

上投摩根纯债债券型证券投资基金

2014 半年度报告摘要

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:二〇一四年八月二十六日

1.重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构均不存在虚假记载、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法律责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014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预示其未来表现。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。
本报告自2014年1月1日起至6月30日止。

Table with 2 columns: 2.1 基金基本情况, 2.2 基金产品说明. Includes fund name, type, and objectives.

Table with 2 columns: 2.3 基金管理人及基金托管人. Lists management and custody details.

Table with 2 columns: 2.4 信息披露方式. Provides contact information for fund information.

Table with 2 columns: 3. 主要会计数据和财务指标. Summarizes key financial metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标. Detailed financial data for the period.

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。

注: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。

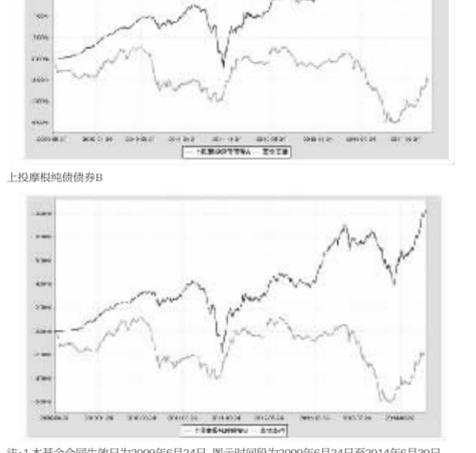
Table with 2 columns: 3.2.1 基金业绩比较基准. Lists performance benchmarks for the fund.

Table with 2 columns: 3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较. Compares fund performance to benchmarks.

注:1.本基金合同生效日为2009年6月24日,图示时间为2009年6月24日至2014年6月30日。
注:2.本基金建仓期自2009年6月24日至2009年12月23日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同约定。

Table with 2 columns: 4 管理人报告. Overview of the management report.

4.1 基金管理人及基金情况
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券监督管理委员会批准,于2004年1月12日正式成立。



注:1.本基金合同生效日为2009年6月24日,图示时间为2009年6月24日至2014年6月30日。
注:2.本基金建仓期自2009年6月24日至2009年12月23日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同约定。

4.1.2 基金管理人及基金情况
4.1.3 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券监督管理委员会批准,于2004年1月12日正式成立。

Table with 2 columns: 4.1.3 基金管理人及其管理基金的经验. Details about the fund manager's experience.

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.王亚明先生为本基金首任基金经理,其任职日期同本基金合同生效之日。
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。

4.3 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金严格执行《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。

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、交易方向的抽样分析,未发现存在异常交易行为。

4.4 管理人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
上半年,宏观经济增速下滑明显,房地产市场和销售下滑对经济影响较大。

4.4.2 报告期内基金的投资组合报告
本基金本报告期末资产配置比例为:股票0.00%,债券99.99%。

4.4.3 报告期内基金业绩比较基准执行情况
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.4 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.5 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.6 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.7 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.8 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.9 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.10 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.11 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.12 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.13 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.14 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.15 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.16 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.17 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.18 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.19 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.20 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.21 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.22 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.23 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.24 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.25 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.26 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.27 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.28 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.29 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.30 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.31 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.32 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.33 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.34 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.35 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.36 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.37 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.38 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.39 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.40 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

4.4.41 报告期内基金业绩比较基准与业绩表现比较
本基金本报告期业绩比较基准为:中国债券总指数。

会计主体:上投摩根纯债债券型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元
一、期初所有者权益(基金净值)
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益)
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)

四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)
五、期末所有者权益(基金净值)

7.1 期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

注:截至2014年6月30日,上投摩根纯债债券型证券投资基金资产净值为51,045,700.54元,上投摩根纯债基金A类份额净值为1,124元,累计基金份额净值为1,124元;上投摩根纯债基金B类份额净值为1,100元,累计基金份额净值为1,100元。

7.2 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。

7.3 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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

“买入金额”(或“买入股票成本”)、“卖出金额”(或“卖出股票收入”)均按买卖成交金额(成交单)乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:“买入金额”(或“买入股票成本”)、“卖出金额”(或“卖出股票收入”)均按买卖成交金额(成交单)乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:“买入金额”(或“买入股票成本”)、“卖出金额”(或“卖出股票收入”)均按买卖成交金额(成交单)乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:“买入金额”(或“买入股票成本”)、“卖出金额”(或“卖出股票收入”)均按买卖成交金额(成交单)乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.6 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

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:“买入金额”(或“买入股票成本”)、“卖出金额”(或“卖出股票收入”)均按买卖成交金额(成交单)乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.7 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。

7.8 期末未按时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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注
7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

8.1 期末基金资产净值及基金份额持有人结构

Table with 4 columns: 份额类别, 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 持有基金份额, 持有基金份额占基金份额总额的比例

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with 2 columns: 项目, 持有基金份额(份), 占基金资产净值比例

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金总量区间的情况

Table with 2 columns: 项目, 持有基金份额总量的数量区间(万份)

9 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目, 基金份额

10 基金重大事件揭示
10.1 基金份额持有人大会决议
报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
基金管理人:
本公司于2014年4月9日发布公告:因工作需要,胡志强先生自2014年4月3日起不再担任本公司副总经理。

基金托管人:
本公司因中国工商银行股份有限公司(以下简称“本行”)工作需要,周月秋同志不再担任本行资产管理部总经理,在新任资产管理部总经理李明同志完成接管证券投资基金高级管理岗位职责前,由副总经理王立波同志代为行使本行资产管理部总经理部分业务授权职责。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变
报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内变更会计师事务所的情况
报告期内,本基金未发生变更为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况
报告期内,管理人、托管人未受稽查或处罚,亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的情况
10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资和债券支付情况

Table with 4 columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期股票成交金额的比例