上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3月31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
报告送出日期:二〇一三年四月二十日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月19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。

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

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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根全球天然资源股票(QDII)
基金主代码	378546
交易代码	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
报告期末基金份额总额	59,093,374.01份
投资目标	本基金主要投资于全球范围内从事天然资源的勘探、开发、生产及销售,或是向天然资源行业提供服务的公司的股票,通过积极主动的资产配置和组合管理,在风险可控的前提下以获取长期资产增值。
投资策略	全球天然资源的稀缺与人类对其需求的不断增长的矛盾日益突显,这显示了天然资源具有极大的战略价值,该行业的相关上市公司也具有良好的投资机会。本基金将充分分享全球天然资源行业未来的高增长成果,审慎把握全球天然资源的投资机会,争取为投资者带来长期稳健回报。 总体上本基金将采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。首先通过考察不同国家的发展趋势及不同行业的景气程度,决定地区与板块的基本布局;其次采取自下而上的选股策略,在对股票进行基本面分析的同时,通过深入研究股票的价值与动量特性,选取目标投资对象。在固定收益类投资部分,本基金将综合考虑资产布局的安全性、流动性与收益性,并结合现金管理要求等来制订具体策略。
业绩比较基准	汇丰矿产、黄金及能源指数(总回报)
风险收益特征	本基金为股票型投资基金,主要投资于海外市场的天然资源行业的股票,本基金的业绩表现在大多数的情况下与国际大宗商品价格的走势具有较高的相关性。本基金的预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于较高风险和较高预期收益的基金品种。
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
境外投资顾问英文名称	JPMorgan Asset Management(UK) Limited
境外投资顾问中文名称	摩根资产管理(英国)有限公司
境外资产托管人英文名称	Bank of China (Hongkong)
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港)有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	-915,015.11
2.本期利润	-6,348,741.55
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1122
4.期末基金资产净值	51,569,235.34
5.期末基金份额净值	0.873

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基金的各项费用,计入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 本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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-11.19%	0.89%	-8.25%	0.82%	-2.94%	0.07%

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较

上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年3月26日至2013年3月31日)

注:本基金合同生效日为2012年3月26日,图示时间段为2012年3月26日至2013年3月31日。

本基金建仓期自2012年3月26日至2012年9月25日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张军	本基金基金经理	2012-3-26	-	8年(金融领域从业经验19年)	毕业于上海复旦大学,曾担任上海国际信托有限公司国际业务部经理,交易部经理。2004年6月加入上投摩根基金管理有限公司,担任交易总监,2007年10月起任投资经理。2008年3月起担任上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金经理,自2012年3月起同时担任上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金基金经理。

注:1. 任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 张军先生担任本基金首任基金经理的任职日期为本基金基金合同生效之日;

3. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Stuart Connell	全球天然资源团队专家	11年	男,获澳大利亚墨尔本大学地质学学位

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理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流程的各项要求,严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动,通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析,以确保本公司管理的不同投资组合在授权、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环节均得到公平对待。

对于二级市场投资活动,本公司执行集中交易制度,确保不同投资组合在买卖同一证券时,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;对于一级市场申购活动,本公司遵循价格优先、比例分配的原则,根据事前独立申报的价格和数量对交易的情况。

报告期内,通过对不同投资组合之间的交易价差和分配结果监控分析,监察稽核部未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,通过对交易时间、交易价格、分配结果监控分析,监察稽核部未发现存在异常交易行为。

所有投资组合(除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合)参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形;不适用。

4.5 报告期内基金的业绩表现说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

2013年伊始,美国因会终于达成了解决"财政悬崖"的协议,提振了投资者的信心,全球天然资源股票在一月初的乐观情绪中出现了一轮上涨,但当美联储会议纪要传出可能提前终止量化宽松政策的传闻后,资源品价格,尤其是黄金价格大幅下跌,之后尽管美联储主席一再强调货币政策立场不变,股价也未见有明显起色。三月后,意大利政局和塞浦路斯银行危机等欧债风险又加重了天然资源类股价的下行压力。

