

# 上投摩根阿尔法混合型证券投资基金（上投摩根阿尔法混合C）基金产品资料概要更新

编制日期：2022年5月5日

送出日期：2022年5月6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	上投摩根阿尔法混合	基金代码	377010
下属基金简称	上投摩根阿尔法混合C	下属基金代码	015637
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
基金合同生效日	2005-10-11		
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	李博	开始担任本基金基金经理的日期	2015-09-18
		证券从业日期	2009-08-05

注：本基金自2022年5月6日起增加C类基金份额。

## 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	本基金采用哑铃式投资技术(Barbell Approach)，同步以“成长”与“价值”双重量化指标进行股票选择。在基于由下而上的选股流程中，精选个股，纪律执行，构造出相对均衡的不同风格类资产组合。同时结合公司质量、行业布局、风险因子等深入分析，对资产配置进行适度调整，努力控制投资组合的市场适应性，以求多空环境中都能创造超越业绩基准的主动管理回报。
投资范围	本基金的投资范围为股票、存托凭证、债券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许的其它投资品种。股票投资范围为所有在国内依法发行的A股，债券投资的主要品种包括国债、金融债、企业债、可转换债券等，货币市场工具包括短期票据、回购、银行存款以及一年以内（含一年）的国债、金融债、企业债等。在正常情况下，本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的60—95%，其它为5—40%，并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。
主要投资策略	本基金充分借鉴摩根资产管理集团全球行之有效的投资理念和技术，

依据中国资本市场的具体特征，引入集团在海外市场成功运作的“Dynamic Fund”基金产品概念。具体而言，本基金将以量化指标分析为基础，通过严格的证券选择，积极构建并持续优化“哑铃式”资产组合，结合严密的风险监控，不断谋求超越业绩比较基准的稳定回报。

1、股票投资策略

包括1) 选取价值/成长因子、2) 计算股票风格等级、3) 创造主动管理报酬。

2、固定收益类投资策略

本基金以股票投资为主，为控制股票投资风险，优化组合流动性管理，本基金会适度考虑配置防御性资产，进行债券、货币市场工具等品种的投资。

3、存托凭证投资策略

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。

业绩比较基准

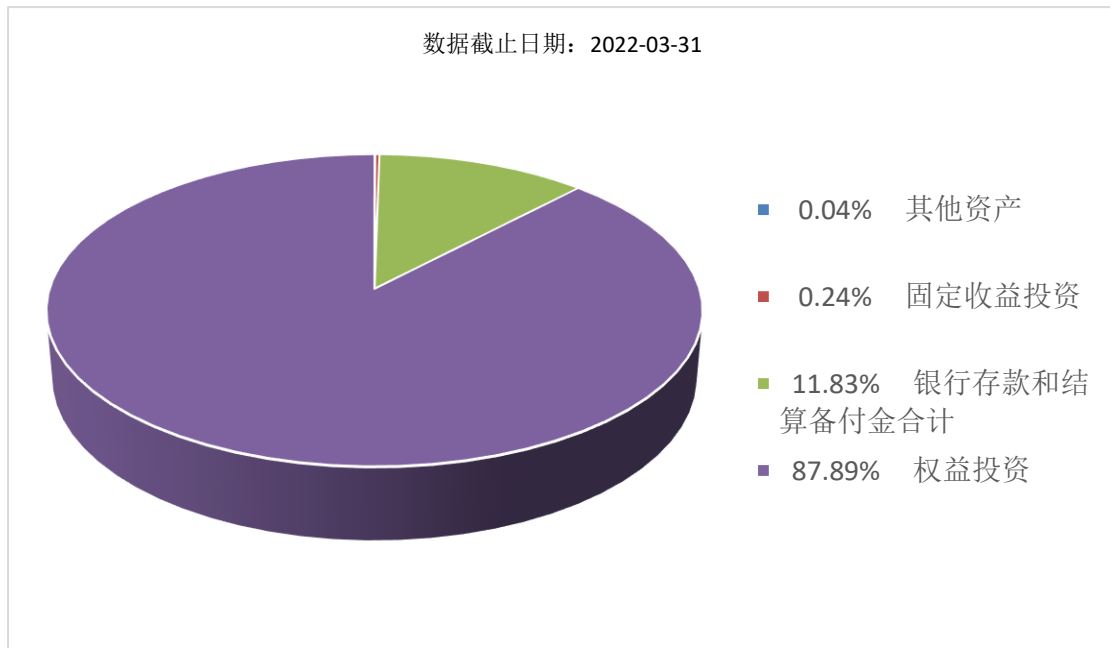
沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%

风险收益特征

本基金是混合型证券投资基金，预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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。

(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



(三) 最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图无。

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) /持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
赎回费	0 天 $\leq$ N < 7 天	1.50%	
	7 天 $\leq$ N < 30 天	0.50%	
	N $\geq$ 30 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	1.50%
托管费	0.25%
销售服务费	0.60%
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、购买力风险。

#### 2、信用风险

#### 3、投资风险

#### 4、流动性风险

#### 5、管理风险

#### 6、操作或技术风险

#### 7、合规性风险

#### 8、科创板股票投资风险

主要的风险因素包括：科创板股票的流动性风险、科创板企业退市风险、投资集中度风险、市场风险、系统性风险、股价波动风险、政策风险

#### 9、存托凭证的投资风险

#### 10、启用侧袋机制的风险

#### 11、其它风险

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核准，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。

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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