

## 上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金

## [2013] 第四季度报告

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：2014年1月21日

重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及基金经理等人员声明不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带责任。

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未来表现。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。

报告期末基金份额总额

300,358,361.80份

投资目标

在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值，力争为投资者提供稳定的收益分红。

1. 资产配置策略：基金管理人将采用严格的仓位控制策略，根据基金单位净值的变化和对未来的市场判断，灵活控制股票仓位，控制下行风险。具体而言，本基金将每一个会计年度作为仓位调整的基准周期，以一年度末的基金单位净值为基准，根据基金净值增长率与基准净值之差，动态调整组合比例。

2. 价值投资策略：本基金将在控制市场风险和流动性风险的前提下，根据对政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，结合不同债券品种的到期收益率、流动性、市场规模情况、关注久期策略、期限结构配置策略、信用债策略、可转债策略等多种投资策略，实施积极主动的组合管理，精选具有较高收益水平的券种形态，息差变化的预期，对债券组合进行动态调整。

3. 股票投资策略：本基金将利用自下而上的分析方法，以企业基本面研究为核心，并结合股票价值评估，精选具有较强竞争优势且估值合理的股票构建投资组合。

业绩比较基准

一年期银行定期存款利率(税后)+1%

风险收益特征

本基金属于混合型基金产品，预期风险和收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中等风险收益水平的基本型产品。

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

5.3 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 -817,085.99

2.本期利润 -3,029,447.27

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0086

4.期末基金份额净值 299,550,650.81

5.期末基金份额净值 0.997

注：本基金实现的盈余公积收入、利息收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

余额为零，未实现的盈余公积收入加上本期公允价值变动收益。

本基金的管理费由基金管理人从基金财产中计提，并按季支付给基金管理人。

3.2 基金净值表现

5.4 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 现值增长 现值增长 现值增长 现值增长 现值增长

率(%) 标准差(%) 收益率(%) 标准差(%) 收益率(%) 标准差(%)

(1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.89% 0.13% 1.02% 0.01% -1.91% 0.12%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计份额增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3 报告期内天颐年丰混合型证券投资基金的走势对比图

(2013年7月18日至2013年12月31日)

注：本基金合同生效日为2013年7月18日，截至报告期末本基金合同尚未满一年。

本基金在报告期内处于建仓期内。

5.4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名 职务 任职日期 证券从业年限 说明

赵峰 本基金基金经理 2013-7-18 - 11年

1. 上海财经大学金融学硕士，2003年4月至2006年5月在申万宏源证券有限公司研究所任研究员；负责债券研究工作；2006年5月至2008年1月在申万宏源证券有限公司研究所任债券研究员；2008年1月至2010年4月在申万宏源证券有限公司研究所任债券研究员；2010年4月至2011年1月在申万宏源证券有限公司研究所任债券研究员；2011年1月至2013年7月在申万宏源证券有限公司研究所任债券研究员；2013年7月18日起任上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金经理。

