

## 上投摩根强化回报债券型证券投资基金

## [2012] 第四季度报告

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:二〇一三年一月二十二日

## § 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2013年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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代表未来的业绩表现，基金管理人此前管理的其他基金的过往业绩并不代表本基金的业绩。

基金管理人提醒投资者注意基金投资风险，并提示基金投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中基金财务资料未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金名称 上投摩根强化回报债券型基金  
基金简称 上投摩根强化回报债券  
基金主代码 372010  
基金运作方式 约定开放式  
基金合同生效日 2011年8月10日  
报告期末基金份额总额 130,476,052.997

投资目标 本基金主要投资于全球范围内从事自然资源的勘探、开发、生产及销售，或是向天然资源行业提供服务的公司的股票，通过积极主动的资产配置和组合管理，在风险可控的前提下以获取长期资产增值。

投资策略 本基金主要投资于全球范围内从事自然资源的勘探、开发、生产及销售，或是向天然资源行业提供服务的公司的股票，通过积极主动的资产配置和组合管理，在风险可控的前提下以获取长期资产增值。

业绩比较基准 汇丰银行人民币资产指数(100%)

本基金通过投资于全球范围内从事自然资源的勘探、开发、生产及销售，或是向天然资源行业提供服务的公司的股票，通过积极主动的资产配置和组合管理，在风险可控的前提下以获取长期资产增值。

风险收益特征 本基金的基金资产投资于股票的比例不低于基金资产的80%，投资于债券的比例不低于基金资产的20%。

基金的过往业绩并不代表未来的业绩表现，基金管理人此前管理的其他基金的过往业绩并不代表本基金的业绩。

基金管理人提醒投资者注意基金投资风险，并提示基金投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中基金财务资料未经审计。

§ 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(2012年10月1日-2012年12月31日) 上投摩根强化回报债券B类

1.本期已实现收益 1,315,541.17 908,247.44

2.本期利润 1,131,539.13 845,470.17

3.平均基金份额本期利润 0.0152 0.0141

7.29,193.737 32 51,391,200.33

5.期初基金份额净值 1.027 1.020

注:1.本产品已实现收益基金本期和收入、投资收益、其他收入、不含公允价值变动收益和利息相关费用的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期未实现的公允价值收益。例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投金额、申购金额、赎回金额等。

2.基金本期份额净值不包括持有人认购或交易基金的各项费用，不能低于所列数字。

3.2.1 本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

3.1.上投摩根强化回报债券A类:

阶段 净值增长率(①) 净值增长率(②) 业绩比较基准收益率差(③) 业绩比较基准收益率差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.47% 0.32% 1.02% 0.02% 0.45% 0.30%

2.上投摩根强化回报债券B类:

阶段 净值增长率(①) 净值增长率(②) 业绩比较基准收益率差(③) 业绩比较基准收益率差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.28% 0.30% 1.02% 0.02% 0.26% 0.30%

3.2.2 基金合同生效以来以基金份额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基金  
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比如图

(2011年8月10日至2012年12月31日)

1.上投摩根强化回报债券A类:

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3月9日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金  
合同规定。

本基金合同生效日为2011年8月10日，示图时段为2011年8月10日至2012年12月31日。

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3月9日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金  
合同规定。

本基金合同生效日为2011年8月10日，示图时段为2011年8月10日至2012年12月31日。

3.上投摩根强化回报债券A类:

4.1 基金经理或基金经理小组简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

杨成 本基金基金经理 2011-8-10 - 6年 上海财经大学财务管理硕士研究生，2000年至2010年在中投公司投资管理有限公司担任分析员及项目经理，2010年加入上投摩根基金管理有限公司担任基金经理，主要负责定期报告及组合管理报告的撰写。

