

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更新。

1.5 本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。

1.7 **基金简介**

1.8 **基金基本情况**

1.9 **基金简称** 上投摩根强化回报债券型证券投资基金  
1.10 **基金主代码** 372010/372110  
1.11 **交易代码** 372010/372110  
1.12 **基金运作方式**契约型开放式  
1.13 **基金合同生效日** 2011年6月10日  
1.14 **基金管理人**上投摩根基金管理有限公司  
1.15 **基金托管人**中国建设银行股份有限公司  
1.16 **报告期末基金份额总额** 177,500,635.06份  
1.17 **基金合同的存续期间** 不定期  
1.18 **下属分级基金的基金简称** 上投摩根强化回报债券A类 上投摩根强化回报债券B类  
1.19 **基金代码** 372100 372110  
1.20 **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  
1.21 **基金产品说明**

1.22 **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，力争获得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。  
1.23 **投资策略** 本基金将通过对宏观经济金融工具的主动管理，力求获取稳定的绝对回报。本基金将根据对宏观经济的研究判断及新股票投资、申购、赎回申请的预测，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，力求获得基金的整体收益水平。  
1.24 **业绩比较基准** 中信标普全债指数  
1.25 **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。

1.26 **2.3 基金管理人和基金托管人**

1.27 **项目** 基金管理人 基金托管人  
1.28 **名称** 上投摩根基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司  
1.29 **姓名** 邵海鹰 田青  
1.30 **信息披露负责人** 联系电话 021-38794888 010-67590596  
电子邮箱 services@imf-sitco.com tianping1.sh@ccib.com  
1.31 **客户服务电话** 400-889-4888 010-67590596  
传真 021-68881170 010-66275853  
1.32 **4.2 信息披露方式**

1.33 **基金半年度报告正文中涉及的管理人互联网网址** http://www.51fund.com  
1.34 **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

1.35 **3 主要会计数据和财务指标**

1.36 **金额单位:人民币元**

1.37 **3.1.1期间数据和指标**

1.38 **上投摩根强化回报债券A类** 2,768,482.28 1,983,529.74  
1.39 **本期已实现收益** 753,648.63 1,447,164.83  
1.40 **本期每基金份额利润** 0.0076 0.0333  
1.41 **本期基金份额净值增长率** 3.21% 3.04%  
1.42 **报告期期末(2013年6月30日)** 上投摩根强化回报债券A类 13,770,510.00 13,792,725.26  
1.43 **期末可供分配基金份额利润** 0.0598 0.0510  
1.44 **期末基金份额净值** 147,460,341.08 40,325,607.58  
1.45 **期末基金份额净值增长率** 1.060 1.051  
1.46 **注:**本项为本期已实现收益折算后、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，期末数为本期已实现收益加上本期平均净值变动收益。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。

1.47 **2.上述基金业绩指标只包括持有认购或交易的各项目的费用(例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投费、基金转换费等)，未考虑应用后投资收益水平将低于所列数字。**

1.48 **3.基金净值的表现**

1.49 **3.2.1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**

1.50 **上投摩根强化回报债券A类**

1.51 **注:**本基金的业绩比较基准为：中信标普全债指数。

1.52 **3.2.2基本基金份额以来截至基金份额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**

1.53 **上投摩根强化回报债券型证券投资基金管理人**

1.54 **份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图**

1.55 **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

1.56 **上投摩根强化回报债券B类**

1.57 **注:**本基金合同生效日为2011年6月10日，图示时间段为2011年8月10日至2013年6月30日。

1.58 **本基金建仓期自2011年8月10日至2012年2月9日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的规定。**

1.59 **4 管理人报告**

1.60 **4.1 基金管理人及其基金经理的情况**

1.61 **基金管理人以其管理基金的经验**

1.62 **上投摩根基金管理有限公司经中国证监会监督委员会批准，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10月8日更名为“上海国际信托有限公司”)与摩根资产管理(英国)有限公司合资设立，注册资本为5亿元人民币，注册地在上海。截至2013年底，公司管理的基金共有一百三十三只，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、上投摩根稳健配置证券投资基金、上投摩根行业轮动基金、上投摩根双债盈混合型证券投资基金、上投摩根双债添利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、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、上投摩根新动力股票型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根双债添利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、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金。**