本基金在报告期内下跌11%,组合中的贵金属板块(主要是金矿股)和矿业股板块下跌14%。美国经济稳定复苏和强势美元使得黄金的避险功能消弱,全球主要黄金ETF基金规模大量缩水,金价下跌约5%。中国经济增长势头也弱于年初的乐观预期,是工业金属价格下跌近6%的原因之一。宏观风险导致投资者对经济复苏的力度产生怀疑,随着美元走强,资源品价格承压,造成了资源股股价下跌幅度超过了资源品本身的价格下跌。

本基金在报告期内的操作趋于谨慎,基金组合相比上一季度减持了贵金属股票,提高了现金比例,但对未来中长期的资源板块表现仍充满信心。天然资源类股经过连续两年多的下跌,估值已经低到历史底部。这与2013年的世界经济温和复苏的经济背景大相径庭,如果不出现类似2008年那样的全球危机,投资者的悲观情绪已经反映在股价的下跌中了,再大幅下跌的空间有限。2003-2004年以及2009年,全球经济如今年一样处于衰退后的复苏阶段,天然资源股票指数在上述两个时期都大幅上涨,并且强于大盘指数的表现。

4.5.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为-11.19%,同期业绩比较基准收益率为-8.25%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	41,914,964.44	80.62
	其中:普通股	41,914,964.44	80.62
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	915,239.34	1.76
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,985,934.85	17.28
8	其他各项资产	173,912.88	0.33
9	合计	51,990,051.51	100.00

注:截至2013年3月31日,本基金资产净值为51,569,235.34元,基金份额净值为0.873元,累计基金份额净值为0.873元。

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
加拿大	13,405,491.25	26.00
英国	10,435,357.61	20.24
澳大利亚	8,066,287.56	15.64
美国	7,820,871.07	15.17
挪威	992,460.97	1.92
中国香港	831,377.16	1.61
印度尼西亚	363,118.82	0.70
合计	41,914,964.44	81.28

注:国家(地区)类别根据其所在的证券交易所确定,ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
金属与采矿	27,238,496.22	52.82
石油、天然气与消费用燃料	14,676,468.22	28.46
合计	41,914,964.44	81.28

注:行业分类标准:MSCI

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十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	Freeport-McMoRan Copper & Gold Inc	-	FCX US	纽约证券交易所	美国	9,419	1,954,448.06	3.79
2	Royal Dutch Shell plc	荷兰皇家壳牌石油公司	RDSB LN	伦敦证券交易所	英国	9,206	1,918,357.93	3.72
3	Peabody Energy Corp	-	BTU US	纽约证券交易所	美国	14,071	1,865,634.98	3.62
4	BP plc	-	BP/ LN	伦敦证券交易所	英国	42,403	1,859,804.22	3.61
5	Glencore Intl plc	-	GLEN LN	伦敦证券交易所	英国	54,453	1,849,272.91	3.59
6	Teck Resources Ltd	-	TCK/B CN	多伦多证券交易所	加拿大	8,939	1,577,516.75	3.06
7	Canadian Natural Resources Ltd	-	CNQ CN	多伦多证券交易所	加拿大	7,684	1,544,273.16	2.99
8	Kinross Gold Corp	-	K CN	多伦多证券交易所	加拿大	23,514	1,166,545.20	2.26
9	First Quantum Minerals Ltd	-	FM CN	多伦多证券交易所	加拿大	8,404	1,001,871.85	1.94
10	DNO International ASA	-	DNO NO	奥斯陆证券交易所	挪威	91,423	992,460.97	1.92

注:1. 所用证券代码采用Ticker代码。

2. 所属国家(地区)列示证券挂牌的证券交易所所在国家(地区)。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	ETFS Physical Platinum	ETF	ETF	ETF Securities Ltd	915,239.34	1.77

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	112,393.88
4	应收利息	1,469.29
5	应收申购款	60,049.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	173,912.88

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入的原因,投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	57,870,920.37
本报告期基金总申购份额	13,019,223.33
减:本报告期基金总赎回份额	11,796,769.69
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	59,093,374.01

