

# 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:中国建设银行股份有限公司 报告送出日期:二〇一四年一月二十一日

#### 1.1 重要提示

基金管理人及董事、监事、高级管理人员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。  
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20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。  
本报告财务资料未经审计。  
本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

#### 1.2 基金产品概况

基金简称	上投摩根分红添利债券
基金代码	570007
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	203,108,319.91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增值。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定固定久期,结合自上而下的资产配置和自下而上的精选策略,通过资产配置和行业配置,选择具有良好增长潜力的个股,并在此基础上,运用基本面分析,选择具有良好增长潜力的个股,并在此基础上,运用基本面分析,选择具有良好增长潜力的个股。
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,低于股票基金和股票型基金。
业绩比较基准	中债综合全价指数。
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
下属两级基金的名称	上投摩根分红添利债券 A 类 上投摩根分红添利债券 B 类
下属两级基金的代码	570021 570022
报告期末下属两级基金的份额总额	89,891,920.39份 113,216,401.52份

#### 1.3 主要财务指标和基金净值表现

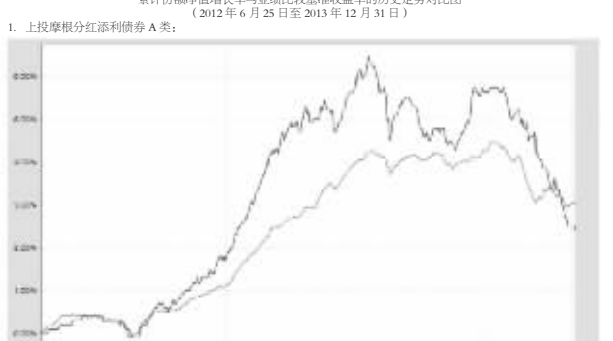
3.1 主要财务指标	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,862,799.17
2.本期利润	-4,015,232.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0203
4.期末基金资产净值	87,818,925.40
5.期末基金净值增长率	0.97%

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。  
1.2 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:

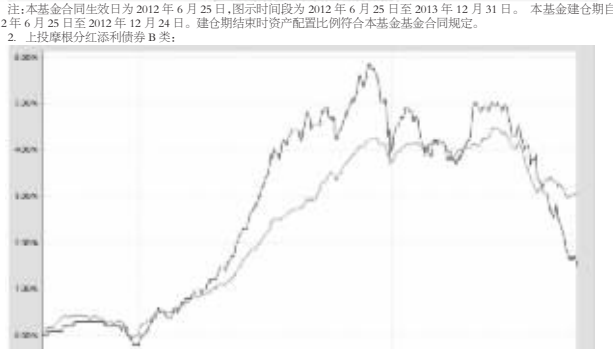
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.08%	0.12%	-1.29%	0.06%	-1.89%	0.06%

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	-3.27%	0.12%	-1.29%	0.06%	-2.07%	0.06%

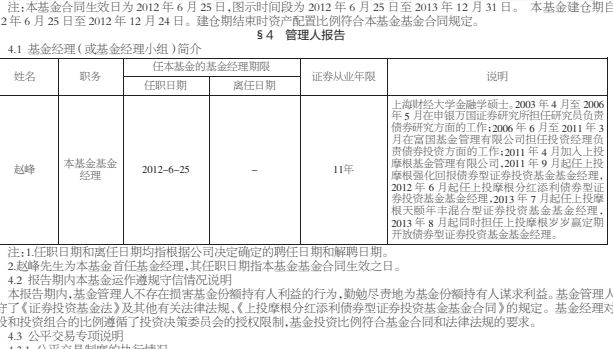
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较  
上投摩根分红添利债券型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2012年6月25日至2013年12月31日)



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2013年12月31日。本基金建仓自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2013年12月31日。本基金建仓自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。  
3. 上投摩根分红添利债券 A 类:



