**上投摩根安裕回报混合型证券投资基金**

**2019年第4季度报告**

**2019年12月31日**

**基金管理人：上投摩根基金管理有限公司**

**基金托管人：交通银行股份有限公司**

**报告送出日期：二〇二〇年一月二十日**

# §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年10月1日起至12月31日止。

# §2 基金产品概况

|  |  |
| --- | --- |
| 基金简称 | 上投摩根安裕回报混合 |
| 基金主代码 | 004823 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年9月13日 |
| 报告期末基金份额总额 | 387,163,627.03份 |
| 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。 |
| 投资策略 | 1、资产配置策略 在大类资产配置上，本基金通过对宏观经济环境、财政政策、货币政策、 产业政策的分析和预测，判断宏观经济所处的经济周期及运行趋势，结合对资金 供求状况、股票债券市场的估值水平以及市场情绪的分析，评估各类别资产的风 险收益特征，并加以分析比较，形成对不同类别资产表现的预测，确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产间的配置比例。本基金密切关注市场风险的变化以及各类别资产的风险收益的相对变化趋势，动态调整各大类资产之间的比例，在严格控制基金下行风险的前提下，力争提高基金收益。 2、债券投资策略本基金在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据对财政政策、货币政策的深入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。 3、股票投资策略 本基金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。 对于港股，本基金在分析宏观经济形势和行业发展基础上，精选港股市场中的优质上市企业，有针对性地根据不同指标选取具有成长性和投资价值的上市公司构建股票池。4、股指期货投资策略本基金在进行股指期货投资时，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。5、股票期权投资策略本基金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。 6、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。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×30%+中证综合债券指数收益率×70% |
| 风险收益特征 | 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。本基金风险收益特征会定期评估并在公司网站发布，请投资者关注。 |
| 基金管理人 | 上投摩根基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 下属分级基金的基金简称 | 上投摩根安裕回报混合A | 上投摩根安裕回报混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004823 | 004824 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 200,239,801.29份 | 186,923,825.74份 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

**3.1 主要财务指标**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 主要财务指标 | 报告期(2019年10月1日-2019年12月31日) |
| 上投摩根安裕回报混合A | 上投摩根安裕回报混合C |
| 1.本期已实现收益 | 5,221,844.20 | 4,164,998.49 |
| 2.本期利润 | 10,463,723.23 | 9,026,667.58 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0514 | 0.0506 |
| 4.期末基金资产净值 | 232,164,560.47 | 214,626,604.74 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1594 | 1.1482 |

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

**3.2 基金净值表现**

**3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较**

**1、上投摩根安裕回报混合A：**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 |
| 过去三个月 | 4.64% | 0.22% | 3.07% | 0.22% | 1.57% | 0.00% |

**2、上投摩根安裕回报混合C：**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 |
| 过去三个月 | 4.46% | 0.22% | 3.07% | 0.22% | 1.39% | 0.00% |

**3.2.2　自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较**

上投摩根安裕回报混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018年9月13日至2019年12月31日)

1．上投摩根安裕回报混合A：



注：本基金合同生效日为2018年9月13日，图示时间段为2018年9月13日至2019年12月31日。

本基金建仓期自2018年9月13日至2019年3月12日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

2．上投摩根安裕回报混合C：



注：本基金合同生效日为2018年9月13日，图示时间段为2018年9月13日至2019年12月31日。

本基金建仓期自2018年9月13日至2019年3月12日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