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金设立的文件;

2、《上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金基金合同》;

3、《上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金托管协议》;

4、《上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金业务规则》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件和营业执照。

7.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一三年四月二十日

长盛同丰分级债券型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3月31日

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2013年4月20日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月19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。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同丰分级债券
基金主代码	160810
交易代码	160810
基金运作方式	契约型。封闭期为18个月,封闭期内,同丰A自基金合同生效之日起每满6个月开放一次,同丰B封闭运作并上市交易;本基金基金合同生效后18个月届满,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。
基金合同生效日	2012年12月27日
报告期末基金份额总额	1,997,372,126.07份
投资目标	通过分析影响债券市场的各类要素,进行积极主动的投资管理,追求基金资产的稳定增值,以最大程度上取得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	以利率风险管理为核心,以久期配置为关键技术,在满足组合流动性要求上,结合不同类型债券流动性、税收和信用风险等因素,综合确定债券组合的类属配置进行个券选择,控制风险,获取超额的投资收益。具体投资运作中将运用换券利差交易策略、凸性套利交易策略以及骑乘收益率曲线策略等多样的操作策略。
业绩比较基准	中债综合指数(全价)
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于较低风险的证券投资基金品种,其长期预期收益和平均风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。在分级基金运作期内,本基金经过基金份额分级后,同丰A为低风险、收益相对稳定的稳健收益特征的基金份额;同丰B为较高风险、较高收益的增强收益特征的基金份额。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	长盛同丰分级债券A / 长盛同丰分级债券B
下属两级基金的交易代码	160811 / 150115
报告期末下属两级基金的份额总额	1,350,433,974.59份 / 646,938,151.48份
下属两级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定的稳健收益特征 / 较高风险、较高收益的增强收益特征

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	16,370,212.17
2.本期利润	18,625,492.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0093
4.期末基金资产净值	2,016,128,045.60
5.期末基金份额净值	1.009

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到2013年3月31日。

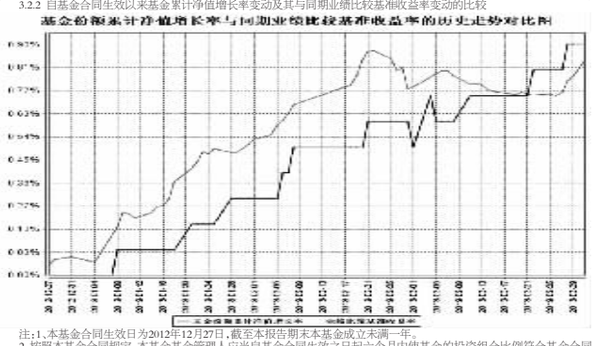
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.90%	0.05%	0.77%	0.03%	0.13%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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较



注:1、本基金合同生效日为2012年12月27日,截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截止本报告期末仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为:固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%;现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

3.3其他指标

金额单位:人民币元

其他指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)
长盛同丰分级债券A与长盛同丰分级债券B基金份额配比	2.08742361:1
期末长盛同丰分级债券A份额参考净值	1.011
期末长盛同丰分级债券B份额参考净值	1.006
长盛同丰分级债券A的约定年收益率(单利)	4.25%

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨衡	本基金基金经理,长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理,长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金经理,长盛纯债债券型证券投资基金基金经理。	2012年12月27日	—	6年	男,1975年10月出生。中国科学院数学与系统科学研究院博士、博士后。2007年7月进入长盛基金管理公司,历任固定收益研究员、社保组合组合经理助理、社保组合组合经理。现任长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理,长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金经理,长盛同丰分级债券型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛纯债债券型证券投资基金基金经理。

注:1.上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛同丰分级债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率,占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易片段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2013年1季度,宏观经济弱势平稳复苏,3月份中国制造业采购经理指数(PMI)为50.9%,连续第6个月保持在50%以上,其中新订单、生产量、就业等主要分项指数均现回升且绝对值高于总指数,而原材料库存指数为47.5%,比上月下降2.0个百分点,连续2个月位于临界点以下,表明制造业原材料库存量在大幅减少,微观层面企业生产经营仍处于"去库存"的收缩阶段,整体经济呈现温和回升态势。

