：010-62675369

(50) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部

法定代表人：陈超

电话：4000988511/4000888816

网址：<http://fund.jd.com/>

(51) 嘉实财富管理有限公司

住所：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

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850 网站：www.harvestwm.cn

(52) 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：李一梅

客户服务电话：400-817-5666

传真：010-88066552

(53) 上海万得投资顾问有限公司

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：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号建工大厦 8 楼

法定代表人：王廷富

客户服务电话：400-821-0203

网址：www.520fund.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：梁丽晶、刘佳

（四）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：上投摩根核心优选混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

五、基金的投资

（一）投资目标

本基金将充分利用基金管理人研究团队的集体智慧，以内部研究组合作为核心股票，从中优选出具有良好基本面和较高成长性的公司进行投资，力争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、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：股票资产占基金资产的 75%-95%，其中投资于内部研究组合中的股票的资产不低于股票资产的 80%；权证投资占基金资产净值的 0-3%；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

本基金将从宏观层面出发，采用定量分析和定性分析相结合的手段，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综合分析，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。

在控制风险的前提下，本基金将优先配置股票资产，本基金股票资产占基金资产的比例为 75%-95%，其中投资于内部研究组合中的股票的资产不低于股票资产的 80%

2、股票投资策略

本基金将依托本基金管理人的研究平台，采用“自下而上”的个股精选策略，基于公司内部研究团队对于个股的基本面的深入研究和细致的实地调研，选择具有良好基本面和成

长空间的个股。

本基金将研究团队的集体智慧与基金经理的个人能力充分结合，强调研究对于投资的先导作用和支持作用，目标是更有效的将研究成果尤其是内部研究成果转化为基金业绩。本基金的股票投资包含核心股票和优选股票两个层面。核心股票由公司内部研究组合构成，主要包含了研究部推荐股票，是研究员在对个股进行深度研究和实地调研基础上提出的投资建议。优选股票是指基金经理基于对宏观经济、政策、行业以及个股的深入研究与把握，从核心股票中优选具有良好投资价值的股票，构建股票投资组合。

本基金明确提出将不低于 80%的股票资产投资于公司内部研究组合中的股票。通过纪律化的投资约束，将研究成果积极转化为投资业绩。内部研究组合的构建主要由研究团队负责，具体而言，研究员采用定性分析与定量分析相结合的分析方法，通过对行业内个股的深入的基本面研究，对上市公司的投资价值进行综合考察，精选出质地优良、具有较强竞争优势的公司，构建内部研究组合。基本面研究由于专注于企业在管理、品牌、资源、技术、创新能力各方面的深入分析，因此可以更加准确地挑选出具有投资价值的公司。

在具体操作上，我们将采用自下而上的个股精选策略，综合运用定量分析与定性分析的手段，对公司基本面进行价值挖掘。

（1）定量分析

定量的方法主要通过对公司财务状况、盈利质量、成长能力、估值水平等方面的综合评估，选择财务健康、成长性好的公司。

①财务状况：评估公司的财务穿越宏观经济和行业的萧条和衰退期的能力，主要考察指标为资产负债率、资产周转率、流动比率等；

②盈利质量：评估公司持续发展能力，主要考察近三年平均净资产收益率(ROE)、近三年平均投资资本回报率(ROIC)；

③成长能力：评估公司未来发展趋势与发展速度，成长能力是随着市场环境的变化，企业资产规模、盈利能力、市场占有率持续增长的能力，反映了企业未来的发展前景。主要考察指标为净利润增长率、主营业务收入增长率、主营业务利润增长率；

④估值分析：评估公司相对市场和行业的相对投资价值，选择价格低于价值的上市公司，或是比较企业动态市盈率等指标，选择目前估值水平明显较低或估值合理的上市公司，主要考察指标为市盈率(P/E)、市净率(P/B)、PEG、EV/EBITDA 等。

（2）定性分析

在定量分析的基础上，本基金将从以下几个方面，对公司基本面做进一步的定性分析，

选择具备投资潜力的个股。

①行业地位突出、有市场定价能力。属于行业龙头，具有较高的市场占有率，对产品定价具有较强的影响力。

②具有核心竞争力。在管理、品牌、资源、技术、创新能力中的某一方面或多个方面具有竞争对手在短期内难以模仿的显著优势，从而能够获得超越行业平均的盈利水平和增长速度。

③主营业务突出，具有良好的盈利能力。主营业务收入占比较高，盈利能力高于行业平均水平，未来盈利具有可持续性。

④公司治理结构规范，管理能力强。已建立合理的公司治理结构和市场化经营机制，管理层对企业未来发展有着明确的方向和清晰的思路。

3、行业配置策略

本基金在精选个股的基础上，对股票投资组合进行适度均衡的行业配置。本基金将对宏观经济发展状况及趋势、行业周期性及景气度、行业相对估值水平等方面进行研究，判断各个行业的相对投资价值。在此基础上，参考整体市场的行业资产分布比例，确定和动态调整各个行业的配置比例。

