

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日

1.1 重要提示
基金管理人承诺,本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述等,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。
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2016年3月29日编制了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证报告内容真实、准确,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金的投资业绩并不预示其未来业绩,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及更新。
本年度报告披露日前最近一个工作日,即2016年3月29日。

Table with 2 columns: 基金基本情况, 基金投资组合. Details include fund name, manager, and asset allocation.

2.1 基金基本情况
2.1.1 基金概况
基金名称:上投摩根红利添利债券证券投资基金
基金代码:000912
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Lists the management and custody entities.

2.1.2 基金的投资目标
本基金投资于具有良好流动性的资产,通过积极主动的投资策略,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

2.1.3 基金的风险收益特征
本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。

2.1.4 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证全债指数收益率。

2.1.5 基金的风险控制
基金管理人承诺严格遵守法律法规及基金合同,确保基金资产的安全,有效控制基金投资风险。

2.1.6 基金的费用
基金管理人承诺按照基金合同约定,公平、合理、及时地支付基金费用。

2.1.7 基金的信息披露
基金管理人承诺按照法律法规及基金合同,及时、准确、完整地披露基金信息。

2.1.8 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.9 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.10 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.11 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.12 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.13 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.14 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.15 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.16 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.17 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.18 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.19 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.20 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.21 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.22 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.23 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.24 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.25 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.26 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.27 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.28 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.29 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.30 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.31 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.32 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.33 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.34 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.35 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.36 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.37 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.38 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

2.1.39 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

上投摩根分红添利债券证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

证券投资基金和上投摩根体系内其他证券投资基金
4.1 基金基本情况
基金名称:上投摩根红利添利债券证券投资基金
基金代码:000912

Table with 2 columns: 基金概况, 基金投资组合. Summary of fund details and asset allocation.

注:1.任时点和任时点上期数据均以资产负债表日日期为准。
2.本报告期为基金合同生效之日。
3.本报告期为基金合同生效之日。
4.本报告期为基金合同生效之日。

4.2 基金管理人
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

4.3 基金的投资目标
本基金投资于具有良好流动性的资产,通过积极主动的投资策略,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

4.4 基金的风险收益特征
本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。

4.5 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证全债指数收益率。

4.6 基金的风险控制
基金管理人承诺严格遵守法律法规及基金合同,确保基金资产的安全,有效控制基金投资风险。

4.7 基金的费用
基金管理人承诺按照基金合同约定,公平、合理、及时地支付基金费用。

4.8 基金的信息披露
基金管理人承诺按照法律法规及基金合同,及时、准确、完整地披露基金信息。

4.9 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.10 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.11 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.12 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.13 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.14 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.15 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.16 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.17 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.18 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.19 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.20 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.21 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.22 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.23 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.24 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.25 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.26 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.27 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.28 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.29 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.30 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.31 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.32 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.33 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.34 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.35 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.36 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.37 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.38 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.39 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.40 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

4.41 基金的其他事项
基金管理人承诺遵守相关法律法规,履行基金管理人职责。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名债券投资明细

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.

8.4 报告期内国债期货投资的大意变动
8.4.1 报告期内国债期货投资的大意变动

8.4.2 报告期内国债期货投资的大意变动

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

Table with 6 columns: 序号, 股票简称, 股票代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 stock holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.4 报告期内国债期货投资的大意变动

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名债券投资明细

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.6 报告期内国债期货投资的大意变动

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

Table with 6 columns: 序号, 股票简称, 股票代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 stock holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.8 报告期内国债期货投资的大意变动

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名债券投资明细

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.10 报告期内国债期货投资的大意变动

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

Table with 6 columns: 序号, 股票简称, 股票代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 stock holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.12 报告期内国债期货投资的大意变动

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.13 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名债券投资明细

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.14 报告期内国债期货投资的大意变动

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.15 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

Table with 6 columns: 序号, 股票简称, 股票代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 stock holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.16 报告期内国债期货投资的大意变动

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.17 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名债券投资明细

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.18 报告期内国债期货投资的大意变动

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.19 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

Table with 6 columns: 序号, 股票简称, 股票代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 stock holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.20 报告期内国债期货投资的大意变动

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.

注:“买入金额”或“买入金额成本”、“卖出金额”或“卖出金额成本”均指买卖成交金额,成交均价指成交数量/成交数量。期间,不考虑相关交易费用。

8.4.21 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名债券投资明细

Table with 6 columns: 序号, 债券简称, 债券代码, 公允价值, 占净值比例. Top 10 bond holdings.