

上投摩根分红添利债券型证券投资基金

2013第四季度 报告

2013年12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：二〇一四年一月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资风险，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。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	上投摩根分红添利债券
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月25日
报告期末基金份额总额	203,082,219.01份
投资目标	在保持资产流动性及资产流动性的前提下，通过积极的投资管理，力争为投资者带来稳定的收入。
投资策略	本基金将采取自下而上的方法进行组合久期管理。综合考虑利率水平、信用利差、收益率曲线形状、通过申购赎回后的资产配置和预期的资产收益，在此基础上，适当调整与股票、债券等资产的配置比例。
业绩比较基准	中信债基综合指数。
风险收益特征	本基金属于债券型基金，属于债券型投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益低于货币市场基金。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	上投摩根分红添利债券A类
下属分级基金的交易代码	370021
报告期末下属分级基金的份额总额	89,894,920.39份
报告期末下属分级基金的份额总额	113,216,401.52份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

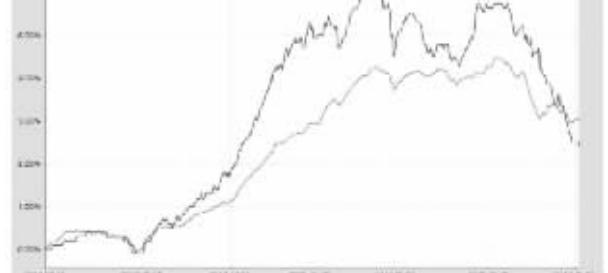
主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)	
	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1.本期已实现收益	-1,802,799.17	-2,255,236.39
2.本期利润	-4,015,232.13	-5,398,682.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0293	-0.0320
4.期末基金份额净值	87,818,925.60	110,440,473.82
5.期末基金资产净值	9,077	9,075
注:本期利润为收入减去费用后的余额,本期利润不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),即为持有人实际可支配的余额。		

3.2.1 本期利润基金净值增长率及其同同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根分红添利债券A类:	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)				
	阶段	净值增长(%)	净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	-1.08%	0.12%	-1.20%	0.06%	-1.88%
注:上投摩根分红添利债券B类:					0.06%

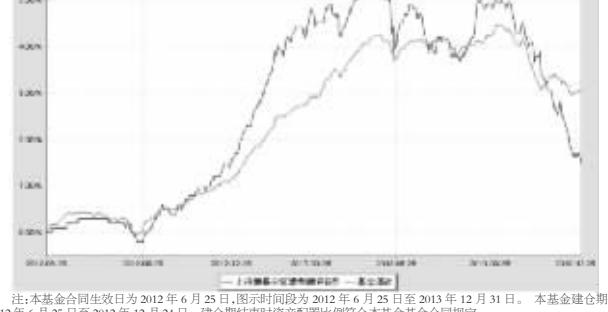
3.2.2 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月25日至2013年12月31日)



注:本基金合同期效日为2012年6月25日,计息时间段为2012年6月25日至2013年12月31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合同规定。

2 上投摩根分红添利债券B类:



注:本基金合同期效日为2012年6月25日,计息时间段为2012年6月25日至2013年12月31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合同规定。

4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介	任本基金的基金经理期限		说明
	任职日期	离任日期	
赵峰	本基金基金经理	2012-6-25	-
		11年	

注:任职日期和离任日期均指公司决定聘任和解聘日期。

*赵峰先生为本公司基金经理,其任职日期指本基金合同生效之日。

4.2 报告期内本基金暂停赎回情况说明

报告期内,基金管理人不存在因暂停基金赎回而影响基金份额持有人谋取利益。基金管理人遵守了《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金销售服务办法》、《公开募集证券投资基金销售机构公平对待投资人业务规则》的规定。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司严格执行《公开募集证券投资基金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制度的规定,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节均制定了相关的内部控制制度,并完善了相应的监察机制,确保在投资决策、交易执行、业绩评估等环节能公平对待所有客户,不存在利益输送和不公平交易行为。

4.3.2 公平交易制度执行的专项说明

报告期内,本公司严格执行《公开募集证券投资基金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制度的规定,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节均制定了相关的内部控制制度,并完善了相应的监察机制,确保在投资决策、交易执行、业绩评估等环节能公平对待所有客户,不存在利益输送和不公平交易行为。

4.4 报告期内本基金的异常交易行为专项说明

报告期内,本公司未发现本基金存在异常交易行为。

4.5 公开披露的净值偏离度情况

报告期内,本基金不存在连续二十个交易日偏离度绝对值达到百分之三的情况。

4.6 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	
	报告期初基金份额总额	报告期末基金份额总额	报告期初基金份额净值	报告期末基金份额净值
1.本期已实现收益	180,031,598.42	130,576,763.31	1.00	1.00
2.本期利润	1,371,262.98	762,363.07		
3.加权平均基金份额本期利润	91,511,505.00	18,122,728.86		
4.期末基金份额净值	89,891,920.39	113,216,401.52		

注:本基金报告期期间没有发生大额申购或赎回。

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

4.8 备查文件目录

本基金报告期期间未使用固有资金投资本基金。

4.9 其他需要说明的事项

本基金报告期期间未使用固有资金投资本基金。

4.10 报告期内基金的利润分配情况

报告期内,本公司未进行利润分配。

4.11 报告期内基金的费用情况

报告期内,本公司未发生费用。

4.12 报告期内信息披露费情况

报告期内,本公司未支付信息披露费。

4.13 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.14 其他相关费用

报告期内,本公司未发生其他相关费用。

4.15 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.16 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.17 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.18 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.19 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.20 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.21 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.22 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.23 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.24 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.25 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.26 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.27 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.28 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.29 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.30 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.31 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.32 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.33 其他费用

报告期内,本公司未发生其他费用。

4.34 其他费用