2013年1季度,央行货币政策中性、公开市场操作力度偏弱。在宽松的资金面和旺盛的机构配置需求的推动下,债券市场尤其是信用债出现较强力度的上涨,信用债利率和利差水平快速回落到历史中位数之下。虽然公布的2月份CPI一定幅度的跌升导致市场出现小幅调整,但工业和消费等经济数据疲弱,银监会理财产品整肃新规等推动债券市场维持强势。

在报告期内,本基金通过采用多种量化优化技术建立了实时和日间交易数据扫描系统,及时进行市场价值品种挖掘和储备。在优化位置用个券选择的同时,从大类利率利差结构比较和组合流动性考虑,配置了一定比例的交易所国债品种。此外,组合加强信用债一级市场的配置力度,较快地提升了组合仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为1.009元,本报告期份额净值增长率为0.90%,同期业绩比较基准增长率为0.77%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,746,474,220.06	86.29
	其中:债券	1,746,474,220.06	86.29
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	174,200,000.00	8.61
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	64,041,233.03	3.16
6	其他资产	39,140,550.68	1.93
7	合计	2,023,856,003.77	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	270,422,153.80	13.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,180,000.00	2.49
	其中:政策性金融债	50,180,000.00	2.49
4	企业债券	1,415,849,066.26	70.23
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,023,000.00	0.50
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,746,474,220.06	86.63

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010303	03国债(3)	1,484,510	145,036,627.00	7.19
2	010107	21国债(7)	1,169,550	122,732,577.00	6.09
3	122009	08新湖债	554,840	59,828,397.20	2.97
4	122162	12中孚债	550,070	57,300,791.90	2.84
5	112119	12恒邦债	549,225	55,960,535.25	2.78

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	302,608.06
2	应收证券清算款	5,673,708.31
3	应收股利	-
4	应收利息	33,097,133.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	67,100.62
8	其他	-
9	合计	39,140,550.68

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	长盛同丰分级债券A	长盛同丰分级债券B
报告期期初基金份额总额	1,350,433,974.59	646,938,151.48
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	1,350,433,974.59	646,938,151.48

注:1、本基金合同生效日为2012年12月27日。

2、本基金封闭期为18个月,同丰A自基金合同生效之日起每满6个月开放一次,同丰B封闭运作并上市交易。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准基金募集的文件;

2、《长盛同丰分级债券型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛同丰分级债券型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛同丰分级债券型证券投资基金招募说明书》;

5、法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

7.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所和/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666,010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

上投摩根强化回报债券型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3月31日

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年四月二十日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月19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。

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

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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根强化回报债券
基金主代码	372010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月10日
报告期末基金份额总额	132,409,297.79份
投资目标	本基金在严格控制风险和维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投资收益率,实现基金资产的长期稳定增值。
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,本基金将根据对股票市场的趋势研判及新股(增发)申购收益率的预测,适度参与一级市场和二级市场的股票投资,在严格控制风险的前提下,力求提高基金的整体收益率。 本基金将采用积极主动的债券投资策略,以中长期利率分析为核心,结合宏观经济周期、宏观政策方向、收益率曲线形态、债券市场供求关系等分析,实施积极的债券投资组合管理。在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。
业绩比较基准	中信标普金债指数。
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高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	上投摩根强化回报债券A类 / 上投摩根强化回报债券B类
下属两级基金的交易代码	372010 / 372110
报告期末下属两级基金的份额总额	86,414,497.07份 / 45,994,800.72份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)	
	上投摩根强化回报债券A类	上投摩根强化回报债券B类
1.本期已实现收益	3,714,470.37	2,368,902.04
2.本期利润	3,488,381.46	2,246,163.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0493	0.0496
4.期末基金资产净值	93,097,431.60	49,189,712.72
5.期末基金份额净值	1.077	1.069

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基金的