

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:二〇一四年八月六日

1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事、董事会秘书保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏,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。本半年度报告已经二〇一四年八月五日经基金管理人和基金托管人书面确认。
基金管理人在中国建设银行股份有限公司基金托管合同约定,于二〇一四年八月五日复核了报告中的财务数据、净值表现、利润分配政策、风险提示、投资组合报告等信息,保证报告不存在虚假记载、误导陈述或者重大遗漏。
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报告。
本半年度报告摘要自半年度报告正文、投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告在半年度财务数据未经审计。
本报告自二〇一四年八月一日起至六月三十日止。

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
场内简称	
基金代码	372110
交易费用	372110
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月1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
报告期末基金资产总额	96,296,269.48元
基金的定期报告	不定期
下属基金的基金简称	上投摩根强化回报债券A类
下属基金的交易代码	372110
报告期末下属基金的份额总额	74,603,888.73份
2.2 基金产品说明	21,023,807.95份

投资目标	本基金在严格控制和维持资产高流动性的基础上,通过主动管理,力争超越指数,获得超越行业平均水平的回报。
本基金采用积极主动的债券投资策略,以长期利率分析为核心,结合宏观经济形势、利率走势、信用利差、债券品种的流动性、信用风险、税利差等指标,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。	本基金通过分析宏观经济形势,在充分考虑利率、信用利差、税利差等指标的基础上,精选具有较好流动性的债券品种,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。
业绩基准	业绩基准:中债综合指数
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,低于股票型基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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	中国建设银行股份有限公司
姓名	周炯	田青
信息披露负责人	021-38749888	010-57950906
联系电话	service@cmf.com	tanqiang@ccb.com
电子邮箱		
客户服务电话	400-889-4888	010-57950906
传真	021-20628400	010-66275883

2.4 信息披露方式

报告基金半年度报告正文的管理人互联网址	http://www.cmf.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

金额单位:人民币元	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)
1.1 期间数据和指标	上投摩根强化回报债券型证券投资基金	上投摩根强化回报债券型证券投资基金
本期实现收益	-1,830,314.46	-455,477.54
本期利润	1,138,011.08	342,196.28
加权平均基金份额本期利润	0.0129	0.0144
本期基金份额净值增长率	1.87%	1.79%
报告期末(2014年6月30日)		
期末可供分配基金份额利润	0.0330	0.0204
期末基金份额净值	77,247,338.70	22,094,497.71
期末基金份额净值	1.035	1.023

注:本期已实现收益减去基金本期利息收入、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,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润在本期变动数的孰低数。

2.上述基金的报酬率不包括货币市场基金的费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金管理费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数据。
--

3.21基金份额净值增长率及其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 标准差(%)	业绩比较基准 收益率(%)	业绩比较基准 收益率差(%)	①-③	②-④
过去一个月	1.17%	0.22%	0.08%	0.04%	0.37%
过去二个月	4.33%	0.23%	2.41%	0.04%	1.92%
过去三个月	1.87%	0.24%	3.87%	0.05%	-2.00%
过去一年	-2.36%	0.22%	3.02%	0.05%	-5.38%
成立以来	7.57%	0.26%	12.88%	0.05%	-5.31%
注:基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。					0.21%

上投摩根强化回报债券B类

阶段	份额净值增长率 标准差(%)	业绩比较基准 收益率(%)	业绩比较基准 收益率差(%)	①-③	②-④
过去一个月	1.17%	0.22%	0.08%	0.04%	0.37%
过去二个月	4.33%	0.23%	2.41%	0.04%	1.92%
过去三个月	1.87%	0.24%	3.87%	0.05%	-2.00%
过去一年	-2.36%	0.22%	3.02%	0.05%	-5.38%
成立以来	7.57%	0.26%	12.88%	0.05%	-5.31%
注:基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。					0.21%

3.22自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率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

份额累计净值增长率及其同期业绩比较基准收益率历史走势图对比如图

(2011年8月10日至2014年6月30日)

6.2 利润率

会计主体:上投摩根强化回报债券型证券投资基金

报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

单位:人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
1.收入		3,044,037.51	4,091,130.74
1.1 利息收入		3,277,154.77	3,029,312.48
其中:存款利息收入	6.4.7.1.1	34,734.76	49,454.69
债券利息收入	6.4.7.1.2	2,933,370.78	2,891,012.97
资产支持证券利息收入		-	-
其他利息收入	6.4.7.1.3	309,493.53	88,844.82
2.费用		4,008,253.47	3,600,919.33
2.1 职工薪酬		6,717,144.64	4,968,022.41
2.2 会议费		16,380.22	26,386.46
2.3 咨询费		7,299.14	4,966.53
2.4 交易费用	6.4.7.7	40,301.72	61,275.14
2.5 其他费用		358,357.26	333,635.23
3.利润		18,408.17	32,076.88
4.溢利		-	-
5.股利及分红		-	-
6.其他收入	6.4.7.8	133,036.14	300,036.63
7.费用合计		47,091,163.17	51,129,046.63
8.所有者权益变动		-	-
9.所有者权益		-	-
10.基金净值	6.4.7.9	96,206,269.48	105,758,563.34
11.分配利润	6.4.7.10	3,135,599.93	2,088,793.93
12.所有者权益变动		99,341	