

2013年8月27日 星期二

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
报告送出日期：二〇一三年八月二十七日

1 重要提示

基金管理人的董事会、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、完整性承担责任个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要自2013年8月26日起至2013年6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	上投摩根纯债债券
基金主代码	371020
交易代码	371020/371120
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月24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
报告期基金份额总额	102,696,615.82份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	上投摩根纯债债券A
下属分级基金的交易代码	371020
报告期末下属分级基金的份额总额	50,906,890.85份
报告期末下属分级基金的份额总额	51,789,724.91份

2.2 基产品说明

投资目标	本基金将根据对利率趋势的预判，适时规划与调整组合目标久期，结合主动性资产配置，在严格控制组合波动率的前提下，提高基金资产流动性，以追求超越行业基准的收益回报。
投资策略	目标久期管理是通过固定收益类投资的安全性、收益性与流动性。本基金严格遵循价值投资原则，对宏观经济、安全政策、货币政策、资产负债状况、资金供求关系、信用利差等多方面进行深入研究，通过审慎的资产配置和组合管理，制定中期管理计划，通过合理的资产配置及组合管理，控制投资风险，追求可持续的、超出现价比较基准的投资收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中国国债指数。
风险收益特征	本基金是债券型基金，在证券投资基金中属于较低风险品种，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于货币市场基金。

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上投摩根基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 肖洪津	联系人 赵会军
联系电话	021-38794888	010-66105799
电子邮箱	services@pmf-sitico.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-889-4888	95588
传真	021-68881170	010-66105798

4.1 信息披露方式	登载基金半年度报告正文的管理人互 联网网址	http://www.51fund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所	

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

		金额单位：人民币元	
		报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)	
		上投摩根纯债债券A	上投摩根纯债债券B
本期已实现收益		856,308.63	1,213,927.47
本期利润		958,803.43	1,355,965.96
加权平均基金份额本期利润		0.0274	0.0259
本期基金份额净值增长		3.01%	2.77%
		报告期末(2013年6月30日)	
上投摩根纯债债券A		上投摩根纯债债券B	
期末可供分配基金利润	0.0827	0.0641	
期末基金财产净值	55,698,200.20	55,697,221.35	
期末基金净值	1.094	1.075	

注：1.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。对期末可供分配利润，采用期末资产的账面价值减去负债后的余额，即为持有人可供分配的利润。

2.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、基金转换费等，计入费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.基金净值表现

3.1 基金份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根纯债债券A

阶段	份额净值增长 率增长(%)	份额净值增 长率标准差(②)	业绩比较基 准收益率(%)	业绩比较基 准收益率标准差(%)	①(③)	②(④)
过去一个月	-1.35%	0.26%	-0.70%	0.22%	-0.65%	0.04%
过去三个月	0.09%	0.18%	0.03%	0.13%	-0.03%	0.05%
过去六个月	3.01%	0.14%	0.47%	0.10%	2.54%	0.04%
过去一年	3.40%	0.12%	-0.98%	0.08%	4.38%	0.04%
过去三年	6.42%	0.13%	-0.58%	0.10%	7.00%	0.03%
自基金合同生 效起至今	9.40%	0.11%	-0.18%	0.09%	9.58%	0.02%

注：本基金的业绩比较基准为中国国债总指数。

3.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

上投摩根纯债债券A



上投摩根纯债债券B



注：1.基金合同生效日为2009年6月24日，图示时间段为2009年6月24日至2013年6月30日。

2.本基金建仓期自2009年6月24日至2009年12月31日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同的规定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上投摩根基金管理有限公司经中国证监会监督管理委员会批准，于2004年5月12日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007年8月更名为“上海国际信托有限公司”）与上海摩根资产管理（美国）有限公司合资设立，注册资本为2.5亿元人民币，注册地上海。截至2013年6月底，公司管理的基金共有三十二只，均为开放式基金，分别是：上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根阿尔法股票型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋股票型证券投资基金、上投摩根进取偏债混合型证券投资基金、上投摩根双债增强债券型证券投资基金、上投摩根双债增强债券型证券投资基金、上投摩根中证股票型证券投资基金、上投摩根积极新兴产业股票型证券投资基金、上投摩根深蓝股票型证券投资基金、上投摩根核心优选股票型证券投资基金、上投摩根稳健债券型证券投资基金、上投摩根新动力股票型证券投资基金、上投摩根新兴行业股票型证券投资基金、上投摩根成长动力股票型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根智选30股票型证券投资基金和上投摩根成长动力股票型证券投资基金。上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根双债增强债券型证券投资基金、上投摩根进取偏债混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋股票型证券投资基金、上投摩根深蓝股票型证券投资基金、上投摩根积极新兴产业股票型证券投资基金、上投摩根稳健债券型证券投资基金、上投摩根新动力股票型证券投资基金、上投摩根新兴行业股票型证券投资基金、上投摩根成长动力股票型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根智选30股票型证券投资基金和上投摩根成长动力股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理助理经验

4.1.3 基金经理助理经验

4.1.4 基金经理助理经验

4.1.5 基金经理助理经验

4.1.6 基金经理助理经验

4.1.7 基金经理助理经验

4.1.8 基金经理助理经验

4.1.9 基金经理助理经验

4.1.10 基金经理助理经验

4.1.11 基金经理助理经验

4.1.12 基金经理助理经验

4.1.13 基金经理助理经验

4.1.14 基金经理助理经验

4.1.15 基金经理助理经验

4.1.16 基金经理助理经验

4.1.17 基金经理助理经验

4.1.18 基金经理助理经验

4.1.19 基金经理助理经验

4.1.20 基金经理助理经验

4.1.21 基金经理助理经验

4.1.22 基金经理助理经验

4.1.23 基金经理助理经验

4.1.24 基金经理助理经验

4.1.25 基金经理助理经验

4.1.26 基金经理助理经验

4.1.27 基金经理助理经验

4.1.28 基金经理助理经验

4.1.29 基金经理助理经验

4.1.30 基金经理助理经验

4.1.31 基金经理助理经验

4.1.32 基金经理助理经验

4.1.33 基金经理助理经验

4.1.34 基金经理助理经验

4.1.35 基金经理助理经验

4.1.36 基金经理助理经验

4.1.37 基金经理助理经验

4.1.38 基金经理助理经验

4.1.39 基金经理助理经验

4.1.40 基金经理助理经验

4.1.41 基金经理助理经验

4.1.42 基金经理助理经验

4.1.43 基金经理助理经验

4.1.44 基金经理助理经验

4.1.45 基金经理助理经验

<p