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、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。

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 and 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）股票资产占基金资产的 75%-95%，其中投资于内部研究组合中的股票的资产不低于股票资产的 80%；

（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 and 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；
- (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，不得超过基金资产净值的 10%；
- (16) 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；
- (17) 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；

(18) 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 75%-95%；

(19) 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%；

(20) 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。

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。

因证券市场波动、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，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。

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。

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) 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，但是国务院另有规定的除外；
- (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) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他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；
- (7) 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；
- (8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

(五) 业绩比较基准

沪深 300 指数收益率 $\times$ 85%+上证国债指数收益率 $\times$ 15%

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。

本基金是混合型基金，基金在运作过程中将维持 75%-95%的股票资产，其余资产投资于债券及其他具有高流动性的短期金融工具。本基金将业绩比较基准中股票指数与债券指数的权重确定为 85%和 15%，并用上证国债指数收益率代表债券资产收益率。因此，“沪深 300 指数收益率 $\times$ 85%+上证国债指数收益率 $\times$ 15%”是衡量本基金投资业绩的理想基准。

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

本基金是一只主动投资的混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高预期收益的基金产品。

（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；
3. 有利于基金财产的安全与增值；
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

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、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	745,664,064.95	91.07
	其中：股票	745,664,064.95	91.07
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	59,159,565.21	7.23
7	其他各项资产	13,923,312.26	1.70
8	合计	818,746,942.42	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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	623,131,558.58	76.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,831,807.00	1.82
E	建筑业	45,507,111.48	5.59
F	批发和零售业	47,070,419.62	5.78
G	交通运输、仓储和邮政业	131,314.89	0.02

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	11,320,083.22	1.39
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,671,770.16	0.45
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	745,664,064.95	91.60

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	002460	赣锋锂业	1,251,120	51,708,789.60	6.35
2	002456	欧菲光	1,314,179	49,754,816.94	6.11
3	002475	立讯精密	1,942,931	49,156,154.30	6.04
4	002466	天齐锂业	1,129,400	48,790,080.00	5.99
5	300115	长盈精密	1,407,447	40,900,409.82	5.02
6	300145	中金环境	1,010,776	28,685,822.88	3.52
7	002589	瑞康医药	696,171	28,556,934.42	3.51
8	600056	中国医药	1,045,631	24,718,716.84	3.04
9	002635	安洁科技	501,010	23,497,369.00	2.89
10	600703	三安光电	1,469,325	23,494,506.75	2.89

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名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

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没有超出基金合同规定的备选股票库。

3) 其他各项资产构成：

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	367,822.89
2	应收证券清算款	12,810,610.88
3	应收股利	—
4	应收利息	14,532.15
5	应收申购款	730,346.34
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	13,923,312.26

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:

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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。

六、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
2012/11/28-2012/12/31	5.30%	0.50%	14.74%	1.31%	-9.44%	-0.81%
2013/01/01-2013/12/31	40.17%	1.53%	-6.09%	1.18%	46.26%	0.35%
2014/01/01-2014/12/31	27.03%	1.29%	44.57%	1.03%	-17.54%	0.26%
2015/01/01-2015/12/31	61.28%	3.18%	5.66%	2.11%	55.62%	1.07%
2016/01/01-2016/12/31	-28.67%	1.97%	-9.08%	1.19%	-19.59%	0.78%
2017/01/01-2017/03/31	7.88%	0.83%	3.79%	0.44%	4.09%	0.39%

七、费用概览

(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、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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 3—7 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）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。

八、招募说明书更新部分说明

上投摩根核心优选混合型证券投资基金于 2012 年 11 月 28 日成立，至 2017 年 5 月 27 日运作满四年半。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 2017 年 1 月 11 日公告的《上投摩根核心优选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 2017 年 5 月 27 日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为 2017 年 3 月 31 日。
- 2、在“三、基金管理人”的“主要人员情况”中，对独立董事及投资决策委员等信息进行了更新。
- 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，对代销机构的信息进行了更新。
- 5、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。
- 6、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。
- 7、在“二十二、其他应披露事项”中，本披露期间内无需要披露的其他重要事项。

上投摩根基金管理有限公司

2017 年 7 月 11 日