

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：二〇一四年三月二十八日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金管理人、基金托管人、上投摩根基金管理有限公司根据本基金合同规定，于2014年3月27日将报告送达给基金持有人，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，不保证基金一定盈利。

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，不保证基金一定盈利。

基金管理人和基金托管人对本基金合同规定，于2014年3月27日将报告送达给基金持有人，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本年度报告摘要自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根分红添利债券
基金代码	370201
交易代码	370201/370202
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月25日
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期基金净值总额	203,108,321.910
下属分级基金的基金简称	上投摩根分红添利债券A类
下属分级基金的交易代码	370201
报告期基金净值总额	89,891,920.390
报告期基金单位净值总额	113,216,401.520

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人创造稳定的当期收入和长期回报。
本基金采取自下而上的逐级投资策略，通过自下而上的逐级投资方法构建债券投资组合，通过对投资资产的配置，实现稳定的投资收益。在此基础上，适当参与新股发行申购及增发新股申购，在严控风险资金运用的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金在严格遵守《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根分红添利债券型证券投资基金基金合同》的规定和基金资产的组合比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资遵循了基金管理合同规定的投资限制，同时涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，以确保本公司管理的不同的投资组合均能得到公平对待。
基金合同生效日	2012年6月25日
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期基金净值总额	203,108,321.910
下属分级基金的基金简称	上投摩根分红添利债券B类
下属分级基金的交易代码	370202
报告期基金净值总额	113,216,401.520

报告期基金单位净值总额	89,891,920.390
报告期基金单位净值总额	113,216,401.520

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	中国银行股份有限公司
地址	漕河泾开发区	漕河泾开发区
信息披露负责人	胡忠志	胡忠志
联系电话	021-38748888	95566
电子邮箱	service@cfmchina.com	cfm@bankofchina.com
客户服务电话	400-889-4888	95569
传真	021-20628400	010-66594942

2.4 信息披露方式

基金管理人和基金托管人	http://www.cfm.com
基金管理人和基金托管人	基金管理人、基金托管人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

项目	2013年		2012年6月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	本期	上投摩根分红添利债券A类	本期	上投摩根分红添利债券B类
本期已实现收益	18,282,252.80	7,084,684.70	14,271,846.48	5,570,101.93
本期利润	13,533,274.44	2,923,154.31	17,867,957.18	5,693,421.48
加权平均基金份额净值	0.0422	0.0154	0.0189	0.0122
本期期末基金份额净值	0.39%	-20%	2.00%	1.70%

3.1.2 期末数据和指标

项目	上投摩根分红添利债券A类	上投摩根分红添利债券B类
期末可供分配基金份额利润	-0.0231	-0.0245
期末基金资产净值	87,818,925.80	110,404,738.2
期末基金资产净值	538,669,261.93	200,533,605.27

注：1.本基金管理人已实现收益指基金本期已实现收入、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入加上本期公允价值变动收益，对期末可供分配利润的影响，采用期末资产的公允价值与本期利润之和已实现收益的孰低数。

2.上述基金净值指标不包括持有人认购或申购基金的费用(例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投费、基金转换费、申购赎回费等)，计算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 基金份额净值增长率为基点数与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根分红添利债券A类：

阶段	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
过去三个月	-3.08%	0.16%	1.21%	0.06%	-4.29%	0.10%
过去六个月	-2.60%	0.14%	-0.82%	0.05%	-1.78%	0.09%
过去一年	0.39%	0.14%	1.76%	0.05%	-1.39%	0.09%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起	2.40%	0.12%	3.09%	0.04%	-0.69%	0.08%

注：本基金业绩比较基准为：中信标普全债指数。

3.2.2 自基金合同生效以来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

注：1.本基金合同生效日为2012年6月25日，报告期间为2012年6月25日至2013年12月31日。

2.本基金成立初期自2012年6月25日至2012年12月24日，建仓期结束后资产配置比例符合本基金合同规定。

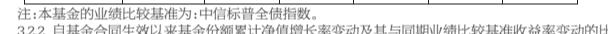
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根分红添利债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年6月25日至2013年12月31日)

上投摩根分红添利债券A类：



注：1.本基金合同生效日为2012年6月25日，报告期间为2012年6月25日至2013年12月31日。

2.本基金成立初期自2012年6月25日至2012年12月24日，建仓期结束后资产配置比例符合本基金合同规定。

上投摩根分红添利债券B类：



注：1.本基金于2012年6月25日成立，显示的期间为2012年6月25日至2013年12月31日。

2.合同期效当年按实际存续天数计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

上投摩根分红添利债券A类：

年度	每100份基金份额分红次数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013	0.480	16,059,501.45	1,737,321.20	17,778,822.65	
2012	-	-	-	-	
合计	0.480	16,059,501.45	1,737,321.20	17,778,822.65	

上投摩根分红添利债券B类：

年度	每100份基金份额分红次数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013	0.410	8,504,336.01	806,923.42	9,311,259.43	
2012	-	-	-	-	
合计	0.410	8,504,336.01	806,923.42	9,311,259.43	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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于2004年1月12日正式成立。公司由上海国际信托有限公司（2007年10月更名为“上海国际信托有限公司”）与摩根资产管理（英国）有限公司合作设立，注册资本人民币2亿元人民币，注册地址为上海市浦东新区陆家嘴环路1333