

上投摩根优信增利债券型证券投资基金

[2015] 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: 中银银行股份有限公司

报告送出日期: 二〇一六年一月二十二日

§ 1 基金提示

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，但不保证基金净值

是否正确无误。特别提示投资者注意投资风险。

本基金的过往业绩并不代表未来表现，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称: 上投摩根优信增利债券

基金主代码: 000016

基金运作方式: 灵活配置型开放式

基金份额发售日: 2015年10月11日

报告期末基金资产总额: 1,094,227,141.02元

投资目标: 本基金主要投资于信用债和可转债，在严格的风险控制下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略: 1.资产配置策略

本基金将综合运用久期策略、期限配置策略、息差策略等操作，力争在整体风险的基础上，以追求良好的投资收益。

2.久期策略

本基金通过分析宏观经济数据、利率走势、信用利差等指标，结合对宏观经济的判断，确定合理的久期配置。

3.信用债投资

本基金将精选信用债品种，通过深入研究企业基本面，精选资质优秀的发行人，精选评级较高的品种。

4.金融债二级市场投资

本基金将精选金融债品种，通过深入研究金融企业的基本面，精选资质优秀的发行人，精选评级较高的品种。

5.买入返售金融资产

本基金将精选买入返售金融资产品种，通过深入研究企业基本面，精选资质优秀的发行人，精选评级较高的品种。

6.银行存款和货币市场基金投资

本基金将精选银行存款品种，通过深入研究企业基本面，精选资质优秀的发行人，精选评级较高的品种。

7.其他资产

本基金将精选其他资产品种，通过深入研究企业基本面，精选资质优秀的发行人，精选评级较高的品种。

8.合计

365,079,366.75元 300,000

§ 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10月1日至2015年12月31日

上投摩根优信增利债券

上投摩根优信增利债券

1.本期已实现收益 6,076,322.53 1,691,411.26

2.本期利润 13,326,420.76 3,324,304.36

3.加权平均基金份额本期利润 0.0369 0.0923

4.期末基金资产净值 211,444,207.21 69,976,538.75

5.期末基金份额净值 1.447 1.438

6.报告期净值增长率及其相对应的业绩比较基准收益率 7.27% 0.86%

7.报告期净值增长率及其相对应的业绩比较基准收益率的差额 6.41% 0.60%

8.报告期净值增长率及其相对应的业绩比较基准收益率的差额百分比 6.01% 0.60%

9.期末可供分配基金份额利润 0.00037

10.期末可供分配金额 146,227,141.02 元 48,670,260.07 元

注: 本基金合同生效日为2014年6月11日, 预期收益日为2014年6月11日至2015年12月31日, 本基金合同自2014年6月11日至2014年12月10日, 建仓期结束后的资产配置比例符合基金合同约定。

本基金合同自2015年10月10日起, 将基金管理人“中投信增利债券”变更为“中投信增利债券收益型”。

1. 上投摩根优信增利债券 A

2. 上投摩根优信增利债券 C

注: 本基金合同生效日为2014年6月11日, 预期收益日为2014年6月11日至2015年12月31日, 本基金合同自2014年6月11日至2014年12月10日, 建仓期结束后的资产配置比例符合基金合同约定。

本基金合同自2015年10月10日起, 将基金管理人“中投信增利债券”变更为“中投信增利债券收益型”。

注: 本基金合同生效日为2014年6月11日, 预期收益日为2014年6月11日至2015年12月31日, 本基金合同自2014年6月11日至2014年12月10日, 建仓期结束后的资产配置比例符合基金合同约定。

本基金合同自2015年10月10日起, 将基金管理人“中投信增利债券”变更为“