

# 上投摩根安隆回报混合型证券投资基金（上投摩根安隆回报混合A）基金产品资料概要更新

编制日期：2022年3月22日

送出日期：2022年3月23日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。  
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

## 一、产品概况

|         |                                                                                     |                |            |
|---------|-------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------|
| 基金简称    | 上投摩根安隆回报混合                                                                          | 基金代码           | 004738     |
| 下属基金简称  | 上投摩根安隆回报混合A                                                                         | 下属基金代码         | 004738     |
| 基金管理人   | 上投摩根基金管理有限公司                                                                        | 基金托管人          | 杭州银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2018-02-08                                                                          |                |            |
| 基金类型    | 混合型                                                                                 | 交易币种           | 人民币        |
| 运作方式    | 普通开放式                                                                               | 开放频率           | 每个开放日      |
| 基金经理    | 陈圆明                                                                                 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2019-04-12 |
|         |                                                                                     | 证券从业日期         | 2009-07-01 |
|         | 唐璜                                                                                  | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021-04-16 |
|         |                                                                                     | 证券从业日期         | 2008-02-01 |
| 其他      | 根据本基金的基金合同的规定，基金合同生效后，如有连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万情形的，经履行相关程序后，基金合同应当终止。 |                |            |

## 二、基金投资与净值表现

### (一) 投资目标与投资策略

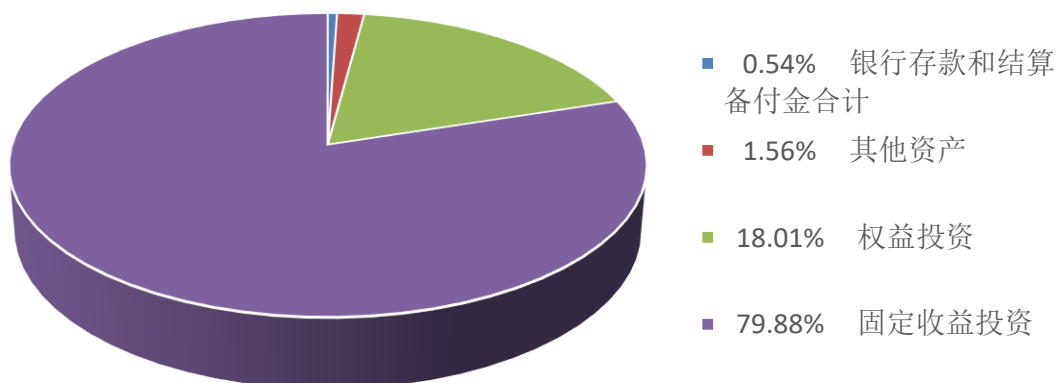
投资者欲了解详细情况，请阅读招募说明书第八章“基金的投资”。

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 以追求稳健收益作为基金的投资目标，通过严格的风险控制，力争实现基金资产的稳健增值。                                                                                                                                                                                                                                         |
| 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)、存托凭证、权证、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、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)。<br>股票资产占基金资产的 0%-30%；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，现金或到期日在一年期以 |

