



上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金

2015 第一季度报告

2015年3月31日

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司
基金管理人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年四月二十二日

1.1 重要提示

基金管理人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。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2015年4月21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，也不保证基金份额持有人不受损失。投资者自行承担投资风险，基金管理人不承担投资损失。投资者自行承担投资风险，基金管理人不承担投资损失。

本报告中所列数据截止日为2015年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根纯债丰利债券
基金代码	00089
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2014年11月18日
报告期末基金份额总额	571,085,217.90
投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的前提下，力争获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金采用自上而下的方法，对宏观经济形势和政策取向进行判断，并综合债券市场供求状况、市场流动性等因素，对利率期限结构、不同期限品种的收益率进行研判，确定资产配置策略，并据此进行债券投资组合的构建。本基金在严格控制风险的前提下，积极把握债券市场中的投资机会，在严格控制风险的前提下，积极把握债券市场中的投资机会。本基金在严格控制风险的前提下，积极把握债券市场中的投资机会。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为纯债基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与收益高于货币型基金，低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属证券投资基金的基金简称	上投摩根纯债天添宝A 上投摩根纯债天添宝C
下属证券投资基金的基金代码	00089 00080
报告期末下属证券投资基金的份额总额	512,508,217.90 99,022,399.60

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标		
	报告期	2015年1月1日至2015年3月31日
1.本期已实现收益	上投摩根纯债丰利债券A	上投摩根纯债丰利债券C
2.本期利润	6,907,780.55	917,552.21
3.加权平均基金份额本期利润	5,859,085.94	867,591.95
4.期末基金资产净值	10,007	10,007
5.期末基金份额净值	517,306,424.97	99,022,399.60
6.期末基金份额持有人数量	1,000	1,008

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（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金赎回费等），计入费用后实际收益水平可能会低于所列数字。

§4 基金业绩比较

4.1 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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.60%	0.06%	0.62%	0.06%	-0.02%	-0.04%

4.2 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

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.50%	0.06%	0.62%	0.06%	-0.12%	-0.04%

注：本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，以上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率对比图（2014年11月18日至2015年3月31日）

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	投资组合	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中：股票	-	-
3	固定收益投资	564,315,918.90	83.89
4	其中：国债	564,315,918.90	83.89
5	银行存款	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他金融资产	-	-
8	合计	564,315,918.90	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

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投资。

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五名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	49,138,000.00	8.55
2	央行票据	-	-
3	金融债	53,500.00	0.01
4	企业债	226,922,364.80	39.32
5	企业短期融资券	149,202,600.00	25.96
6	中期票据	138,000,000.00	23.91
7	可转债	-	-
8	合计	564,315,918.90	97.78

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	001921	13国债13	200,000	20,017,000.00	4.52
2	01199931	15国债02	200,000	20,020,000.00	3.47
3	01199917	15国债01	200,000	19,986,000.00	3.46
4	04156406	15国债01	200,000	19,966,000.00	3.46
5	04155202	15国债02	200,000	19,956,000.00	3.46

§6 开放式基金资产变动

项目	上投摩根纯债天添宝A	上投摩根纯债天添宝C
本报告期初基金份额总额	466,374,024.45	172,386,279.22
本报告期间基金份额净增加额	87,901,463.12	2,696,796.21
减：本报告期间基金份额减少额	40,767,649.08	11,614,788.06
本报告期末基金份额总额	512,508,217.90	99,468,247.47

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	38,232,758.91
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,208,817.97
4	应收申购款	2,093.65
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	38,232,758.91

§9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本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，以上投摩根纯债天添宝A基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率对比图（2014年11月18日至2015年3月31日）

§10 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

项目	上投摩根纯债天添宝A	上投摩根纯债天添宝C
本报告期初基金份额总额	466,374,024.45	172,386,279.22
本报告期间基金份额净增加额	87,901,463.12	2,696,796.21
减：本报告期间基金份额减少额	40,767,649.08	11,614,788.06
本报告期末基金份额总额	512,508,217.90	99,468,247.47

§11 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	38,232,758.91
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,208,817.97
4	应收申购款	2,093.65
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	38,232,758.91

§12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本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，以上投摩根纯债天添宝A基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率对比图（2014年11月18日至2015年3月31日）

§13 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

项目	上投摩根纯债天添宝A	上投摩根纯债天添宝C
本报告期初基金份额总额	466,374,024.45	172,386,279.22
本报告期间基金份额净增加额	87,901,463.12	2,696,796.21
减：本报告期间基金份额减少额	40,767,649.08	11,614,788.06
本报告期末基金份额总额	512,508,217.90	99,468,247.47

§14 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	38,232,758.91
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,208,817.97
4	应收申购款	2,093.65
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	38,232,758.91

§15 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本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，以上投摩根纯债天添宝A基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率对比图（2014年11月18日至2015年3月31日）

上投摩根纯债添利债券型证券投资基金

2015 第一季度报告

2015年3月31日

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司
基金管理人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年四月二十二日

§1 重要提示

基金管理人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。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2015年4月21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，也不保证基金份额持有人不受损失。投资者自行承担投资风险，基金管理人不承担投资损失。投资者自行承担投资风险，基金管理人不承担投资损失。

