

上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金

2015 年度报告摘要

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:二〇一六年三月三十一日

重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中,力求客观、公正、准确、完整地披露基金信息,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

2.1 基金基本情况
基金名称:上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金
基金简称:上投摩根纯债丰利
基金代码:000939

4.2 公平交易制度的执行情况
报告期内,公司严格执行公平交易管理制度,开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的收益差异,以及不同投资组合之间向交易所和关联方交易的价格和成交量的监控分析,公司未发现异常交易行为。

2.2 基金业绩说明
报告期内,本基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率的情况如下:
基金净值增长率:17.27%
业绩比较基准收益率:11.00%

4.3 异常交易专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。
4.4 报告期内基金投资情况的专项说明
报告期内,本基金投资范围符合基金合同约定,未发现异常交易行为。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

4.5 管理人内部控制制度的总体情况说明
本基金的投资决策和会计核算由基金会计负责,根据相关的法律法规制定,并制定了内部控制制度,对基金会计核算的各个关键环节进行风险控制,目的是保证基金估值和会计核算的准确性。

2.4 基金费用
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

4.6 管理人内部控制制度的总体情况说明
本基金的投资决策和会计核算由基金会计负责,根据相关的法律法规制定,并制定了内部控制制度,对基金会计核算的各个关键环节进行风险控制,目的是保证基金估值和会计核算的准确性。

2.5 基金业绩比较基准
基金业绩比较基准:中证综合债指数收益率

4.7 基金业绩比较基准
基金业绩比较基准:中证综合债指数收益率

2.6 基金净值表现
2.6.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
1. 上投摩根纯债丰利债券A

4.8 报告期内管理人对本基金持有人人数或基金资产净值预警情形的说明
无。

2.7 基金投资组合
2.7.1 上投摩根纯债丰利债券A

4.9 基金投资组合
4.9.1 基金投资组合

2.8 基金投资组合
2.8.1 基金投资组合

4.10 基金投资组合
4.10.1 基金投资组合

2.9 基金投资组合
2.9.1 基金投资组合

4.11 基金投资组合
4.11.1 基金投资组合

2.10 基金投资组合
2.10.1 基金投资组合

4.12 基金投资组合
4.12.1 基金投资组合

2.11 基金投资组合
2.11.1 基金投资组合

4.13 基金投资组合
4.13.1 基金投资组合

2.12 基金投资组合
2.12.1 基金投资组合

4.14 基金投资组合
4.14.1 基金投资组合

2.13 基金投资组合
2.13.1 基金投资组合

4.15 基金投资组合
4.15.1 基金投资组合

2.14 基金投资组合
2.14.1 基金投资组合

4.16 基金投资组合
4.16.1 基金投资组合

2.15 基金投资组合
2.15.1 基金投资组合

4.17 基金投资组合
4.17.1 基金投资组合

2.16 基金投资组合
2.16.1 基金投资组合

4.18 基金投资组合
4.18.1 基金投资组合

2.17 基金投资组合
2.17.1 基金投资组合

4.19 基金投资组合
4.19.1 基金投资组合

2.18 基金投资组合
2.18.1 基金投资组合

4.20 基金投资组合
4.20.1 基金投资组合

2.19 基金投资组合
2.19.1 基金投资组合

4.21 基金投资组合
4.21.1 基金投资组合

2.20 基金投资组合
2.20.1 基金投资组合

4.22 基金投资组合
4.22.1 基金投资组合

2.21 基金投资组合
2.21.1 基金投资组合

4.23 基金投资组合
4.23.1 基金投资组合

2.22 基金投资组合
2.22.1 基金投资组合

4.24 基金投资组合
4.24.1 基金投资组合

2.23 基金投资组合
2.23.1 基金投资组合

4.25 基金投资组合
4.25.1 基金投资组合

2.24 基金投资组合
2.24.1 基金投资组合

4.26 基金投资组合
4.26.1 基金投资组合

2.25 基金投资组合
2.25.1 基金投资组合

4.27 基金投资组合
4.27.1 基金投资组合

2.26 基金投资组合
2.26.1 基金投资组合

4.28 基金投资组合
4.28.1 基金投资组合

7.4.8.6 基金在关联方参与关联方承销证券的情况
7.4.8.7 其他关联方事项的说明
7.4.9 期末持有的正回购到期等流通受限证券

7.4.9.1 期末持有的正回购到期等流通受限证券
7.4.9.2 交易所市场债券正回购
7.4.9.3 交易所市场债券正回购

7.4.9.4 交易所市场债券正回购
7.4.9.5 交易所市场债券正回购
7.4.9.6 交易所市场债券正回购

7.4.9.7 交易所市场债券正回购
7.4.9.8 交易所市场债券正回购
7.4.9.9 交易所市场债券正回购

7.4.9.10 交易所市场债券正回购
7.4.9.11 交易所市场债券正回购
7.4.9.12 交易所市场债券正回购

7.4.9.13 交易所市场债券正回购
7.4.9.14 交易所市场债券正回购
7.4.9.15 交易所市场债券正回购

7.4.9.16 交易所市场债券正回购
7.4.9.17 交易所市场债券正回购
7.4.9.18 交易所市场债券正回购

7.4.9.19 交易所市场债券正回购
7.4.9.20 交易所市场债券正回购
7.4.9.21 交易所市场债券正回购

7.4.9.22 交易所市场债券正回购
7.4.9.23 交易所市场债券正回购
7.4.9.24 交易所市场债券正回购

7.4.9.25 交易所市场债券正回购
7.4.9.26 交易所市场债券正回购
7.4.9.27 交易所市场债券正回购

7.4.9.28 交易所市场债券正回购
7.4.9.29 交易所市场债券正回购
7.4.9.30 交易所市场债券正回购

7.4.9.31 交易所市场债券正回购
7.4.9.32 交易所市场债券正回购
7.4.9.33 交易所市场债券正回购

7.4.9.34 交易所市场债券正回购
7.4.9.35 交易所市场债券正回购
7.4.9.36 交易所市场债券正回购

7.4.9.37 交易所市场债券正回购
7.4.9.38 交易所市场债券正回购
7.4.9.39 交易所市场债券正回购

7.4.9.40 交易所市场债券正回购
7.4.9.41 交易所市场债券正回购
7.4.9.42 交易所市场债券正回购

7.4.9.43 交易所市场债券正回购
7.4.9.44 交易所市场债券正回购
7.4.9.45 交易所市场债券正回购

7.4.9.46 交易所市场债券正回购
7.4.9.47 交易所市场债券正回购
7.4.9.48 交易所市场债券正回购

7.4.9.49 交易所市场债券正回购
7.4.9.50 交易所市场债券正回购
7.4.9.51 交易所市场债券正回购

7.4.9.52 交易所市场债券正回购
7.4.9.53 交易所市场债券正回购
7.4.9.54 交易所市场债券正回购

2.27 基金投资组合
2.27.1 基金投资组合

4.29 基金投资组合
4.29.1 基金投资组合

7.4.9.55 交易所市场债券正回购
7.4.9.56 交易所市场债券正回购
7.4.9.57 交易所市场债券正回购