上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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:二〇一五年十月二十六日

§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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根大盘蓝筹股票
基金主代码	376510
交易代码	376510
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月20日
报告期末基金份额总额	160,007,958.68份
投资目标	通过投资大盘蓝筹股票,力争最大程度的分享中国经济持续发展带来的中长期收益,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金充分借鉴摩根资产管理集团全球行之有效的投资理念和技术,“自下而上”的精选个股,重点投资于在行业内占有领先地位、业绩良好且稳定增长、价值相对低估的大盘蓝筹上市公司。同时结合宏观经济运行状况和金融市场运行分析趋势的市场研判,对相关资产类别的预期收益进行监控,动态调整股票、债券等大类资产配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金属于股票型基金产品,在开放式基金中,其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于风险水平较高的基金产品。
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

§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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-82,841,585.49
2.本期利润	-57,613,774.18
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3097
4.期末基金资产净值	212,590,018.51
5.期末基金份额净值	1.329

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、基金转换费等),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	-20.80%	3.32%	-23.94%	2.84%	3.14%	0.48%

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

上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年12月20日至2015年9月30日)

注:本基金建仓期自2010年12月20日至2011年6月19日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金合同生效日为2010年12月20日,图示时间段为2010年12月20日至2015年9月30日。

§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		
征茂平	本基金基金经理	2013-07-22	-	13年	征茂平先生自2001年3月至2004年3月在上海证大投资管理有限公司任高级研究员从事证券研究的工作;2004年3月至2005年4月在平安证券有限公司任高级研究员从事证券研究的工作;2005年5月至2008年5月在大成基金管理有限公司任研究员从事成长股票组合的管理工作;2008年5月起加入上投摩根基金管理有限公司,担任行业专家兼基金经理助理,自2013年7月起担任上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金基金经理,自2013年9月起同时担任上投摩根红利回报混合型证券投资基金基金经理,2014年1月至2015年2月担任上投摩根阿尔法混合型证券投资基金基金经理,自2015年9月起同时担任上投摩根整合驱动灵活配置混合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.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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《上投摩根大盘蓝筹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。

4.3 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,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。

对于交易所市场投资活动,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;对于银行间市场投资活动,本公司通过对手库控制和交易室询价机制,严格防范对手风险并检查价格公允性;对于申购投资行为,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结果进行公平分配。

报告期内,通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析,未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,通过对交易价格、交易时间、交易方向等的分析,未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

所有投资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;无。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

二季度沫清理场外配资引起的被动去杠杆、上市公司盈利低于预期等负面因素导致三季度证券市场出现大幅调整,上证综指、沪深300、创业板指数分别下跌28.63%、28.39%、27.14%,调整幅度远超市场预期,同时由于大部分个股均呈现断崖式无量下跌,卖出机会较少,最终使得三季度各类投资者损失惨重。

基于判断市场将继续调整,本基金组合在三季度初以防御为主,重点配置金融、地产、基建等行业内低估值大盘蓝筹为主要组合标的,获得明显的相对收益,而在市场调整一段时间后,预期市场将进入震荡整体阶段,因此从本基金组合中长期角度出发,在三季度后期对组合结构进行调整:精选业绩增长明确行业和个股,以期获得中长期的超额收益,从投资结果看,取得比较明显的积极效果,本基金净值在三季度跑赢业绩比较基准。

基于经济下行压力较大,预计四季度政府微刺激政策将持续释放,但经济继续低位运行的概率仍然较大。经过前期下跌后,部分个股的估值已经具备投资价值,市场在四季度存在一定的反弹要求,但在预期上市公司难以根本好转和去杠杆持续的背景下,本基金判断四季度市场的风险偏好难以大幅回升,存量博弈阶段市场上行空间有限,整体将呈现震荡整理格局;估值和盈利将再次成为投资者重点关注因素,自下而上精选个股将重新成为市场主流。