注:1.任职日期和离任日期均指根据基金合同规定确定的聘任日期和解聘日期。  
2.超期未获本基金重选基金管理人,其任期自指本基金基金合同生效日。  
3. 基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20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。  
本报告财务资料未经审计。  
本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

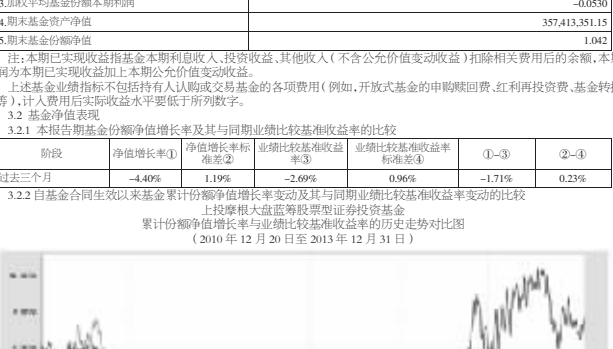
#### 1.2 基金产品概况

基金简称	上投摩根大盘蓝筹股票
基金代码	570010
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	343,009,665.97份
投资目标	通过投资大盘蓝筹股票,力争在大程度的分享中国经济快速发展带来的中长期机遇,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定固定久期,结合自上而下的资产配置和自下而上的精选策略,通过资产配置和行业配置,选择具有良好增长潜力的个股,并在此基础上,运用基本面分析,选择具有良好增长潜力的个股。
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,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品种。
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

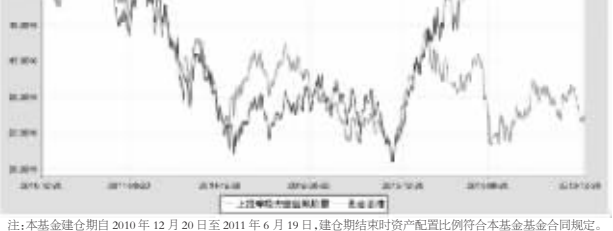
#### 1.3 主要财务指标

3.1 主要财务指标	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-34,766,371.21
2.本期利润	-20,559,239.15
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0580
4.期末基金资产净值	357,413,351.15
5.期末基金净值增长率	1.04%

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。  
1.2 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变动的比较  
(2010年12月20日至2013年12月31日)



注:本基金建仓自2010年12月20日至2011年1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。  
本基金成立以来的业绩表现如下:  
截至2010年12月20日,本基金成立以来的业绩表现如下:  
截至2010年12月20日,本基金成立以来的业绩表现如下:



注:本基金建仓自2010年12月20日至2011年1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。  
本基金成立以来的业绩表现如下:  
截至2010年12月20日,本基金成立以来的业绩表现如下:  
截至2010年12月20日,本基金成立以来的业绩表现如下:

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:二〇一四年一月二十一日

基金管理人及董事、监事、高级管理人员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。  
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20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。  
本报告财务资料未经审计。  
本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

基金简称	上投摩根智选30股票
基金代码	570027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月6日
报告期末基金份额总额	1,480,380,825.36份
投资目标	本基金主要投资于受益于中国经济转型,具有较高成长潜力的上市公司股票,在有效控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定固定久期,结合自上而下的资产配置和自下而上的精选策略,通过资产配置和行业配置,选择具有良好增长潜力的个股,并在此基础上,运用基本面分析,选择具有良好增长潜力的个股。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,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品种。
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

#### 1.3 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(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	35,805,164.67
2.本期利润	-108,087,164.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0783
4.期末基金资产净值	1,675,219,261.23
5.期末基金净值增长率	1.15%

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。  
1.2 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. 上投摩根智选30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变动的比较  
(2013年3月6日至2013年12月31日)

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	-4.78%	1.34%	-2.50%	0.09%	-4.28%	0.44%