1.63 **4.1.2 基金经理的基本情况**

1.64 **4.1.2.1 基金经理的简介**

1.65 **4.1.2.2 基金经理的从业经历**

1.66 **4.1.2.3 基金经理的薪酬待遇**

1.67 **4.1.2.4 基金经理的诚信记录**

1.68 **4.1.2.5 基金经理的过往业绩**

1.69 **4.1.2.6 基金经理的其他情况**

1.70 **4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明**

1.71 **4.2.1 公司治理的执行情况**

1.72 **4.2.2 报告期内持续贯彻执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的情况**

1.73 **4.2.3 证券从业人员买卖股票的情况**

1.74 **4.2.4 管理人对报告期本基金运作合规性情况的说明**

1.75 **4.3 公司治理的执行情况**

1.76 **4.3.1 公司治理的执行情况**

1.77 **4.3.2 证券从业人员买卖股票的情况**

1.78 **4.3.3 证券从业人员买卖股票的情况**

1.79 **4.3.4 证券从业人员买卖股票的情况**

1.80 **4.3.5 证券从业人员买卖股票的情况**

1.81 **4.3.6 证券从业人员买卖股票的情况**

1.82 **4.3.7 证券从业人员买卖股票的情况**

1.83 **4.3.8 证券从业人员买卖股票的情况**

1.84 **4.3.9 证券从业人员买卖股票的情况**

1.85 **4.3.10 证券从业人员买卖股票的情况**

1.86 **4.3.11 证券从业人员买卖股票的情况**

1.87 **4.3.12 证券从业人员买卖股票的情况**

1.88 **4.3.13 证券从业人员买卖股票的情况**

1.89 **4.3.14 证券从业人员买卖股票的情况**

1.90 **4.3.15 证券从业人员买卖股票的情况**

1.91 **4.3.16 证券从业人员买卖股票的情况**

1.92 **4.3.17 证券从业人员买卖股票的情况**

1.93 **4.3.18 证券从业人员买卖股票的情况**

1.94 **4.3.19 证券从业人员买卖股票的情况**

1.95 **4.3.20 证券从业人员买卖股票的情况**

1.96 **4.3.21 证券从业人员买卖股票的情况**

1.97 **4.3.22 证券从业人员买卖股票的情况**

1.98 **4.3.23 证券从业人员买卖股票的情况**

1.99 **4.3.24 证券从业人员买卖股票的情况**

1.10 **4.3.25 证券从业人员买卖股票的情况**

1.11 **4.3.26 证券从业人员买卖股票的情况**

1.12 **4.3.27 证券从业人员买卖股票的情况**

1.13 **4.3.28 证券从业人员买卖股票的情况**

1.14 **4.3.29 证券从业人员买卖股票的情况**

1.15 **4.3.30 证券从业人员买卖股票的情况**

1.16 **4.3.31 证券从业人员买卖股票的情况**

1.17 **4.3.32 证券从业人员买卖股票的情况**

1.18 **4.3.33 证券从业人员买卖股票的情况**

1.19 **4.3.34 证券从业人员买卖股票的情况**

1.20 **4.3.35 证券从业人员买卖股票的情况**

1.21 **4.3.36 证券从业人员买卖股票的情况**

1.22 **4.3.37 证券从业人员买卖股票的情况**

1.23 **4.3.38 证券从业人员买卖股票的情况**

1.24 **4.3.39 证券从业人员买卖股票的情况**

1.25 **4.3.40 证券从业人员买卖股票的情况**

1.26 **4.3.41 证券从业人员买卖股票的情况**

1.27 **4.3.42 证券从业人员买卖股票的情况**

1.28 **4.3.43 证券从业人员买卖股票的情况**

1.29 **4.3.44 证券从业人员买卖股票的情况**

1.30 **4.3.45 证券从业人员买卖股票的情况**

1.31 **4.3.46 证券从业人员买卖股票的情况**

1.32 **4.3.47 证券从业人员买卖股票的情况**

1.33 **4.3.48 证券从业人员买卖股票的情况**

1.34 **4.3.49 证券从业人员买卖股票的情况**

1.35 **4.3.50 证券从业人员买卖股票的情况**

1.36 **4.3.51 证券从业人员买卖股票的情况**

1.37 **4.3.52 证券从业人员买卖股票的情况**

1.38 **4.3.53 证券从业人员买卖股票的情况**

1.39 **4.3.54 证券从业人员买卖股票的情况**

1.40 **4.3.55 证券从业人员买卖股票的情况**

1.41 **4.3.56 证券从业人员买卖股票的情况**

1.42 **4.3.57 证券从业人员买卖股票的情况**

1.43 **4.3.58 证券从业人员买卖股票的情况**

1.44 **4.3.59 证券从业人员买卖股票的情况**

1.45 **4.3.60 证券从业人员买卖股票的情况**

1.46 **4.3.61 证券从业人员买卖股票的情况**

1.47 **4.3.62 证券从业人员买卖股票的情况**

1.48 **4.3.63 证券从业人员买卖股票的情况**

1.49 **4.3.64 证券从业人员买卖股票的情况**

1.50 **4.3.65 证券从业人员买卖股票的情况**

1.51 **4.3.66 证券从业人员买卖股票的情况**

1.52 **4.3.67 证券从业人员买卖股票的情况**