

上投摩根强化回报债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告截止日期：二〇一五年七月三十一日

基金管理人及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2015年7月17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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中所载数据截止至本报告期内最后一交易日。本基金投资组合资产配置比例，本基金投资组合资产配置比例，本基金投资组合资产配置比例，基金的投资业绩并不表示对未来业绩的保证，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。

本报告自2015年4月1日起至6月30日止。

基金简称	上投摩根强化回报债券
基金代码	372010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年10月10日
基金合同生效以来基金份额总额	26,093,474.06
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产较高流动性的基础上，通过主动管理，力争获得超越业绩比较基准的长期稳定回报，实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过对固定收益类金融工具的主动管理，力争获取稳定的债券投资收益。此外，本基金积极把握对经济周期的判断和预期（增发、回购收益率的预测、信贷等），把握市场变化，在严格控制风险的前提下，力求获得较高的长期投资回报。
业绩比较基准	中债综合全债指数
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货币市场基金，高于混合基金和股票型基金。
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
下属基金的基金简称	上投摩根强化回报债券A类
下属基金的基金代码	372010
报告期末下属基金的份额总额	15,474,538.34份

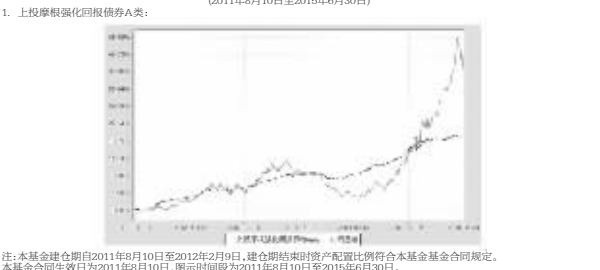
主要财务指标	4月期 (2015年4月1日-2015年6月30日)	报告期末 (2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,310,000.00	1,571,350.04
2.本期利润	762,227.78	982,949.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0762	0.0796
4.期末基金资产净值	20,826,897.79	14,746,284.22
5.期末基金份额净值	1.346	1.325

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公允价值变动收益。

上述基金业绩指标并不因持有认构成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），计入相关期间收益中而受到影响。

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	6.15%	0.65%	1.20%	0.04%	4.95%	0.61%

注：1. 上投摩根强化回报债券A类
2. 业绩比较基准：中债综合全债指数
3. 业绩比较基准：中债综合全债指数
4. 业绩比较基准：中债综合全债指数



阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	6.00%	0.64%	1.20%	0.04%	4.80%	0.60%

注：1. 上投摩根强化回报债券A类
2. 业绩比较基准：中债综合全债指数
3. 业绩比较基准：中债综合全债指数
4. 业绩比较基准：中债综合全债指数

姓名	职务	任期自	任期至	证券从业年限	说明
马强	本基金基金经理	2015-4-22		7年	2006年7月至2011年3月在华泰资产管理有限责任公司担任基金经理，2011年4月至2012年1月在中国证券基金业协会担任基金经理，2012年1月至2015年4月在上投摩根基金管理有限公司担任基金经理。2015年4月22日起担任上投摩根强化回报债券A类基金经理。
杨成	本基金基金经理	2011-08-10	2015-4-22	8年	2006年7月至2011年3月在华泰资产管理有限责任公司担任基金经理，2011年4月至2012年1月在中国证券基金业协会担任基金经理，2012年1月至2015年4月在上投摩根基金管理有限公司担任基金经理。2015年4月22日起担任上投摩根强化回报债券A类基金经理。

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
报告截止日期：二〇一五年七月三十一日

基金管理人及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2015年7月17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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中所载数据截止至本报告期内最后一交易日。本基金投资组合资产配置比例，本基金投资组合资产配置比例，本基金投资组合资产配置比例，基金的投资业绩并不表示对未来业绩的保证，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。

本报告自2015年4月1日起至6月30日止。

基金简称	上投摩根全球新兴市场股票(ODI)
基金代码	378006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月30日
基金合同生效以来基金份额总额	151,434,374.56份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产较高流动性的基础上，通过主动管理，力争获得超越业绩比较基准的长期稳定回报，实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过主动管理，力争获取稳定的股票投资收益。此外，本基金积极把握对经济周期的判断和预期（增发、回购收益率的预测、信贷等），把握市场变化，在严格控制风险的前提下，力求获得较高的长期投资回报。
业绩比较基准	中证综合全债指数
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货币市场基金，高于混合基金和股票型基金。
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
下属基金的基金简称	上投摩根全球新兴市场股票A类
下属基金的基金代码	378006
报告期末下属基金的份额总额	151,434,374.56份