赵峰 本基金基金经理 2011-9-8 - 10年 上海财经大学金融学硕士，2003年至2005年5月期间在中投公司投资管理有限公司担任分析员及项目经理，2005年至2006年在中投公司投资管理有限公司担任投资经理助理及债券基金经理的工作，2006年6月加入上投摩根基金管理有限公司担任基金经理，2012年6月起任上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金基金经理，2013年6月任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理。

注:1.在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.杨成先生为本基金基金经理，其任职日期即指基金合同生效之日。  
3.杨成先生因个人原因辞职，由赵峰先生接任，赵峰先生具备基金经理任职资格，其任职日期即指基金合同生效之日。  
4.2.2 本报告期内基金经理变动情况说明

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取利益。基金管理人遵守了《基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、《上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金合同》的约定。基金经理对一般性和投资组合的比例限制了投资策略委员会的授权限制，基金经理对投资组合的资产配置和组合管理的授权均得到公司对等的授权。

4.3.1 平等交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格执行《证券投资基金公平交易制度指导意见》等有关法律法规及公司内部公平交易制度的各项要求，对不同账户（包括但不限于公司固有资金、公司固有资金与客户资金、公司固有资金与公司固有资金之间、公司固有资金与公司固有资金与客户资金之间）之间公平交易。

报告期内，通过对于不同投资组合之间的收益率差进行对比，对同向交易和反向交易的交易时机和交易价格差监控，发现基金经理未发现存在异常交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

所有投资组合除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，参与的交易所公开竞价同日反向交易较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

注:1.在报告期中基金经理变动情况说明中，基金经理变动情况在“基金经理变动情况”部分。

2.杨成先生因个人原因辞职，由赵峰先生接任，赵峰先生具备基金经理任职资格，其任职日期即指基金合同生效之日。

3.赵峰先生因个人原因辞职，由王鹏先生接任，王鹏先生具备基金经理任职资格，其任职日期即指基金合同生效之日。

4.2.3 本报告期内基金经理变动情况说明

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取利益。基金管理人遵守了《基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、《上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金合同》的约定。基金经理对一般性和投资组合的比例限制了投资策略委员会的授权限制，基金经理对投资组合的资产配置和组合管理的授权均得到公司对等的授权。

对于二级市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买入同一证券时，按照所持股票的平均市值比例、优先级和风险等级的原则进行投资。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差进行对比，对同向交易和反向交易的交易时机和交易价格差监控，发现基金经理未发现存在异常交易行为。

4.3.3 投资组合的公平交易行为的专项说明

所有投资组合除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，参与的交易所公开竞价同日反向交易较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

注:1.在报告期中基金经理变动情况说明中，基金经理变动情况在“基金经理变动情况”部分。

2.杨成先生因个人原因辞职，由赵峰先生接任，赵峰先生具备基金经理任职资格，其任职日期即指基金合同生效之日。

3.赵峰先生因个人原因辞职，由王鹏先生接任，王鹏先生具备基金经理任职资格，其任职日期即指基金合同生效之日。

4.2.4 本报告期内基金经理变动情况说明

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取利益。基金管理人遵守了《基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、《上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金合同》的约定。基金经理对一般性和投资组合的比例限制了投资策略委员会的授权限制，基金经理对投资组合的资产配置和组合管理的授权均得到公司对等的授权。

对于二级市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买入同一证券时，按照所持股票的平均市值比例、优先级和风险等级的原则进行投资。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差进行对比，对同向交易和反向交易的交易时机和交易价格差监控，发现基金经理未发现存在异常交易行为。

4.3.4 投资组合的公平交易行为的专项说明

所有投资组合除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，参与的交易所公开竞价同日反向交易较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

注:1.在报告期中基金经理变动情况说明中，基金经理变动情况在“基金经理变动情况”部分。

2.杨成先生因个人原因辞职，由赵峰先生接任，赵峰先生具备基金经理任职资格，其任职日期即指基金合同生效之日。

3.赵峰先生因个人原因辞职，由王鹏先生接任，王鹏先生具备基金经理任职资格，其任职日期即指基金合同生效之日。

4.2.5 本报告期内基金经理变动情况说明

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取利益。基金管理人遵守了《基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、《上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金合同》的约定。基金经理对一般性和投资组合的比例限制了投资策略委员会的授权限制，基金经理对投资组合的资产配置和组合管理的授权均得到公司对等的授权。

