

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
重要提示
1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺不存在虚假记载、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法律责任。

上投摩根纯债债券型证券投资基金
2014 年度 报告摘要

2.1 基金基本情况
基金名称:上投摩根纯债债券
交易代码:371020
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2009年6月24日
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

Table with columns: 项目, 2014年1月1日至2014年12月31日, 本期, 上期可比期间. Rows include: 一、期初所有者权益(账面净值), 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, 三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数.

2.2 基金业绩说明
本基金根据对利率趋势的判断,适时调整组合久期,结合主动性资产配置,在严格控制组合投资风险的同时,提高基金资产流动性与收益性。

2.3 基金管理人、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:中国工商银行股份有限公司
基金管理人及基金托管人承诺不存在虚假记载、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法律责任。

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

Table with columns: 项目, 2014年, 2013年, 2012年. Rows include: 3.1.1 期间回报和净值增长, 3.1.2 期末基金份额净值, 3.1.3 基金份额持有人数量.

4 基金管理人及基金托管人

4.1 基金管理人
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金管理人承诺:基金管理人承诺不以损害基金份额持有人利益为代价进行不正当交易。

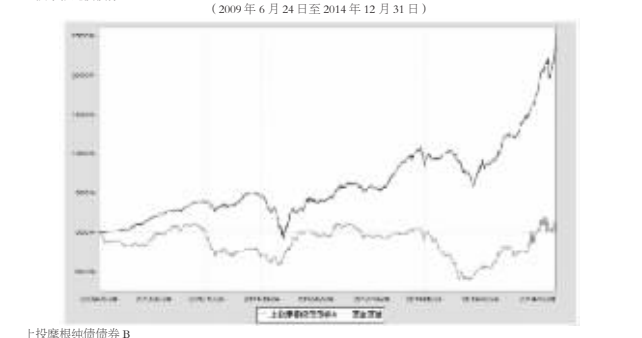
4.2 基金净值表现

Table with columns: 阶段, 份额净值增长, 份额净值增长率, 业绩比较基准, 业绩比较基准收益与净值差. Rows include: 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 过去三年, 过去五年.

5 托管人报告

5.1 托管人报告
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
基金托管人承诺:基金托管人承诺不以损害基金份额持有人利益为代价进行不正当交易。

5.2 基金净值表现



6 审计报告

6.1 审计报告
上投摩根纯债债券型证券投资基金2014年度财务报表由普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师王英签字出具了“无保留意见的审计报告”。

7 基金管理人及基金托管人

7.1 基金管理人
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金管理人承诺:基金管理人承诺不以损害基金份额持有人利益为代价进行不正当交易。

8 基金净值表现

Table with columns: 资产, 附注号, 2014年12月31日, 2013年12月31日. Rows include: 货币资金, 银行存款, 交易性金融资产, 可供出售金融资产.

9 基金管理人及基金托管人

9.1 基金管理人
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金管理人承诺:基金管理人承诺不以损害基金份额持有人利益为代价进行不正当交易。

10 基金净值表现

Table with columns: 项目, 2014年1月1日至2014年12月31日, 2013年1月1日至2013年12月31日. Rows include: 当期发生的基金应支付的托管费, 当期发生的基金应支付的基金管理费.

11 基金管理人及基金托管人

11.1 基金管理人
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金管理人承诺:基金管理人承诺不以损害基金份额持有人利益为代价进行不正当交易。

12 基金净值表现

Table with columns: 项目, 2014年1月1日至2014年12月31日, 2013年1月1日至2013年12月31日. Rows include: 当期发生的基金应支付的托管费, 当期发生的基金应支付的基金管理费.

13 基金管理人及基金托管人

13.1 基金管理人
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金管理人承诺:基金管理人承诺不以损害基金份额持有人利益为代价进行不正当交易。

14 基金净值表现

Table with columns: 项目, 2014年1月1日至2014年12月31日, 2013年1月1日至2013年12月31日. Rows include: 当期发生的基金应支付的托管费, 当期发生的基金应支付的基金管理费.

于2014年12月31日,本基金未持有停牌或以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日同)。
(四) 不以公允价值计量的金融工具
不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差无几。

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产比例. Rows include: 1 权益类资产, 2 固定收益投资, 3 其中:债券, 4 金融衍生品投资.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金总资产比例. Rows include: 1 600028 中信银行, 2 600015 民生银行.

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金总资产比例. Rows include: 1 101017 21国债07, 2 101003 03国债07.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include: 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收利息.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include: 1 应付证券清算款, 2 应付利息, 3 其他应付款.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include: 1 应付债券, 2 应付股利, 3 其他应付款.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include: 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收利息.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include: 1 应付证券清算款, 2 应付利息, 3 其他应付款.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include: 1 应付债券, 2 应付股利, 3 其他应付款.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include: 1 应付证券清算款, 2 应付利息, 3 其他应付款.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include: 1 应付证券清算款, 2 应付利息, 3 其他应付款.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include: 1 应付证券清算款, 2 应付利息, 3 其他应付款.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include: 1 应付证券清算款, 2 应付利息, 3 其他应付款.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include: 1 应付证券清算款, 2 应付利息, 3 其他应付款.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include: 1 应付证券清算款, 2 应付利息, 3 其他应付款.