主要财务指标	4月期 (2015年4月1日-2015年6月30日)	报告期末 (2015年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,263,506.14	
2.本期利润	-12,826,363.78	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0979	
4.期末基金资产净值	147,134,034.94	
5.期末基金份额净值	0.972	

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去一个阶段	-1.72%	15.7%	-0.07%	0.00%	-1.02%	0.77%

注：1. 上投摩根全球新兴市场股票A类
2. 业绩比较基准：中证综合全债指数
3. 业绩比较基准：中证综合全债指数
4. 业绩比较基准：中证综合全债指数

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去一个阶段	-1.72%	15.7%	-0.07%	0.00%	-1.02%	0.77%

注：1. 上投摩根全球新兴市场股票A类
2. 业绩比较基准：中证综合全债指数
3. 业绩比较基准：中证综合全债指数
4. 业绩比较基准：中证综合全债指数

注：本基金合同生效日为2011年1月30日，演示期间为2011年1月30日至2015年6月30日。
本基金成立于2011年1月30日，演示期间为2011年1月30日至2015年6月30日。

上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告截止日期：二〇一五年七月三十一日

基金管理人及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2015年7月17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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中所载数据截止至本报告期内最后一交易日。本基金投资组合资产配置比例，本基金投资组合资产配置比例，本基金投资组合资产配置比例，基金的投资业绩并不表示对未来业绩的保证，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。

本报告自2015年4月1日起至6月30日止。

基金简称	上投摩根全球天然资源股票(ODI)
基金代码	378546
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月26日
基金合同生效以来基金份额总额	58,761,434.57份
投资目标	本基金主要投资于全球范围内从事天然资源勘探、生产、开发及销售，或提供天然资源勘探、生产、开发及销售服务的上市公司，通过主动管理，力争获得超越业绩比较基准的长期稳定回报，实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过主动管理，力争获取稳定的股票投资收益。此外，本基金积极把握对经济周期的判断和预期（增发、回购收益率的预测、信贷等），把握市场变化，在严格控制风险的前提下，力求获得较高的长期投资回报。
业绩比较基准	中证综合全债指数
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货币市场基金，高于混合基金和股票型基金。
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
下属基金的基金简称	上投摩根全球天然资源股票A类
下属基金的基金代码	378546
报告期末下属基金的份额总额	58,761,434.57份

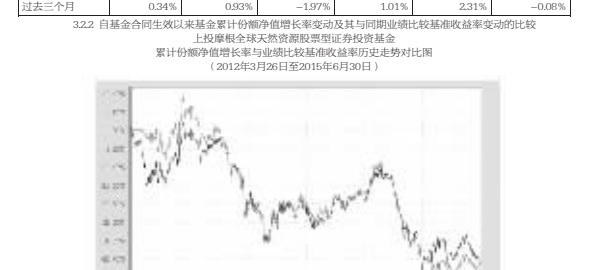
主要财务指标	4月期 (2015年4月1日-2015年6月30日)	报告期末 (2015年6月30日)
1.本期已实现收益	-460,961.47	
2.本期利润	17,365.27	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0002	
4.期末基金资产净值	34,623,132.21	
5.期末基金份额净值	0.589	

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公允价值变动收益。

上述基金业绩指标并不因持有认构成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），计入相关期间收益中而受到影响。

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	0.34%	0.03%	-1.97%	1.01%	2.31%	-0.68%

注：1. 上投摩根全球天然资源股票A类
2. 业绩比较基准：中证综合全债指数
3. 业绩比较基准：中证综合全债指数
4. 业绩比较基准：中证综合全债指数



阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	0.34%	0.03%	-1.97%	1.01%	2.31%	-0.68%

注：1. 上投摩根全球天然资源股票A类
2. 业绩比较基准：中证综合全债指数
3. 业绩比较基准：中证综合全债指数
4. 业绩比较基准：中证综合全债指数

姓名	职务	任期自	任期至	证券从业年限	说明
张军	本基金基金经理	2012-03-26		10年（金融领域从业22年）	毕业于上海交通大学，曾任上海信托有限公司固定收益部业务经理，2004年加入上投摩根基金管理有限公司，担任上投摩根全球天然资源股票基金经理，2008年3月起担任上投摩根全球天然资源股票基金经理，2012年3月26日起担任上投摩根全球天然资源股票基金经理。

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
报告截止日期：二〇一五年七月三十一日

基金管理人及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2015年7月17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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中所载数据截止至本报告期内最后一交易日。本基金投资组合资产配置比例，本基金投资组合资产配置比例，本基金投资组合资产配置比例，基金的投资业绩并不表示对未来业绩的保证，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。