操作上,本基金四季度仍将以获取绝对收益的策略应对市场的震荡整理,本基金判断低估值大盘蓝筹板块在三季度相对收益明显,四季度再度获取相对收益的概率不大,因此本基金组合将适当降低现有大盘蓝筹配置比例,优化结构,关注业绩增长明确、成长能力持续性较强的传媒、电子、医药等板块,并重点关注行业景气持续向上、受益于经济转型的高端装备、环保等行业。

4.4.2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-20.80%,同期业绩比较基准收益率为-23.94%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	190,260,212.69	87.63
	其中:股票	190,260,212.69	87.63
2	固定收益投资	15,287,865.00	7.04
	其中:债券	15,287,865.00	7.04
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	9,383,177.87	4.32
7	其他各项资产	2,192,872.47	1.01
8	合计	217,124,128.03	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	2,182,800.00	1.03
B	采矿业	-	-
C	制造业	113,019,429.62	53.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,491,760.00	3.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,575,565.16	3.09
G	交通运输、仓储和邮政业	14,559,800.20	6.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,137,373.00	4.30
J	金融业	-	-
K	房地产业	19,516,191.31	9.18
L	租赁和商务服务业	8,845,197.00	4.16
M	科学研究和技术服务业	5,426,944.00	2.55
N	水利、环境和公共设施管理业	4,505,152.40	2.12
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	190,260,212.69	89.50

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000024	招商地产	685,019	19,516,191.31	9.18
2	002236	大华股份	563,000	19,035,030.00	8.95
3	600587	新华医疗	311,646	10,193,940.66	4.80
4	002572	索菲亚	265,458	10,172,350.56	4.78
5	601021	春秋航空	89,891	10,085,770.20	4.74
6	600276	恒瑞医药	199,877	9,232,318.63	4.34
7	300145	南方泵业	210,510	7,268,910.30	3.42
8	002508	老板电器	190,328	6,861,324.40	3.23
9	000958	东方能源	245,900	6,491,760.00	3.05
10	600867	通化东宝	277,700	6,223,257.00	2.93

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,287,865.00	7.19
	其中:政策性金融债	15,287,865.00	7.19
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	15,287,865.00	7.19

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	018001	国开1301	151,500	15,287,865.00	7.19

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	514,071.50
2	应收证券清算款	971,737.31
3	应收股利	-
4	应收利息	656,548.66
5	应收申购款	50,515.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,192,872.47

5.11.4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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300145	南方泵业	7,268,910.30	3.42	筹划重大事项

5.11.6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	193,436,931.43
本报告期基金总申购份额	94,394,515.20
减:本报告期基金总赎回份额	127,823,487.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	160,007,958.68

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
本报告期买入申购总份额	1,280,852.54
本报告期卖出赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,280,852.54
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.80

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015-07-29	1,280,852.54	1,980,198.02	1.00%
合计			1,280,852.54	1,980,198.02	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金设立的文件;
2. 《上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金基金合同》;
3. 《上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金托管协议》;
4. 《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
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。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 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
二〇一五年十月二十六日

上投摩根分红添利债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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:二〇一五年十月二十六日

§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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根分红添利债券	
基金主代码	370021	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年6月25日	
报告期末基金份额总额	204,089,372.27份	
投资目标	在有效控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极主动的投资管理,力争为投资者创造稳定的当期收益和长期回报。	
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合,通过对固定收益资产的投资,获取稳定的投资收益;在此基础上,适当参与新股发行申购及增发新股申购,在严格控制基金资产运作风险的基础上,实现基金资产的长期增值。	
业绩比较基准	中信标普全债指数。	
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	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	上投摩根分红添利债券A类	上投摩根分红添利债券B类
下属两级基金的交易代码	370021	370022
报告期末下属两级基金的份额总额	191,325,574.36份	12,763,797.91份