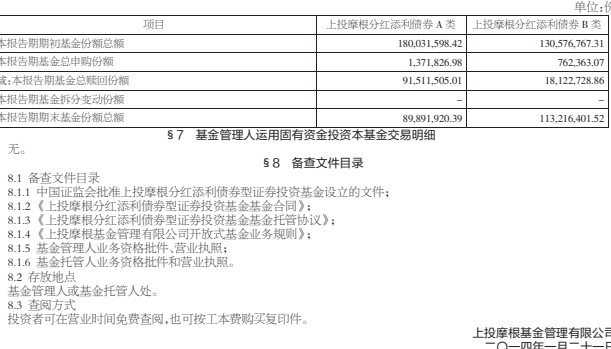
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.78%	1.34%	-2.50%	0.09%	-4.28%	0.44%



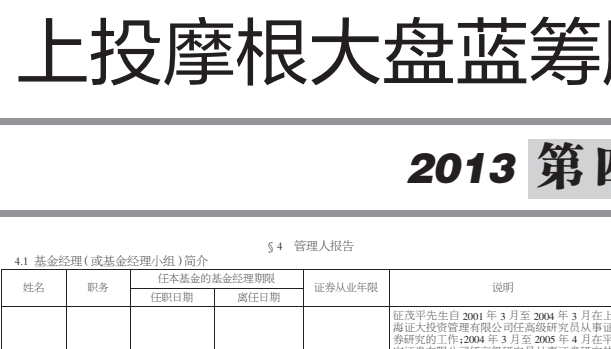
注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 A 类:



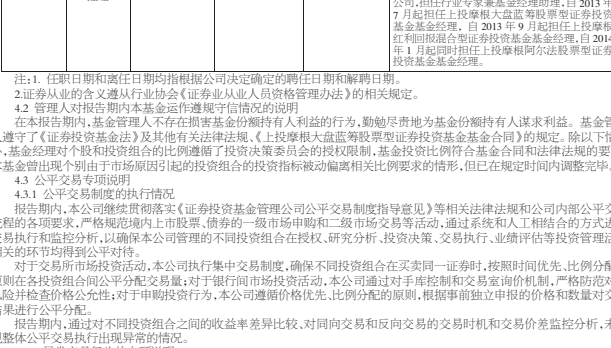
注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 B 类:



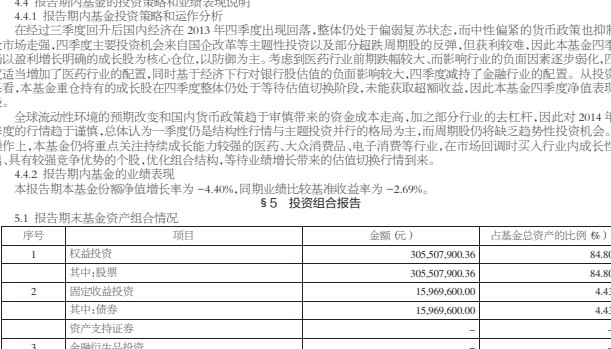
注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 A 类:



注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 B 类:



注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 A 类:



注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 B 类:

注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 A 类:

注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 B 类:

# 上投摩根智选 30 股票型证券投资基金

## 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:中国建设银行股份有限公司 报告送出日期:二〇一四年一月二十一日

#### 1.1 重要提示

基金管理人及董事、监事、高级管理人员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。  
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20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。  
本报告财务资料未经审计。  
本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

#### 1.2 基金产品概况

基金简称	上投摩根智选30股票
基金代码	570027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月6日
报告期末基金份额总额	1,480,380,825.36份
投资目标	本基金主要投资于受益于中国经济转型,具有较高成长潜力的上市公司股票,在有效控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定固定久期,结合自上而下的资产配置和自下而上的精选策略,通过资产配置和行业配置,选择具有良好增长潜力的个股,并在此基础上,运用基本面分析,选择具有良好增长潜力的个股。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,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品种。
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

