

## 信息披露 Disclosure

## 上投摩根纯债添利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:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一五年七月二十日

§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的内容的真实性、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2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现数据、收益分配政策等项，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应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 上投摩根纯债添利债券

基金主代码 000089

基金运作方式 约定契约开放式

基金合同生效日 2014年12月24日

报告期末基金份额总额 232,020,170.00份

投资目标 在严格控制风险的前提下，通过积极主动地投资管理，力争实现长期稳定的回报。

投资策略 在实现操作目标时，本基金将采用自下而上的方法，对宏观经济形势和货币政策进行分析，结合对利率走势的判断，综合考虑国债、金融债、企业债、可转债、信用债、资产支持证券、货币市场工具等品种的相对投资价值进行评价，从而形成配置计划。同时又能够根据对宏观形势和货币政策的判断，适时调整组合的期限结构，以期获得更高的收益。

本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应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)

上投摩根纯债添利债券类 A类 上投摩根纯债添利债券C类

6,379,300.00 2,033,707.66

6,109,002.91 2,082,189.07

0.0373 0.0326

173,786,884.08 66,603,681.76

1,022 1,030

注:本基金A类应收利息指本基金和股东收入的公允价值变动收益减去相关费用后的余额，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本基金的各项费用(例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资、基金转换费等)，计算费用后实际收益水平低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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.上投摩根纯债添利债券A类:

阶段	净值增长率①	净值增长基准②	业绩比较基准③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	2.79%	0.63%	1.20%	0.04%	1.69%	0.05%

1.2 上投摩根纯债添利债券C类:

阶段	净值增长率①	净值增长基准②	业绩比较基准③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	2.69%	0.63%	1.20%	0.04%	1.49%	0.05%

3.2.2 目基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根纯债添利债券的历史走势图对比

(2014年12月1日至2015年6月30日)

注:本基金合同生效日为2014年12月24日，截至报告期末本基金尚未满一年。本基金建仓期自2014年12月24日至2015年6月23日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

2.上投摩根纯债添利债券类:

注:本基金合同生效日为2014年12月24日，截至报告期末本基金尚未满一年。本基金建仓期自2014年12月24日至2015年6月23日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

赵峰 基金经理 总经理助理 12年

注:本基金的基金经理任期，即其担任本基金基金经理之日起至其不再担任本基金基金经理之日止。

2.赵峰先生为本基金基金经理，其任职期间本基金合同已生效。

3.2.2 告知期内本基金运作情况说明

在报告期本基金未发生任何影响基金合同效力的重大事件，基金投资运作正常。

4.1 告知期内本基金的基金经理变动情况说明

本基金基金经理变动的原因是因个人原因辞职，由赵峰接替。

2.赵峰先生为本基金基金经理，其任职期间本基金合同已生效。

3.2.3 告知期内本基金运作情况说明

在报告期本基金未发生任何影响基金合同效力的重大事件，基金投资运作正常。

4.2 告知期内本基金的基金经理变动情况说明

本基金基金经理变动的原因是因个人原因辞职，由赵峰接替。

2.赵峰先生为本基金基金经理，其任职期间本基金合同已生效。

3.2.4 告知期内本基金运作情况说明

在报告期本基金未发生任何影响基金合同效力的重大事件，基金投资运作正常。

4.3 公司产品说明

4.3.1 公平交易制度执行情况

报告期内，本公司继续贯彻执行《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易制度，严格执行《证券投资基金公司公平交易制度》，并按照《证券投资基金公司公平交易制度》的规定执行，对买卖股票、债券、基金等投资品种在授权范围内进行公平交易和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在交易时机、成交价格等方面不存在不公平交易行为。

对于交易所市的证券交易活动，本公司实行集中交易制度，确保不同投资组合在投资时机、成交价格等方面不存在不公平交易行为。

对于银行间市场的证券交易活动，本公司实行集中交易制度，确保不同投资组合在投资时机、成交价格等方面不存在不公平交易行为。

对于柜台市场的证券交易活动，本公司实行集中交易制度，确保不同投资组合在投资时机、成交价格等方面不存在不公平交易行为。

对于场外的证券交易活动，本公司实行集中交易制度，确保不同投资组合在投资时机、成交价格等方面不存在不公平交易行为。

对于境外的证券交易活动，本公司实行集中交易制度，确保不同投资组合在投资时机、成交价格等方面不存在不公平交易行为。

对于境内上市的证券交易活动，本公司实行集中交易制度，确保不同投资组合在投资时机、成交价格等方面不存在不公平交易行为。

对于境外上市的证券交易活动，本公司实行集中交易制度，确保不同投资组合在投资时机、成交价格等方面不存在不公平交易行为。

对于境外的证券交易活动，本公司实行集中交易制度，确保不同投资组合在投资时机、成交价格等方面不存在不公平交易行为。

对于境外上市的证券交易活动，本公司实行集中交易制度，确保不同投资组合在投资时机、成交价格等方面不存在不公平交易行为。

对于境外上市的证券交易活动，本公司实行集中交易制度，确保不同投资组合在投资时机、成交价格等方面不存在不公平交易行为。