

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
报告送出日期:二〇一三年八月二十七日
重要提示
1.1 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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金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。
1.2 基金托管人经中国建设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数据、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。
1.3 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。
1.4 基金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摘要。
1.5 本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。
1.6 本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 上投摩根强化回报债券类
基金主代码 372010/372110
交易代码 372010/372110
基金运作方式契约型开放式
基金合同生效日 2011年6月10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
报告期末基金总资产 177,500,635.06元
基金合同的存续期间 不定期
下属分级基金的基金简称 上投摩根强化回报债券A类
基金代码 372110
下属分级基金的交易代码 372110
报告期末下属分级基金的份额总额 139,133,504.54份
38,367,130.52份
2.2 基金产品说明

投资目标 本基金在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上，通过主动管理，力争超越业绩比较基准的投资收益，实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金将通过对宏观经济、金融市场的动态研究及新发债的发行定价、申购、认购资金的预测，适度参与一级市场和二级市场的股票投资；在“控风险、保收益”的前提下，力求获取基金的整体收益水平。本基金将通过深入分析宏观经济、政策环境、行业趋势、基本面等，把握投资机会，实施积极的债券投资组合管理，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合增值。

业绩比较基准 中信标普全债指数

风险收益特征 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

名称 姓名 职业
信息披露负责人 邵海擎 法务
联系电话 021-38794888
电子邮箱 services@imf-sitco.com
客户服务电话 400-889-4888
传真 021-68881170
010-66275853

2.4 信息披露方式

本基金半年度报告正文的管理人互连网址: <http://www.51fund.com>

基金半年度报告置地点 基金管理人、基金托管人的办公场所

3 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标

上投摩根强化回报债券A类 1,983,529.74

本期已实现收益 753,648.63
0.047,164.83

本期基金份额净值增长率 3.21%
3.04%

报告期(2013年1月1日至2013年6月30日) 上投摩根强化回报债券B类
0.0598 0.0510

期末可供分配基金份额利润 147,460,341.08
40,325,607.58

期末基金份额净值 1.060
1.051

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，本期利息收入为本期平均公允价值变动收益。对期末可供分配利润，采用期末净资产乘以分配比例与未分配利润中已实现部分的孰低数。
2.上述基金业绩指标包括持有人员或交易或买卖的各项目用例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投费、基金转换费等，具体费用后应用实际收益水平低于所列示数字。

3.2.1 基金净值表现

3.2.2 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

上投摩根强化回报债券A类

阶段 份额净值增长率为
长率与基准
差(%) ①
业绩比较基
准收益率(%) ②
业绩比较基
准收益率差
额(%) ③
①-③ ②-④

过去一个月 -3.20% 0.48% -0.30% 0.07% -0.29% 0.41%

过去三个月 -1.58% 0.39% 0.97% 0.05% -2.55% 0.34%

过去六个月 3.21% 0.38% 2.62% 0.04% 0.59% 0.34%

过去一年 3.35% 0.34% 3.76% 0.04% -0.41% 0.30%

过去三年 - - - - - -

自基金合同生
效起至今 10.17% 0.28% 9.57% 0.05% -0.31% 0.23%

注:本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较

上投摩根强化回报债券型证券投资基金

份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图

2011年8月10日至2013年6月30日 上投摩根强化回报债券A类

注:截至2013年6月30日，上投摩根强化回报债券型证券投资基金份额为177,500,635.06份，其中A类份额139,133,504.54份，其中B类份额38,367,130.52份。A类份额净值为1.060元，B类份额净值为1.051元。

6.1 利润分配

会计主体:上投摩根强化回报债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.2 利润表

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.3 所有者权益变动表

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.4 报表附注

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.5 重要事项

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.6 其他重要事项

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.7 附录

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.8 附录

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.9 附录

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.10 附录

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.11 附录

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.12 附录

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.13 附录

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.14 附录

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.15 附录

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.16 附录

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.17 附录

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.18 附录

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.19 附录

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.20 附录

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

6.21 附录

会 计 主 体: 上 投 摩 根 强 化 回 报 债 券 型 证 券 投 资 基 金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元