注:基金管理人于2015年10月10日发布公告,本基金的业绩比较基准由“中信标普全债指数”变更为“中证综合债券指数”。

§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(2015年7月1日-2015年9月30日)	
	上投摩根分红添利债券A类	上投摩根分红添利债券B类
1.本期已实现收益	3,272,192.23	218,519.40
2.本期利润	2,120,505.27	144,416.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.0123	0.0132
4.期末基金资产净值	216,755,082.55	14,445,432.88
5.期末基金份额净值	1.133	1.132

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、基金转换费等),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

1、上投摩根分红添利债券A类:

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	1.20%	0.24%	1.81%	0.05%	-0.61%	0.19%

2、上投摩根分红添利债券B类:

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	1.20%	0.23%	1.81%	0.05%	-0.61%	0.18%

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

上投摩根分红添利债券型证券投资基金

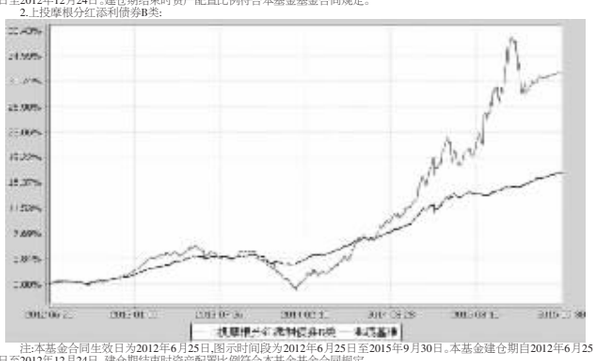
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月25日至2015年9月30日)

1.上投摩根分红添利债券A类:

注:本基金合同生效日为2012年6月25日,图示时间段为2012年6月25日至2015年9月30日。本基金建仓期自2012年6月25日至2012年12月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

2.上投摩根分红添利债券B类:



注:本基金合同生效日为2012年6月25日,图示时间段为2012年6月25日至2015年9月30日。本基金建仓期自2012年6月25日至2012年12月24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		
赵峰	本基金基金经理、债券投资部总监	2012-06-25	-	12年	基金经理赵峰先生,上海财经大学金融学硕士,2003年4月至2006年5月在申银万国证券研究所担任研究员负责债券研究方面的工作;2006年6月至2011年3月在富国基金管理有限公司担任投资经理负责债券投资方面的工作;2011年4月加入上投摩根基金管理有限公司,2011年9月至2014年12月担任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理,2012年6月起任上投摩根分红添利债券型证券投资基金基金经理,2013年7月至2014年12月担任上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金经理,2013年8月起担任上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金基金经理,自2014年6月起任上投摩根信信增利债券型证券投资基金基金经理,自2014年12月起同时担任上投摩根纯债添利债券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.赵峰先生为本基金首任基金经理,其任职日期指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、《上投摩根分红添利债券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。

4.3 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,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。

对于交易所市场投资活动,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;对于银行间市场投资活动,本公司通过对手库控制和交易室询价机制,严格防范对手风险并检查价格公允性;对于申购投资行为,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结果进行公平分配。

报告期内,通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析,未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,通过对交易价格、交易时间、交易方向等的分析,未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

所有投资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;无。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

三季度以来,工业增加值及固定资产投资同比增速持续在底部徘徊,中国制造业采购经理人指数(PMI)8、9两月连续低于荣枯线,反映出经济持续偏弱,并且未见企稳信号,市场对经济的悲观预期有所强化。货币政策持续保持宽松,且在8月份再次同时降准降息,与此同时,权益市场经历了大幅调整,表现疲弱,资金配置逐步向低风险资产转移。在此背景下,三季度收益率呈现出震荡下行趋势。尤其是8月下旬“双降”后,债券收益率快速下降。

