

上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金

[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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21日

基金管理人的董事会及监事会在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、完整性承担个别及连带责任。

基金合同生效日:2013年8月28日

基金合同有效期限:2013年8月28日至2014年8月27日

基金管理人承诺不以低于成本价销售基金，但不承诺基金一定盈利。

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。

本报告书中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§ 1 基金产品概况

基金简称:上投摩根岁岁盈定期开放债券

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2013年8月28日

报告期基金份额总额:676,507,904.92份

投资目标:在合理充分的量力分析及定性研究基础上，在风险可控的原则下，通过固定收益类资产的的投资封闭运作，力争获取超越基准的稳健收益。

投资策略:1.债券类资产配置策略

本基金将对不同类型的固定收益品种的信用风险、利率水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，评估不同债券板块之间的相对投资价值，确定债券类资产配置策略，并根据市场变化及时进行调整。

2.久期管理策略

本基金通过影响债券投资的宏观经济变量和宏观经济政策等因素的综合分析，预测未来的市场利率的变动趋势，判断债券市场对上述因素及其变化的反应，并据此积极调整债券组合的久期。

3.收益曲线策略

本基金将通过分析不同期限的收益率曲线的斜率变化策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合，并进行动态调整。

4.信用策略

本基金将运用内部信用评级体系对债券发行人及其发行的债券进行信用评级，并结合外部评级机构的信用评级，分析违约风险以及信用利差，判断债券的投资价值，谨慎选择债券发行人和债券品种，以降低信用风险的投资信用票选进行投资。

5.投资组合报告

报告期期末本基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 - -

2 固定收益投资 723,661,891.01 78.59

3 资产支持证券 - -

4 买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算准备金合计 182,703,572.54 19.84

6 其他资产 14,480,662.65 1.57

7 合计 920,846,126.20 100.00

注:截至2013年12月31日,上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金资产净值为669,326,105.57元,上投摩根岁岁盈基金的份额净值为0.990元,累计基金份额净值为0.989元。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金未按行业分类的股票投资组合

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

本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金未持有债券品种的债券投资组合。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本项为本期实现的利息收入、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,系指本基金在本期实现的公允价值变动收益。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投费、基金转换费等),计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

5.6 报告期各基金简称

上投摩根岁岁盈定期开放债券A 上投摩根岁岁盈定期开放债券C

上投摩根岁岁盈定期开放债券代码 000257

报告期各基金简称的份额总额 656,605,187.08份 19,902,087.84份

5.7 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

报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

主要财务指标 上投摩根岁岁盈定期开放债券A 上投摩根岁岁盈定期开放债券C

1.本期已实现收益 7,360,911.20元 202,940.73元

2.本期利润 -7,211,285.52 -238,352.65

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0110 -0.0120

4.期末基金资产净值 650,146,777.58 19,679,331.99

5.期末基金份额净值 0.990 0.989

注:本项为本期实现的利息收入、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,系指本基金在本期实现的公允价值变动收益。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投费、基金转换费等),计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

5.8 报告期各基金简称

上投摩根岁岁盈定期开放债券A 上投摩根岁岁盈定期开放债券C

上投摩根岁岁盈定期开放债券代码 000257

报告期各基金简称的份额总额 656,605,187.08份 19,902,087.84份

5.9 主要财务指标和基金净值表现

3.2 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

主要财务指标 上投摩根岁岁盈定期开放债券A 上投摩根岁岁盈定期开放债券C

1.本期已实现收益 7,360,911.20元 202,940.73元

2.本期利润 -7,211,285.52 -238,352.65

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0110 -0.0120

4.期末基金资产净值 650,146,777.58 19,679,331.99

5.期末基金份额净值 0.990 0.989

注:本项为本期实现的利息收入、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,系指本基金在本期实现的公允价值变动收益。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投费、基金转换费等),计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

5.10 报告期各基金简称

上投摩根岁岁盈定期开放债券A 上投摩根岁岁盈定期开放债券C

上投摩根岁岁盈定期开放债券代码 000257

报告期各基金简称的份额总额 656,605,187.08份 19,902,087.84份

5.11 管理人报告

4.1 基金管理人简介

姓名 职务 任本基金的基金经理(基金类型) 证券从业年限 说明

赵峰 本基金基金经理 2013-8-28 - 11年 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,负责债券研究工作;2006年6月至2011年3月在申银万国基金管理有限公司担任研究员,负责债券研究工作;2011年5月加入上投摩根基金管理有限公司,担任基金经理,负责债券研究工作;2012年1月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,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。

4.2 管理人对报告期内基金运作的总体评价

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.4 管理人对基金估值方法的说明

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.6 管理人对基金投资组合的分析

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.7 管理人对基金业绩的评价

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.8 管理人对基金未来投资运作的展望

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.9 管理人对基金估值方法的说明

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.10 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.11 管理人对基金投资组合的分析

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.12 管理人对基金业绩的评价

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.13 管理人对基金未来投资运作的展望

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.14 管理人对基金估值方法的说明

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.15 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.16 管理人对基金投资组合的分析

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.17 管理人对基金业绩的评价

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.18 管理人对基金未来投资运作的展望

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.19 管理人对基金估值方法的说明

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.20 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.21 管理人对基金投资组合的分析

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.22 管理人对基金业绩的评价

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.23 管理人对基金未来投资运作的展望

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.24 管理人对基金估值方法的说明

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.25 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.26 管理人对基金投资组合的分析

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.27 管理人对基金业绩的评价

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.28 管理人对基金未来投资运作的展望

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.29 管理人对基金估值方法的说明

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.30 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.31 管理人对基金投资组合的分析

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.32 管理人对基金业绩的评价

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.33 管理人对基金未来投资运作的展望

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.34 管理人对基金估值方法的说明

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.35 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.36 管理人对基金投资组合的分析

本基金在报告期内运作平稳,实现了投资收益与风险的平衡,较好地完成了投资目标。

4.37 管理人对基金业绩的评价