# §4 管理人报告

**4.1 基金经理（或基金经理小组）简介**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | 证券从业年限 | 说明 |
| 任职日期 | 离任日期 |
| 施虓文 | 本基金基金经理 | 2018-09-13 | - | 8年 | 基金经理施虓文先生，北京大学经济学硕士，2012年7月起加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任助理研究员、研究员/基金经理助理、基金经理，主要承担量化支持方面的工作。自2017年1月至2019年9月担任上投摩根安丰回报混合型证券投资基金基金经理，2017年1月至2018年10月担任上投摩根安泽回报混合型证券投资基金基金经理，自2017年12月起同时担任上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金基金经理，自2018年2月至2019年4月同时担任上投摩根安隆回报混合型证券投资基金基金经理，2018年2月至7月担任上投摩根安腾回报混合型证券投资基金基金经理，2018年4月起同时担任上投摩根富时发达市场REITs指数型证券投资基金（QDII）基金经理，2018年9月起同时担任上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金经理，自2019年4月起同时担任上投摩根安通回报混合型证券投资基金基金经理，自2019年12月起同时担任上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根优选多因子股票型证券投资基金及上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金基金经理。 |
| 聂曙光 | 本基金基金经理、债券投资部总监 | 2018-09-13 | - | 10年 | 聂曙光先生自2004年8月至2006年3月在南京银行任债券分析师；2006年3月至2009年9月在兴业银行任债券投资经理；2009年9月至2014年5月在中欧基金管理有限公司先后担任研究员、基金经理助理、基金经理、固定收益部总监、固定收益事业部临时负责人等职务，自2014年5月起加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任基金经理、债券投资部总监兼资深基金经理，自2014年8月起担任上投摩根纯债债券型证券投资基金基金经理，自2014年10月起担任上投摩根红利回报混合型证券投资基金基金经理，自2014年11月起担任上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金基金经理，自2015年1月起同时担任上投摩根稳进回报混合型证券投资基金基金经理，自2015年4月至2018年11月同时担任上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金经理，自2016年6月至2020年1月同时担任上投摩根优信增利债券型证券投资基金基金经理，自2016年8月起同时担任上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金基金经理，2016年8月至2018年9月担任上投摩根岁岁丰定期开放债券型证券投资基金基金经理，自2017年1月至2018年12月同时担任上投摩根安瑞回报混合型证券投资基金基金经理，自2017年4月起同时担任上投摩根安通回报混合型证券投资基金基金经理，自2018年9月起同时担任上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金经理，自2019年8月起同时担任上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金和上投摩根丰瑞债券型证券投资基金基金经理。 |
| 陈圆明 | 本基金基金经理、绝对收益投资部总监 | 2019-04-12 | - | 11年 | 陈圆明先生，自2009年7月至2010年6月在东海证券有限责任公司任研究员；2010年7月至2011年8月在国联安基金管理有限公司任研究员；2011年8月至2014年9月在国投瑞银基金管理有限公司任研究员、投资经理；2014年9月至2019年2月在鹏华基金管理有限公司任投资经理、绝对收益副总监；2019年2月起加入上投摩根基金管理有限公司，现担任绝对收益投资部总监兼基金经理；自2019年4月起同时担任上投摩根安裕回报混合型证券投资基金和上投摩根安隆回报混合型证券投资基金基金经理，自2019年11月起同时担任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理。 |

注：1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 施虓文先生及聂曙光先生为本基金首任基金经理，其任职日期指本基金基金合同生效之日。

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

**4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明**

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

**4.3 公平交易专项说明**

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的分析，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形：无。

**4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2019年四季度，宏观经济处于小滞涨环境。CPI增速在9月份破3%以后一路上行，压力预计将持续至2020年一季度。固定资产投资、工业增加值、消费数据等经济数据低位徘徊。央行主动下调公开市场利率以及MLF利率以体现对宏观经济的呵护。在货币政策加码下，金融数据呈底部企稳的趋势。证券市场表现方面，债券市场在通胀的压力下，先跌后涨。以10年期国债为例，收益率在10月底一度上行20bp至3.3125，随后随着利率走廊利率的下调，收益率回落至3.1322，全季度走势基本持平。转债市场在货币政策宽松预期下，受到溢价率和平价双轮驱动，整体表现较好，可转债指数上行6.82%。权益市场上涨，上证综指四季度上涨4.99%，创业板指数上涨10.48%，其中建材、家电、汽车、传媒、电子等行业涨幅靠前。

运作期内，本基金债券投资方面，在收益率高点时积极拉长了久期，股票配置以高股息低估值的品种为主，以性价比出发点，选择具备绝对收益属性的品种，以期为组合提供增厚收益。

展望后市，财政政策、货币政策对经济的倾斜力度有所加大，这对信用的扩张和经济的企稳都将起到重要的托底作用。库存周期有望阶段性筑底回升，通胀的压力在上半年较大，在此环境下预计市场整体上行和下行空间都有限。组合将保持中性的仓位，坚持选择性价比较高的品种，争取创造稳健的收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期上投摩根安裕回报混合A份额净值增长率为:4.64%，同期业绩比较基准收益率为:3.07%,

上投摩根安裕回报混合C份额净值增长率为:4.46%，同期业绩比较基准收益率为:3.07%。

**4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明**

无。

# §5 投资组合报告

**5.1 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 | 120,065,369.46 | 25.92 |
|  | 其中：股票 | 120,065,369.46 | 25.92 |
| 2 | 固定收益投资 | 191,678,556.80 | 41.38 |
|  | 其中：债券 | 191,678,556.80 | 41.38 |
|  | 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 | 140,000,000.00 | 30.23 |
|  | 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 | 8,764,016.61 | 1.89 |
| 7 | 其他各项资产 | 2,669,947.46 | 0.58 |
| 8 | 合计 | 463,177,890.33 | 100.00 |