本基金在季度初显著提升了长期利率债仓位,随着收益率的大幅下行,逐步兑现收益;同时对转债保持谨慎,维持了较低仓位。

展望四季度,经济企稳仍未见明显信号,增长压力依然存在。三季度经济数据的公布可能强化市场的悲观预期,整体上依然支持货币政策的持续宽松。另外,市场风险偏好在急剧下降后短期难以恢复,资金涌向债券市场的情况也难以改观,整体上利好债市。但是四季度依然存在如下几个风险:在收益率降至低位的情况下,四季度债券投资者谨慎情绪可能上升;信用利差损然创出新低,但其与经济低迷的现实相悖,后续市场对信用风险敏感程度可能会逐步增强;持续的财政刺激政策可能带来经济的边际改善。

因此,本基金四季度将整体维持中性仓位,视经济及市场状况适当进行波段操作,加强对信用债的跟踪及研究,规避高风险和经营表现不佳的行业及个券,严格把控信用风险。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A类份额净值增长率为1.20%,本基金B类基金份额净值增长率为1.20%,同期业绩比较基准收益率为1.81%。

§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	1,194,400.00	0.46
	其中:股票	1,194,400.00	0.46
2	固定收益投资	245,841,850.20	94.52
	其中:债券	245,841,850.20	94.52
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	2,044,085.39	0.79
7	其他各项资产	11,027,701.75	4.24
8	合计	260,108,037.34	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	1,194,400.00	0.52
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	1,194,400.00	0.52

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	40,000	1,194,400.00	0.52

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	11,733,700.00	5.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	34,029,750.00	14.72
	其中:政策性金融债	34,029,750.00	14.72
4	企业债券	195,033,145.20	84.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,436,755.00	1.92
8	其他	608,500.00	0.26
9	合计	245,841,850.20	106.33

注:其他是指可交换公司债。

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	140202	14国开02	200,000	21,416,000.00	9.26
2	018001	国开1301	125,000	12,613,750.00	5.46
3	010107	21国债(7)	110,000	11,733,700.00	5.08
4	122607	PR渝地产	110,000	9,504,000.00	4.11
5	122995	08合建投	80,000	8,349,600.00	3.61

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	98,112.36
2	应收证券清算款	3,168,116.75
3	应收股利	-
4	应收利息	6,672,331.53
5	应收申购款	1,089,141.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,027,701.75

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	1,254,016.00	0.54
2	113008	电气转债	786,900.00	0.34
3	110030	格力转债	736,649.00	0.32

5.11.5报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票无流通受限情况。

5.11.6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

项目	上投摩根分红添利债券A类	上投摩根分红添利债券B类
本报告期期初基金份额总额	171,494,691.96	10,947,624.25
本报告期基金总申购份额	74,413,423.15	6,342,703.10
减:本报告期基金总赎回份额	54,582,540.75	4,526,529.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	191,325,574.36	12,763,797.91

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录

1、中国证监会批准上投摩根分红添利债券型证券投资基金设立的文件;
2、《上投摩根分红添利债券型证券投资基金基金合同》;
3、《上投摩根分红添利债券型证券投资基金托管协议》;
4、《上投摩根开放式基金业务规则》;
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。

8.2存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

8.3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
二〇一五年十月二十六日

上投摩根纯债债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根纯债债券	
基金主代码	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	
报告期末基金份额总额	549,423,397.70份	
投资目标	本基金将根据对利率趋势的预判,适时规划与调整组合目标久期,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水平,以追求超过业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	目标久期管理将优化固定收益投资的安全性、收益性与流动性。本基金严格遵循投资流程,对宏观经济、财政货币政策、市场利率水平及债券发行主体的信用情况等因素进行深入研究,通过审慎预测利率期限结构的变动趋势,适时制定目标久期管理计划,通过合理的资产配置及组合目标久期管理,控制投资风险,追求可持续的、超出业绩比较基准的投资收益。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中国债券总指数。	
风险收益特征	本基金是债券型基金,在证券投资基金中属于较低风险品种,其预期风险收益水平低于股票型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	上投摩根纯债债券A	上投摩根纯债债券B
下属两级基金的交易代码	371020	371120
报告期末下属两级基金的份额总