本报告自2015年4月1日起至6月30日止。

基金简称	上投摩根全球新兴市场股票(ODI)
基金代码	378006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月30日
基金合同生效以来基金份额总额	151,434,374.56份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产较高流动性的基础上，通过主动管理，力争获得超越业绩比较基准的长期稳定回报，实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过主动管理，力争获取稳定的股票投资收益。此外，本基金积极把握对经济周期的判断和预期（增发、回购收益率的预测、信贷等），把握市场变化，在严格控制风险的前提下，力求获得较高的长期投资回报。
业绩比较基准	中证综合全债指数
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货币市场基金，高于混合基金和股票型基金。
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
下属基金的基金简称	上投摩根全球新兴市场股票A类
下属基金的基金代码	378006
报告期末下属基金的份额总额	151,434,374.56份

主要财务指标	4月期 (2015年4月1日-2015年6月30日)	报告期末 (2015年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,263,506.14	
2.本期利润	-12,826,363.78	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0979	
4.期末基金资产净值	147,134,034.94	
5.期末基金份额净值	0.972	

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去一个阶段	-1.72%	15.7%	-0.07%	0.00%	-1.02%	0.77%

注：1. 上投摩根全球新兴市场股票A类
2. 业绩比较基准：中证综合全债指数
3. 业绩比较基准：中证综合全债指数
4. 业绩比较基准：中证综合全债指数

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去一个阶段	-1.72%	15.7%	-0.07%	0.00%	-1.02%	0.77%

注：1. 上投摩根全球新兴市场股票A类
2. 业绩比较基准：中证综合全债指数
3. 业绩比较基准：中证综合全债指数
4. 业绩比较基准：中证综合全债指数

注：本基金合同生效日为2011年1月30日，演示期间为2011年1月30日至2015年6月30日。
本基金成立于2011年1月30日，演示期间为2011年1月30日至2015年6月30日。

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的 比例(%)
1	权益投资	30,583,203.07	88.46
	其中:普通股	28,347,857.11	79.21
	存托凭证	2,235,345.96	6.25
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	金融资产投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他资产	-	-
9	合计	30,583,203.07	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的 比例(%)
1	权益投资	30,583,203.07	88.46
	其中:普通股	28,347,857.11	79.21
	存托凭证	2,235,345.96	6.25
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	金融资产投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他资产	-	-
9	合计	30,583,203.07	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的 比例(%)
1	权益投资	30,583,203.07	88.46
	其中:普通股	28,347,857.11	79.21
	存托凭证	2,235,345.96	6.25
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	金融资产投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他资产	-	-
9	合计	30,583,203.07	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的 比例(%)
1	权益投资	30,583,203.07	88.46
	其中:普通股	28,347,857.11	79.21
	存托凭证	2,235,345.96	6.25
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	金融资产投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他资产	-	-
9	合计	30,583,203.07	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的 比例(%)
1	权益投资	30,583,203.07	88.46
	其中:普通股	28,347,857.11	79.21
	存托凭证	2,235,345.96	6.25
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	金融资产投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他资产	-	-
9	合计	30,583,203.07	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的 比例(%)
1	权益投资	30,583,203.07	88.46
	其中:普通股	28,347,857.11	79.21
	存托凭证	2,235,345.96	6.25
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	金融资产投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他资产	-	-
9	合计	30,583,203.07	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的 比例(%)
1	权益投资	30,583,203.07	88.46
	其中:普通股	28,347,857.11	79.21
	存托凭证	2,235,345.96	6.25
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	金融资产投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他资产	-	-
9	合计	30,583,203.07	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的 比例(%)
1	权益投资	30,583,203.07	88.46
	其中:普通股	28,347,857.11	79.21
	存托凭证	2,235,345.96	6.25
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	金融资产投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他资产	-	-
9	合计	30,583,203.07	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的 比例(%)
1	权益投资	30,583,203.07	88.46
	其中:普通股	28,347,857.11	79.21
	存托凭证	2,235,345.96	6.25
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	金融资产投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他资产	-	-
9	合计	30,583,203.07	100.00

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的 比例(%)
1	权益投资	30,583,203.07	88.46
	其中:普通股	28,347,857.11	79.21
	存托凭证	2,235,345.96	6.25
2	固定收益投资	-	-
3	衍生品投资	-	-
4	金融资产投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他资产	-	-
9	合计	30,583,203.07	100.00

上海穆根基金管理有限公司
二〇一五年七月二十日

5.4 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排名前10名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	New China Life	新华人寿保险	15396	香港交易所	中国香港	200,000.00	7,302,363.32	4.96