对于二级市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买入同一证券时，按照所持股票的平均市值比例、优先级和风险等级的原则进行投资。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差进行对比，对同向交易和反向交易的交易时机和交易价格差监控，发现基金经理未发现存在异常交易行为。

4.3.5 投资组合的公平交易行为的专项说明

所有投资组合除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，参与的交易所公开竞价同日反向交易较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

注:1.在报告期中基金经理变动情况说明中，基金经理变动情况在“基金经理变动情况”部分。

2.杨成先生因个人原因辞职，由赵峰先生接任，赵峰先生具备基金经理任职资格，其任职日期即指基金合同生效之日。

3.赵峰先生因个人原因辞职，由王鹏先生接任，王鹏先生具备基金经理任职资格，其任职日期即指基金合同生效之日。

4.2.6 本报告期内基金经理变动情况说明

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取利益。基金管理人遵守了《基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、《上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金合同》的约定。基金经理对一般性和投资组合的比例限制了投资策略委员会的授权限制，基金经理对投资组合的资产配置和组合管理的授权均得到公司对等的授权。

对于二级市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买入同一证券时，按照所持股票的平均市值比例、优先级和风险等级的原则进行投资。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差进行对比，对同向交易和反向交易的交易时机和交易价格差监控，发现基金经理未发现存在异常交易行为。

4.3.7 投资组合的公平交易行为的专项说明

所有投资组合除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，参与的交易所公开竞价同日反向交易较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

注:1.在报告期中基金经理变动情况说明中，基金经理变动情况在“基金经理变动情况”部分。

2.杨成先生因个人原因辞职，由赵峰先生接任，赵峰先生具备基金经理任职资格，其任职日期即指基金合同生效之日。

3.赵峰先生因个人原因辞职，由王鹏先生接任，王鹏先生具备基金经理任职资格，其任职日期即指基金合同生效之日。

4.2.7 本报告期内基金经理变动情况说明

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取利益。基金管理人遵守了《基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、《上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金合同》的约定。基金经理对一般性和投资组合的比例限制了投资策略委员会的授权限制，基金经理对投资组合的资产配置和组合管理的授权均得到公司对等的授权。

对于二级市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买入同一证券时，按照所持股票的平均市值比例、优先级和风险等级的原则进行投资。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差进行对比，对同向交易和反向交易的交易时机和交易价格差监控，发现基金经理未发现存在异常交易行为。

4.3.8 投资组合的公平交易行为的专项说明

所有投资组合除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，参与的交易所公开竞价同日反向交易较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

注:1.在报告期中基金经理变动情况说明中，基金经理变动情况在“基金经理变动情况”部分。

2.杨成先生因个人原因辞职，由赵峰先生接任，赵峰先生具备基金经理任职资格，其任职日期即指基金合同生效之日。

3.赵峰先生因个人原因辞职，由王鹏先生接任，王鹏先生具备基金经理任职资格，其任职日期即指基金合同生效之日。

4.2.8 本报告期内基金经理变动情况说明

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取利益。基金管理人遵守了《基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、《上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金合同》的约定。基金经理对一般性和投资组合的比例限制了投资策略委员会的授权限制，基金经理对投资组合的资产配置和组合管理的授权均得到公司对等的授权。

对于二级市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买入同一证券时，按照所持股票的平均市值比例、优先级和风险等级的原则进行投资。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差进行对比，对同向交易和反向交易的交易时机和交易价格差监控，发现基金经理未发现存在异常交易行为。

4.3.9 投资组合的公平交易行为的专项说明

所有投资组合除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，参与的