

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年一月十二日
§ 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月21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,保证复核结果不存在虚假记载、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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告书财务资料未经审计。

本报告书自2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	上投摩根分红添利债券A类
基金代码	370021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月10日
报告期末基金单位净值	57.047, 2026.26
投资目标	在有效控制投资组合资产流动性的前提下,通过积极主动的资产管 理,力争为投资者创造稳定的长期回报。
本基金投资于上证50指数基金,结合不同行业、不同风格的股票进 行配置,同时通过配置债券类资产,降低组合的波动率,实现资产的保 值增值。	
投资策略	本基金自2015年10月10日起,其基金业绩比较基准由“中信标普 全债指数”变更为“中证综合债券指数收益率”。
业绩比较基准	中证综合债券指数
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 险和预期收益低于股票型基金,高于货币市场基金。本基金为定期开 放型基金,适合风险承受能力较低的个人投资者。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金名称	上投摩根分红添利债券A类
下属分级基金的交易代码	370021
报告期末下属分级基金的净值	30,079,544.01
30,079,544.01	0.002
报告期末下属分级基金的份额	10,657,658.34

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年10月1日-2018年12月31日)		
	上投摩根分红添利债券A类	上投摩根分红添利债券B类	上投摩根分红添利债券C类
1.本期实现收益	200,326.76	120,401.76	36,346.27
2.本期可供分配利润	321,012.15	100,000.00	6,000.00
3.期末可供分配利润	33,796,661.77	20,316,715.00	1,600.00
4.期末基金资产净值	1,600.00	—	—
5.期末基金份额净值	1,600.00	—	—
6.期末可供分配基金份额利润	0.002%	0.002%	0.002%
7.过去三个月	0.03%	0.00%	0.00%
8.本期基金份额净值增长率	2.31%	2.07%	0.05%
9.本期基金份额净值增长率标准差	2.50%	0.06%	—0.26%
10.本期年化波动率	0.07%	0.05%	0.02%

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。

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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、上投摩根分红添利债券A类:

2、上投摩根分红添利债券B类:

3.2.2 本报告期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

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。

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。

3.2.3 基金净值表现

3.2.3.1 本报告期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、上投摩根丰瑞债券A类:

2、上投摩根丰瑞债券C类:

3.2.3.2 本报告期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

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。

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。

3.2.4 基金净值表现

3.2.4.1 本报告期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、上投摩根丰瑞债券A类:

2、上投摩根丰瑞债券C类:

3.2.4.2 本报告期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

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。

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。

3.2.5 基金净值表现

3.2.5.1 本报告期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、上投摩根丰瑞债券A类:

2、上投摩根丰瑞债券C类:

3.2.5.2 本报告期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

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。

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。

3.2.6 基金净值表现

3.2.6.1 本报告期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、上投摩根丰瑞债券A类:

2、上投摩根丰瑞债券C类:

3.2.6.2 本报告期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

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。

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。

3.2.7 基金净值表现

3.2.7.1 本报告期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、上投摩根丰瑞债券A类:

2、上投摩根丰瑞债券C类:

3.2.7.2 本报告期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

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。

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。

3.2.8 基金净值表现

3.2.8.1 本报告期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、上投摩根丰瑞债券A类:

2、上投摩根丰瑞债券C类:

3.2.8.2 本报告期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

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。

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。

3.2.9 基金净值表现

3.2.9.1 本报告期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、上投摩根丰瑞债券A类:

2、上投摩根丰瑞债券C类:

3.2.9.2 本报告期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

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。

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。

3.2.10 基金净值表现

3.2.10.1 本报告期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、上投摩根丰瑞债券A类:

2、上投摩根丰瑞债券C类:

3.2.10.2 本报告期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

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。

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。

3.2.11 基金净值表现

3.2.11.1 本报告期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、上投摩根丰瑞债券A类:

2、上投摩根丰瑞债券C类:

3.2.11.2 本报告期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

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。

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。

3.2.12 基金净值表现

3.2.12.1 本报告期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、上投摩根丰瑞债券A类:

2、上投摩根丰瑞债券C类:

3.2.12.2 本报告期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

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。

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。

3.2.13 基金净值表现

3.2.13.1 本报告期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、上投摩根丰瑞债券A类:

2、上投摩根丰瑞债券C类:

3.2.13.2 本报告期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

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。

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。

3.2.14 基金净值表现

3.2.14.1 本报告期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、上投摩根丰瑞债券A类:

2、上投摩根丰瑞债券C类:

3.2.14.2 本报告期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

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。

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