2. 楠信正和赵峰均为本基金基金经理，其任职期间本基金合同尚在合同期内。

3. 证券投资从业人员应当遵守《证券投资基金销售人员执业行为规范》。

4. 代理人对报告期内基金运作的监督情况

5. 公平交易制度的执行情况

6. 报告期内基金经理因行业轮换进行股票买卖的情况

7. 公平交易制度的执行情况

8. 公平交易制度的执行情况

9. 公平交易制度的执行情况

10. 公平交易制度的执行情况

11. 公平交易制度的执行情况

12. 公平交易制度的执行情况

13. 公平交易制度的执行情况

14. 公平交易制度的执行情况

15. 公平交易制度的执行情况

16. 公平交易制度的执行情况

17. 公平交易制度的执行情况

18. 公平交易制度的执行情况

19. 公平交易制度的执行情况

20. 公平交易制度的执行情况

21. 公平交易制度的执行情况

22. 公平交易制度的执行情况

23. 公平交易制度的执行情况

24. 公平交易制度的执行情况

25. 公平交易制度的执行情况

26. 公平交易制度的执行情况

27. 公平交易制度的执行情况

28. 公平交易制度的执行情况

29. 公平交易制度的执行情况

30. 公平交易制度的执行情况

31. 公平交易制度的执行情况

32. 公平交易制度的执行情况

33. 公平交易制度的执行情况

34. 公平交易制度的执行情况

35. 公平交易制度的执行情况

36. 公平交易制度的执行情况

37. 公平交易制度的执行情况

38. 公平交易制度的执行情况

39. 公平交易制度的执行情况

40. 公平交易制度的执行情况

41. 公平交易制度的执行情况

42. 公平交易制度的执行情况

43. 公平交易制度的执行情况

44. 公平交易制度的执行情况

45. 公平交易制度的执行情况

46. 公平交易制度的执行情况

47. 公平交易制度的执行情况

48. 公平交易制度的执行情况

49. 公平交易制度的执行情况

50. 公平交易制度的执行情况

51. 公平交易制度的执行情况

52. 公平交易制度的执行情况

53. 公平交易制度的执行情况

54. 公平交易制度的执行情况

55. 投资组合报告

56. 报告期末基金资产组合情况

57. 上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金的走势对比图

(2013年1月28日至2013年12月31日)

注：本基金建仓期自2010年1月28日至2010年7月1日，进入正常运作的资产配置比例符合本基金合同规定。本基金合同生效日为2010年1月28日，即视为报告期末本基金合同生效之日起六个月内。

5.4 管理人报告

5.5 备查文件目录

5.6 报告期内基金所获荣誉及奖项情况

5.7 基金管理人承诺函

5.8 备查文件目录

5.9 报告期内基金评价情况

5.10 报告期内基金报备情况

5.11 报告期内基金销售情况

5.12 报告期内基金投资策略

5.13 报告期内基金估值政策

5.14 报告期内基金费用计提、开支及返还情况

5.15 报告期内基金收益分配情况

5.16 报告期内基金费用调整情况

5.17 报告期内基金上市交易情况

5.18 报告期内基金份额持有人数及持有人结构

5.19 报告期内基金份额前十名持有人情况

5.20 报告期内基金投资组合报告

5.21 报告期内基金资产支持证券投资组合报告

5.22 报告期内基金融资融券业务开展情况

5.23 报告期内基金参与转融通业务情况

5.24 报告期内基金参与沪股通情况

5.25 报告期内基金参与深股通情况

5.26 报告期内基金参与沪港通情况

5.27 报告期内基金参与港股通情况

5.28 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票定向发行情况

5.29 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票协议转让情况

5.30 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票司法强制执行情况

5.31 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票大宗交易情况

5.32 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票质押式回购交易情况

5.33 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票融资融券交易情况

5.34 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票期权交易情况

5.35 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票转板上市情况

5.36 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票协议转让退出情况

5.37 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票司法强制执行退出情况

5.38 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票大宗交易退出情况

5.39 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票质押式回购退出情况

5.40 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票融资融券退出情况

5.41 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票期权退出情况

5.42 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票转板上市退出情况

5.43 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票协议转让退出情况

5.44 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票司法强制执行退出情况

5.45 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票大宗交易退出情况

5.46 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票质押式回购退出情况

5.47 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票融资融券退出情况

5.48 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票期权退出情况

5.49 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票转板上市退出情况

5.50 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票协议转让退出情况

5.51 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票司法强制执行退出情况

5.52 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票大宗交易退出情况

5.53 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票质押式回购退出情况

5.54 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票融资融券退出情况

5.55 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票期权退出情况

5.56 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票转板上市退出情况

5.57 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票协议转让退出情况

5.58 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票司法强制执行退出情况

5.59 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票大宗交易退出情况

5.60 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票质押式回购退出情况

5.61 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票融资融券退出情况

5.62 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票期权退出情况

5.63 报告期内基金参与新三板挂牌公司股票转板上市退出情况