**5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

 **5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 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 | 41,345,926.19 | 9.25 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 24,141,047.54 | 5.40 |
| E | 建筑业 | 13,509,693.20 | 3.02 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,716,875.00 | 0.61 |
| 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 | 22,436,690.37 | 5.02 |
| K | 房地产业 | 12,861,898.56 | 2.88 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 3,046,660.56 | 0.68 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 6,578.04 | 0.00 |
| 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 | 120,065,369.46 | 26.87 |

**5.3 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 | 601668 | 中国建筑 | 2,403,860.00 | 13,509,693.20 | 3.02 |
| 2 | 000537 | 广宇发展 | 1,655,328.00 | 12,861,898.56 | 2.88 |
| 3 | 601965 | 中国汽研 | 1,399,075.00 | 11,584,341.00 | 2.59 |
| 4 | 002833 | 弘亚数控 | 232,467.00 | 9,245,212.59 | 2.07 |
| 5 | 601398 | 工商银行 | 1,477,265.00 | 8,686,318.20 | 1.94 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 206,100.00 | 7,745,238.00 | 1.73 |
| 7 | 600674 | 川投能源 | 780,300.00 | 7,685,955.00 | 1.72 |
| 8 | 600886 | 国投电力 | 798,640.00 | 7,331,515.20 | 1.64 |
| 9 | 002614 | 奥佳华 | 641,813.00 | 6,790,381.54 | 1.52 |
| 10 | 600483 | 福能股份 | 715,415.00 | 6,581,818.00 | 1.47 |

**5.4 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 | 86,408,930.60 | 19.34 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 31,123,500.00 | 6.97 |
|  | 其中：政策性金融债 | 31,123,500.00 | 6.97 |
| 4 | 企业债券 | 46,313,372.20 | 10.37 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 27,832,754.00 | 6.23 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 191,678,556.80 | 42.90 |

**5.5 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 | 132013 | 17宝武EB | 268,350 | 27,167,754.00 | 6.08 |
| 2 | 019611 | 19国债01 | 229,950 | 23,008,797.00 | 5.15 |
| 3 | 018007 | 国开1801 | 210,000 | 21,157,500.00 | 4.74 |
| 4 | 180017 | 18附息国债17 | 200,000 | 20,716,000.00 | 4.64 |
| 5 | 180024 | 18附息国债24 | 150,000 | 15,949,500.00 | 3.57 |

**5.6　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。

**5.7 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。

**5.8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权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 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。

**5.10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。

**5.11投资组合报告附注**

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

5.11.2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。

**5.11.3其他资产构成**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 名称 | 金额(元) |
| 1 | 存出保证金 | 117,648.19 |
| 2 | 应收证券清算款 | 17,372.13 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,452,100.78 |
| 5 | 应收申购款 | 82,826.36 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,669,947.46 |

**5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 1 | 132013 | 17宝武EB | 27,167,754.00 | 6.08 |

**5.11.5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。

**5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分**

因四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

# §6 开放式基金份额变动

单位：份

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 上投摩根安裕回报混合A | 上投摩根安裕回报混合C |
| 本报告期期初基金份额总额 | 201,291,575.43 | 101,393,110.90 |
| 报告期基金总申购份额 | 47,620,962.85 | 109,026,668.39 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 48,672,736.99 | 23,495,953.55 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 200,239,801.29 | 186,923,825.74 |

# §7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

**7.1基金管理人持有本基金份额变动情况**

无。

# §8 影响投资者决策的其他重要信息

**8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
| 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20191001-20191231 | 97,741,178.77 | 0.00 | 0.00 | 97,741,178.77 | 25.25% |
| 产品特有风险 |
| 本基金的集中度风险主要体现在有单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%，如果投资者发生大额赎回，可能出现基金可变现资产无法满足投资者赎回需要以及因为资产变现成本过高导致投资者的利益受到损害的风险。 |

# §9 备查文件目录

**9.1备查文件目录**

1. 中国证监会批准上投摩根安裕回报混合型证券投资基金设立的文件；

2. 《上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金合同》；

3. 《上投摩根安裕回报混合型证券投资基金托管协议》；

4. 《上投摩根开放式基金业务规则》；

5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；

6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

**9.2存放地点**

基金管理人或基金托管人住所。

**9.3查阅方式**

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

**上投摩根基金管理有限公司**

**二〇二〇年一月二十日**