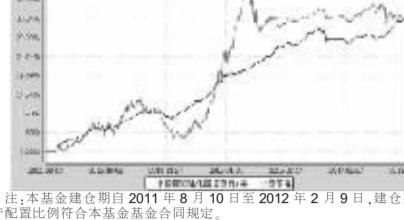


# 上投摩根强化回报债券型证券投资基金

## 2018年第二季度报告

(2011年8月10日至2018年6月30日)

## 1. 上投摩根强化回报债券 A类:



注: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基金合同规定。

本基金合同生效日为2011年8月10日,图示时间段为2011年8月10日至2018年6月30日。

本基金自2015年10月10日起,将基金业绩比较基准由“中信标普债基指数”变更为“中证综合债券指数收益率”。

## 2. 上投摩根强化回报债券 B类:



注: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基金合同规定。

本基金合同生效日为2011年8月10日,图示时间段为2011年8月10日至2018年6月30日。

本基金自2015年10月10日起,将基金业绩比较基准由“中信标普债基指数”变更为“中证综合债券指数收益率”。

## 3. 主要财务指标

单位:人民币元

报告期:2018年4月1日至2018年6月30日

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.本期已实现收益 -1,610.70 -3,642.63

2.本期利润 -21,509.55 -16,233.77

3.加权平均基金份额利润 -0.0052 -0.0052

4.期末基金资产净值 4,936,147.44 3,904,311.46

5.期末基金份额净值 1.280 1.248

注: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。

基金净值增长率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、红利再投费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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

1.阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%)

过去一个月 -0.39% 0.23% 1.19% 0.09% -2.36% 0.14%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

上投摩根强化回报债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

注:本基金合同生效日为2011年8月10日,图示时间段为2011年8月10日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2007年4月13日至2007年10月12日。建仓期结束时资产配置比例符合基金合同规定。

4.1 基金经理(基金经理助理)简介

上投摩根基金管理有限公司

姓名:刘阳 职务:基金经理

任本基金的基金经理期间:2016-12-16 至 2018-6-30

说明:美国葛士顿博士,2008年2月至2010年4月任上投摩根基金管理有限公司研究员,2010年5月起任上投摩根基金经理助理,2012年1月起任上投摩根基金管理有限公司基金经理,2013年1月起任上投摩根基金管理有限公司基金经理,2014年1月起任上投摩根基金管理有限公司基金经理,2015年1月起任上投摩根基金管理有限公司基金经理,2016年1月起任上投摩根基金管理有限公司基金经理,2017年1月起任上投摩根基金管理有限公司基金经理,2018年1月起任上投摩根基金管理有限公司基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,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,遵守基金合同,履行基金职责。

4.3 报告期内基金业绩表现

本基金报告期份额净值增长率为-1.6107%,业绩比较基准收益率为-3.6426%。

注:本基金报告期份额净值增长率为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。

基金净值增长率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、红利再投费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列示。

3.3 主要财务指标

3.3.1 本基金报告期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型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

注:本基金合同生效日为2007年4月13日,图示时间段为2007年4月13日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2007年4月13日至2007年10月12日。建仓期结束时资产配置比例符合基金合同规定。

4.4 管理人对报告期内基金的业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金的业绩表现和运作分析

本基金报告期份额净值增长率为-1.6107%,业绩比较基准收益率为-3.6426%。

本基金报告期份额净值增长率为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。

基金净值增长率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、红利再投费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列示。

3.4 主要财务指标

3.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理办法》公平交易制度指

3.5 其他费用

注:本基金报告期未发生重大关联交易。

3.6 基金净值表现

3.6.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根内需动力混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

注:本基金合同生效日为2007年4月13日,图示时间段为2007年4月13日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2007年4月13日至2007年10月12日。建仓期结束时资产配置比例符合基金合同规定。

4.5 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,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,遵守基金合同,履行基金职责。

4.6 报告期内基金业绩表现

本基金报告期份额净值增长率为-1.6107%,业绩比较基准收益率为-3.6426%。

本基金报告期份额净值增长率为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。

基金净值增长率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、红利再投费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列示。

3.7 主要财务指标

3.7.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根内需动力混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

注:本基金合同生效日为2007年4月13日,图示时间段为2007年4月13日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2007年4月13日至2007年10月12日。建仓期结束时资产配置比例符合基金合同规定。

4.7 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,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,遵守基金合同,履行基金职责。

4.8 报告期内基金业绩表现

本基金报告期份额净值增长率为-1.6107%,业绩比较基准收益率为-3.6426%。

本基金报告期份额净值增长率为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。

基金净值增长率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、红利再投费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列示。

3.8 主要财务指标

3.8.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根民生需求股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

注:本基金合同生效日为2014年3月14日,图示时间段为2014年3月14日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2014年3月14日至2014年9月12日,建仓期结束时资产配置比例符合基金合同规定。

4.9 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期未发生重大关联交易。

4.10 报告期内基金业绩表现

本基金报告期份额净值增长率为-1.6107%,业绩比较基准收益率为-3.6426%。

本基金报告期份额净值增长率为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。

基金净值增长率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、红利再投费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列示。

3.9 主要财务指标

3.9.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根民生需求股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

注:本基金合同生效日为2014年3月14日,图示时间段为2014年3月14日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2014年3月14日至2014年9月12日,建仓期结束时资产配置比例符合基金合同规定。

4.11 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期未发生重大关联交易。

4.12 报告期内基金业绩表现

本基金报告期份额净值增长率为-1.6107%,业绩比较基准收益率为-3.6426%。

本基金报告期份额净值增长率为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。

基金净值增长率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、红利再投费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列示。

3.10 主要财务指标

3.10.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根民生需求股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

注:本基金合同生效日为2014年3月14日,图示时间段为2014年3月14日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2014年3月14日至2014年9月12日,建仓期结束时资产配置比例符合基金合同规定。

4.13 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期未发生重大关联交易。

4.14 报告期内基金业绩表现

本基金报告期份额净值增长率为-1.6107%,业绩比较基准收益率为-3.6426%。

本基金报告期份额净值增长率为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。

基金净值增长率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、红利再投费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列示。

3.11 主要财务指标

3.11.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根民生需求股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

注:本基金合同生效日为2014年3月14日,图示时间段为2014年3月14日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2014年3月14日至2014年9月12日,建仓期结束时资产配置比例符合基金合同规定。

4.15 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期未发生重大关联交易。

4.16 报告期内基金业绩表现

本基金报告期份额净值增长率为-1.6107%,业绩比较基准收益率为-3.6426%。

本基金报告期份额净值增长率为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。

基金净值增长率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、红利再投费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列示。

3.12 主要财务指标

3.12.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根民生需求股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

注:本基金合同生效日为2014年3月14日,图示时间段为2014年3月14日至2018年6月30日。

本基金建仓期自2014年3月14日至2014年9月12日,建仓期结束时资产配置比例符合基金合同规定。

4.17 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明&lt;/