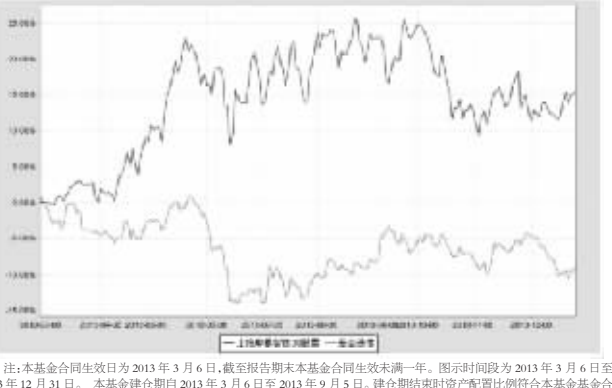
#### 1.3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	35,805,164.67
2.本期利润	-108,087,164.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0783
4.期末基金资产净值	1,675,219,261.23
5.期末基金净值增长率	1.15%

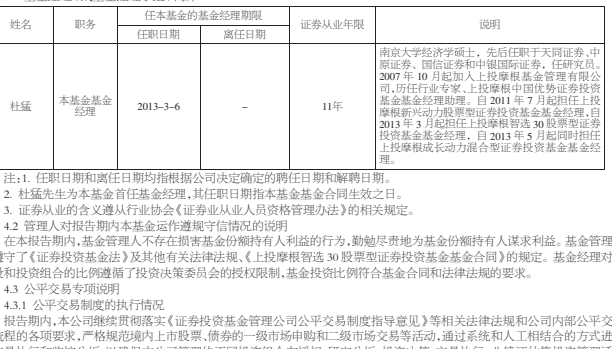
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。  
1.2 基金净值表现  
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较  
1. 上投摩根智选30股票型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较  
(2013年3月6日至2013年12月31日)

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	-4.78%	1.34%	-2.50%	0.09%	-4.28%	0.44%

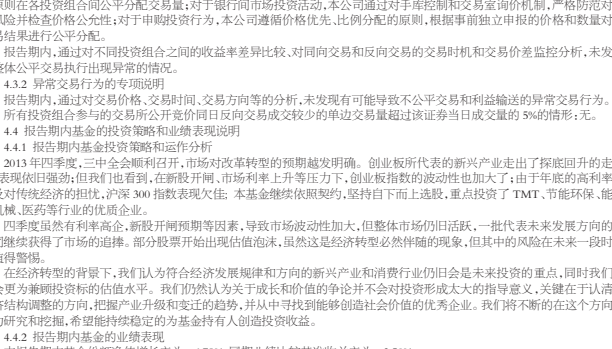
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.78%	1.34%	-2.50%	0.09%	-4.28%	0.44%



注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 A 类:



注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 B 类:



注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 A 类:



注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 B 类:



注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 A 类:



注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 B 类:

注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 A 类:

注:本基金合同生效日为2013年3月6日,截至报告期末本基金生效未满一年。图示时间段为2013年3月6日至2013年12月31日。本基金建仓自2013年3月6日至2013年9月5日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。  
3. 上投摩根智选30股票 B 类:

### 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:二〇一四年一月二十一日

#### 1.1 重要提示

基金管理人及董事、监事、高级管理人员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。  
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20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。  
本报告财务资料未经审计。  
本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

基金简称	上投摩根智选30股票
基金代码	570027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月6日
报告期末基金份额总额	1,480,380,825.36份
投资目标	本基金主要投资于受益于中国经济转型,具有较高成长潜力的上市公司股票,在有效控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定固定久期,结合自上而下的资产配置和自下而上的精选策略,通过资产配置和行业配置,选择具有良好增长潜力的个股,并在此基础上,运用基本面分析,选择具有良好增长潜力的个股。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,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品种。
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

#### 1.3 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(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	35,805,164.67
2.本期利润	-108,087,164.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0783
4.期末基金资产净值	1,675,219,261.23
5.期末基金净值增长率	1.15%

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。  
1.2 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. 上投摩根智选30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变动的比较  
(2013年3月6日至2013年12月31日)