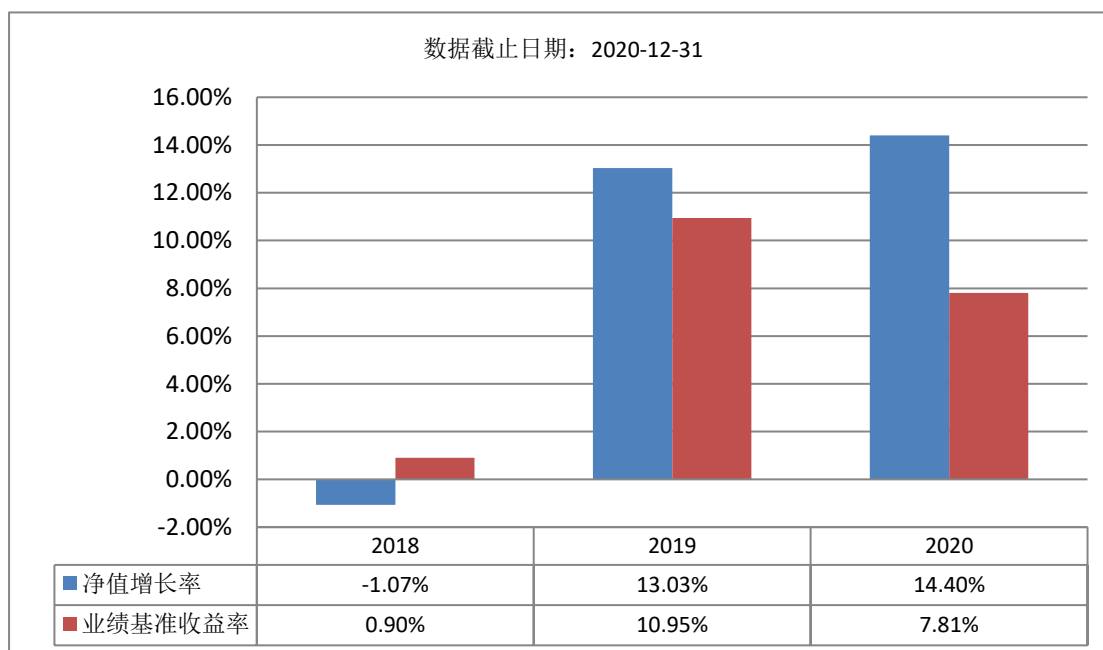
|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|---------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|               | <p>内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>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。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <b>主要投资策略</b> | <p><b>1、资产配置策略</b><br/>本基金将通过宏观经济、国家政策、资金面、市场估值水平和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行综合分析，评估股票、债券等各类资产风险收益特征，预测不同类别资产表现，确定合适的资产配置比例。同时采用严格的仓位控制策略，根据基金单位净值的变化和对未来市场的判断，灵活控制股票仓位，控制下行风险。</p> <p><b>2、债券投资策略</b><br/>本基金根据对财政政策、货币政策的分析以及对宏观经济的持续跟踪，结合不同债券品种的到期收益率、流动性、市场规模等情况，灵活运用久期策略、期限结构配置策略、信用债策略、可转债策略、中小企业私募债策略、证券公司短期债等多种投资策略，实施积极主动的组合管理，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，对债券组合进行动态调整。</p> <p><b>3、股票投资策略</b><br/>本基金将采用自下而上的分析方法，根据上市公司财务分析、盈利预期、治理结构等因素，结合股票的价值评估，以及对公司经营有实质性影响的事件，精选个股，构建投资组合。</p> <p><b>4、股指期货投资策略</b><br/>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。</p> <p><b>5、股票期权投资策略</b><br/>本基金将基于对证券市场的预判，并结合股指期权定价模型，选择估值合理的期权合约。</p> <p><b>6、资产支持证券投资策略</b><br/>本基金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，确定资产合理配置比例。</p> <p><b>7、存托凭证投资策略</b><br/>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> |
| <b>业绩比较基准</b> | <p>沪深300指数收益率×20%+中证综合债券指数收益率×80%</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| <b>风险收益特征</b> | <p>本基金属于混合型基金产品，预期风险和收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于中等风险收益水平的基金产品。根据2017年7月1日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和相关销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |

**(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表**  
**投资组合资产配置图表**

数据截止日期：2021-12-31



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：本基金过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

| 费用类型      | 份额 (S) 或金额 (M)<br>/ 持有期限 (N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|-----------|------------------------------|---------|----|
| 申购费 (前收费) | 0 元 ≤ M < 100 万元             | 1.00%   |    |
|           | 100 万元 ≤ M < 500 万元          | 0.60%   |    |

|     |                  |          |
|-----|------------------|----------|
|     | M ≥ 500 万元       | 1000 元/笔 |
| 赎回费 | 0 天 ≤ N < 7 天    | 1.50%    |
|     | 7 天 ≤ N < 30 天   | 0.75%    |
|     | 30 天 ≤ N < 180 天 | 0.50%    |
|     | N ≥ 180 天        | 0.00%    |

## (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别 | 收费方式/年费率                        |
|------|---------------------------------|
| 管理费  | 0.60%                           |
| 托管费  | 0.10%                           |
| 其他费用 | 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费用。 |

注：本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

## 四、风险揭示与重要提示

### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者欲购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金的风险主要包括：

#### 1、市场风险

主要的风险因素包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险。

#### 2、管理风险

#### 3、流动性风险

#### 4、特定风险

本基金的股票资产占基金资产的 0%-30%，存在基金经理的预判与市场实际表现存在较大差异，导致资产配置不合理，进而影响基金收益的风险。

#### 5、股指期货投资风险

主要的风险因素包括：市场风险、市场流动性风险、结算流动性风险、基差风险、信用风险、作业风险

#### 6、股票期权投资风险

主要的风险因素包括：市场风险、流动性风险、保证金风险、基差风险、信用风险、操作风险

#### 7、中小企业私募债投资风险

#### 8、资产支持证券投资风险

#### 9、存托凭证的投资风险

#### 10、启用侧袋机制的风险

#### 11、操作或技术风险

#### 12、合规性风险

#### 13、其他风险

关于本基金完整的风险揭示请见本基金的《招募说明书》的“风险揭示”章节。

### (二) 重要提示

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。

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。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用及律师费用由败诉方承担。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站

网址：[www.cifm.com](http://www.cifm.com) 客服电话：400-889-4888

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料