

上投摩根轮动添利债券型证券投资基金

[2014] 第二季度报告

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:二〇一四年七月二十一日

§ 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:中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月18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。

本报告中对财务数据未经审计。

本报告期末2014年4月1日起至6月30日止。

§ 2基金产品概况

基金简称	上投摩根轮动添利债券
基金主代码	370025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年2月14日
报告期末基金份额总额	308,251,456.29份
投资目标	在有效控制风险和保持资产流动性前提下，通过积极主动的资产配置，追求货币市场的收益提升。本基金将保持较高债券仓位，优化了组合中用债的持仓结构。
投资策略	基金经理在充分考虑宏观经济、行业景气度、资金面、利率水平、信用利差、信用评级、信用风险、信用期限、信用品种等多方面因素的基础上，综合分析各券种的性价比，择优选择买入或卖出操作。
业绩比较基准	中信债基指数
风险收益特征	本基金为债券基金，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均低于货币市场基金、混合型基金和股票型基金。
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
下属两级基金的基金简称	上投摩根轮动添利债券A类
下属两级基金的交易代码	370025 370026
报告期末下级基金的份额总额	147,933,258.23份 160,316,198.06份

§ 3主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标		报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)	
上投摩根轮动添利债券A类		上投摩根轮动添利债券C类	
1.本期已实现收益		-149,161.34 -333,540.41	
2.本期利润		3,072,101.88 3,165,403.83	
3.加权平均基金份额本期利润		0.0190 0.0179	
4.期末基金资产净值		141,605,374.31 152,519,398.51	
5.期末基金份额净值		0.997 0.995	
6.期末可供分配基金份额利润		2,773,084.59 0.55	
7.其他数据		9,932,767.82 1.90	
8.合计		500,070,462.64 100.00	

注:截至2014年6月30日,上投摩根轮动添利债券型证券投资基金资产净值为294,124,772.82元,上投摩根轮动添利债券A类基金份额净值为0.957元,累计基金份额净值为0.957元;上投摩根轮动添利债券C类基金份额净值为0.951元,累计基金份额净值为0.951元。

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4报告期末按债券品种类型的债券投资组合

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	44,753,104.00	15.22
2		央行票据	-	-
3		金融债券	106,314,483.26	36.15
4		企业债券	106,114,483.26	36.15
5		资产支持证券	-	-
6		贵金属	27,018,498.39	9.48
7		可转债	9,992,000.00	3.38
8		权证	33,923,234.64	11.55
9		其他	-	-
10		合计	472,020,610.23	160.48

注:截至2014年6月30日,上投摩根轮动添利债券型证券投资基金资产净值为294,124,772.82元,上投摩根轮动添利债券A类基金份额净值为0.957元,累计基金份额净值为0.957元;上投摩根轮动添利债券C类基金份额净值为0.951元,累计基金份额净值为0.951元。

5.2.1报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3.1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

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.4.1报告期未有债券投资的说明

5.4.2报告期未有债券投资的说明

5.4.3报告期未有债券投资的说明

5.4.4报告期未有债券投资的说明

5.4.5报告期未有债券投资的说明

5.4.6报告期未有债券投资的说明

5.4.7报告期未有债券投资的说明

5.4.8报告期未有债券投资的说明

5.4.9报告期未有债券投资的说明

5.4.10报告期未有债券投资的说明

5.4.11报告期未有债券投资的说明

5.4.12报告期未有债券投资的说明

5.4.13报告期未有债券投资的说明

5.4.14报告期未有债券投资的说明

5.4.15报告期未有债券投资的说明

5.4.16报告期未有债券投资的说明

5.4.17报告期未有债券投资的说明

5.4.18报告期未有债券投资的说明

5.4.19报告期未有债券投资的说明

5.4.20报告期未有债券投资的说明

5.4.21报告期未有债券投资的说明

5.4.22报告期未有债券投资的说明

5.4.23报告期未有债券投资的说明

5.4.24报告期未有债券投资的说明

5.4.25报告期未有债券投资的说明

5.4.26报告期未有债券投资的说明

5.4.27报告期未有债券投资的说明

5.4.28报告期未有债券投资的说明

5.4.29报告期未有债券投资的说明

5.4.30报告期未有债券投资的说明

5.4.31报告期未有债券投资的说明

5.4.32报告期未有债券投资的说明

5.4.33报告期未有债券投资的说明

5.4.34报告期未有债券投资的说明

5.4.35报告期未有债券投资的说明

5.4.36报告期未有债券投资的说明

5.4.37报告期未有债券投资的说明

5.4.38报告期未有债券投资的说明

5.4.39报告期未有债券投资的说明

5.4.40报告期未有债券投资的说明

5.4.41报告期未有债券投资的说明

5.4.42报告期未有债券投资的说明

5.4.43报告期未有债券投资的说明

5.4.44报告期未有债券投资的说明

5.4.45报告期未有债券投资的说明

5.4.46报告期未有债券投资的说明

5.4.47报告期未有债券投资的说明

5.4.48报告期未有债券投资的说明

5.4.49报告期未有债券投资的说明

5.4.50报告期未有债券投资的说明

5.4.51报告期未有债券投资的说明

5.4.52报告期未有债券投资的说明

5.4.53报告期未有债券投资的说明

5.4.54报告期未有债券投资的说明

5.4.55报告期未有债券投资的说明

5.4.56报告期未有债券投资的说明

5.4.57报告期未有债券投资的说明

5.4.58报告期未有债券投资的说明

5.4.59报告期未有债券投资的说明

5.4.60报告期未有债券投资的说明

5.4.61报告期未有债券投资的说明

5.4.62报告期未有债券投资的说明

5.4.63报告期未有债券投资的说明

5.4.64报告期未有债券投资的说明

5.4.65报告期未有债券投资的说明

5.4.66报告期未有债券投资的说明

5.4.67报告期未有债券投资的说明

5.4.68报告期未有债券投资的说明

5.4.69报告期未有债券投资的说明

5.4.70报告期未有债券投资的说明

5.4.71报告期未有债券投资的说明

5.4.72报告期未有债券投资的说明

5.4.73报告期未有债券投资的说明

5.4.74报告期未有债券投资的说明

5.4.75报告期未有债券投资的说明

5.4.76报告期未有债券投资的说明

5.4.77报告期未有债券投资的说明

5.4.78报告期未有债券投资的说明

5.4.79报告期未有债券投资的说明

5.4.80报告期未有债券投资的说明

5.4.81报告期未有债券投资的说明

5.4.82报告期未有债券投资的说明

5.4.83报告期未有债券投资的说明

5.4.84报告期未有债券投资的说明

5.4.85报告期未有债券投资的说明

5.4.86报告期未有债券投资的说明

5.4.87报告期未有债券投资的说明

5.4.88报告期未有债券投资的说明

5.4.89报告期未有债券投资的说明