本报告中所列数据截止日为2015年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根纯债添利
基金代码	00089
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2014年12月18日
报告期末基金份额总额	48,507,352.10
投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的前提下，力争获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金采用自上而下的方法，对宏观经济形势和政策取向进行判断，并综合债券市场供求状况、市场流动性等因素，对利率期限结构、不同期限品种的收益率进行研判，确定资产配置策略，并据此进行债券投资组合的构建。本基金在严格控制风险的前提下，积极把握债券市场中的投资机会，在严格控制风险的前提下，积极把握债券市场中的投资机会。本基金在严格控制风险的前提下，积极把握债券市场中的投资机会。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为纯债基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与收益高于货币型基金，低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属证券投资基金的基金简称	上投摩根纯债天添宝A 上投摩根纯债天添宝C
下属证券投资基金的基金代码	00089 00080
报告期末下属证券投资基金的份额总额	318,379,606.88 118,167,945.83

§3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标		
	报告期	2015年1月1日至2015年3月31日
1.本期已实现收益	4,239,951.58	1,665,086.60
2.本期利润	2,596,807.07	1,136,001.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.007	0.006
4.期末基金资产净值	319,794,027.08	118,505,243.32
5.期末基金份额净值	1.005	1.003

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（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金赎回费等），计入费用后实际收益水平可能会低于所列数字。

§4 基金业绩比较

4.1 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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.40%	0.06%	0.62%	0.06%	-0.22%	-0.04%

4.2 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

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.20%	0.06%	0.62%	0.06%	-0.42%	-0.04%

注：本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，以上投摩根纯债添利债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率对比图（2014年12月18日至2015年3月31日）

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	投资组合	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中：股票	-	-
3	固定收益投资	564,315,918.90	83.89
4	其中：国债	564,315,918.90	83.89
5	银行存款	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他金融资产	-	-
8	合计	564,315,918.90	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

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投资。

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五名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	49,138,000.00	8.55
2	央行票据	-	-
3	金融债	53,500.00	0.01
4	企业债	226,922,364.80	39.32
5	企业短期融资券	149,202,600.00	25.96
6	中期票据	138,000,000.00	23.91
7	可转债	-	-
8	合计	564,315,918.90	97.78

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	001921	13国债13	200,000	20,017,000.00	4.52
2	01199931	15国债02	200,000	20,020,000.00	3.47
3	01199917	15国债01	200,000	19,986,000.00	3.46
4	04156406	15国债01	200,000	19,966,000.00	3.46
5	04155202	15国债02	200,000	19,956,000.00	3.46

§6 开放式基金资产变动

项目	上投摩根纯债天添宝A	上投摩根纯债天添宝C
本报告期初基金份额总额	466,374,024.45	172,386,279.22
本报告期间基金份额净增加额	87,901,463.12	2,696,796.21
减：本报告期间基金份额减少额	40,767,649.08	11,614,788.06
本报告期末基金份额总额	512,508,217.90	99,468,247.47

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	38,232,758.91
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,208,817.97
4	应收申购款	2,093.65
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	38,232,758.91

§9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本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，以上投摩根纯债天添宝A基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率对比图（2014年12月18日至2015年3月31日）

§10 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

项目	上投摩根纯债天添宝A	上投摩根纯债天添宝C
本报告期初基金份额总额	466,374,024.45	172,386,279.22
本报告期间基金份额净增加额	87,901,463.12	2,696,796.21
减：本报告期间基金份额减少额	40,767,649.08	11,614,788.06
本报告期末基金份额总额	512,508,217.90	99,468,247.47

§11 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	38,232,758.91
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,208,817.97
4	应收申购款	2,093.65
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	38,232,758.91

§12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本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，以上投摩根纯债天添宝A基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率对比图（2014年12月18日至2015年3月31日）

§13 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

项目	上投摩根纯债天添宝A	上投摩根纯债天添宝C
本报告期初基金份额总额	466,374,024.45	172,386,279.22
本报告期间基金份额净增加额	87,901,463.12	2,696,796.21
减：本报告期间基金份额减少额	40,767,649.08	11,614,788.06
本报告期末基金份额总额	512,508,217.90	99,468,247.47

§14 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	38,232,758.91
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,208,817.97
4	应收申购款	2,093.65
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	38,232,758.91

§15 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本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，以上投摩根纯债天添宝A基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率对比图（2014年12月18日至2015年3月31日）

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司
基金管理人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年四月二十二日

§1 重要提示

基金管理人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。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2015年4月21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，也不保证基金份额持有人不受损失。投资者自行承担投资风险，基金管理人不承担投资损失。投资者自行承担投资风险，基金管理人不承担投资损失。

本报告中所列数据截止日为2015年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根纯债添利
基金代码	00089
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2014年12月18日
报告期末基金份额总额	48,507,352.10
投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的前提下，力争获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金采用自上而下的方法，对宏观经济形势和政策取向进行判断，并综合债券市场供求状况、市场流动性等因素，对利率期限结构、不同期限品种的收益率进行研判，确定资产配置策略，并据此进行债券投资组合的构建。本基金在严格控制风险的前提下，积极把握债券市场中的投资机会，在严格控制风险的前提下，积极把握债券市场中的投资机会。本基金在严格控制风险的前提下，积极把握债券市场中的投资机会。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为纯债基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与收益高于货币型基金，低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属证券投资基金的基金简称	上投摩根纯债天添宝A 上投摩根纯债天添宝C
下属证券投资基金的基金代码	00089 00080
报告期末下属证券投资基金的份额总额	318,379,606.88 118,167,945.83

§3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标		
	报告期	2015年1月1日至2015年3月31日
1.本期已实现收益	4,239,951.58	1,665,086.60
2.本期利润	2,596,807.07	1,136,001.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.007	0.006
4.期末基金资产净值	319,794,027.08	118,505,243.32
5.期末基金份额净值	1.005	1.003

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，