

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  
报告期天数：120—2014年7月21日

§1重要提示  
基金管理人和基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏，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。  
本基金经中国证监会于2014年1月17日核准。《基金合同》在本基金报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，仅供投资者参考，投资者欲了解详细情况，请仔细阅读《基金合同》、《招募说明书》、《基金产品资料概要》。  
报告书中财务数据未经审计。

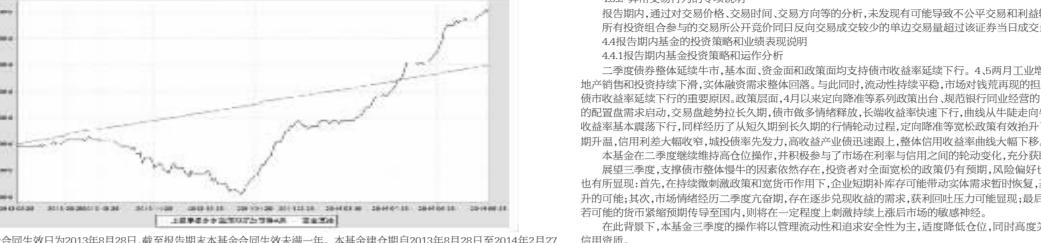
报告期天数：2014年4月1日起至6月30日止。

§2基金产品概况

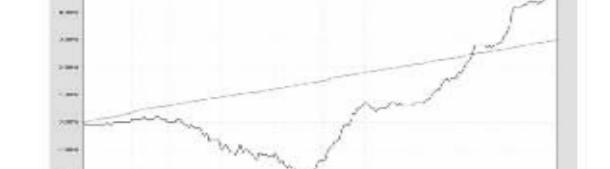
基金名称	上投摩根岁岁盈定期开放债券
基金合同生效方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月28日
报告期末基金资产总额	676,507,940.00
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过参与定期收益类资产的投资实现收益。

## 上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金

### 2014 第二季度报告



注：本基金合同期生效日为2013年8月28日，截至报告期末基金合同尚未满一年。本基金建仓期自2013年8月28日至2014年2月27日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。



注：本基金合同期生效日为2013年8月28日，截至报告期末基金合同尚未满一年。本基金建仓期自2013年8月28日至2014年2月27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主要财务指标

报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)	
上投摩根岁岁盈定期开放债券	上投摩根岁岁盈定期开放债券C
1.本期已实现收益	12,068,962.77
2.本期利润	26,564,483.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.0405
4.期末基金资产净值	689,114,428.56
5.期末基金份额净值	1.000

注：本基金在申购时收取申购费，赎回时收取赎回费，其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为期末已实现收益加上本期利润。本期利润不包括持有人申购或赎回时产生的申购费和赎回费。

本基金在申购时不存在申购费，赎回时不存在赎回费。

本基金在申购时并不代表买卖基金，投资者风险，投资者在申购或赎回时应仔细阅读本基金的招募说明书。

报告期天数：2014年4月1日起至6月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	上投摩根岁岁盈定期开放债券
基金合同生效方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月28日
报告期末基金资产总额	932,324,479.00
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过参与定期收益类资产的投资实现收益。

## 上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金

### 2014 第二季度报告



注：本基金合同期生效日为2013年8月28日，截至报告期末基金合同尚未满一年。本基金建仓期自2013年8月28日至2014年2月27日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

注：本基金合同期生效日为2013年8月28日，截至报告期末基金合同尚未满一年。本基金建仓期自2013年8月28日至2014年2月27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主要财务指标

报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)	
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	63,374.93
2.本期利润	774,019.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.0314
4.期末基金资产净值	17,781,389.39
5.期末基金份额净值	1.048

注：本基金在申购时收取申购费，赎回时收取赎回费，其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为期末已实现收益加上本期利润。本期利润不包括持有人申购或赎回时产生的申购费和赎回费。

本基金在申购时不存在申购费，赎回时不存在赎回费。

本基金在申购时并不代表买卖基金，投资者风险，投资者在申购或赎回时应仔细阅读本基金的招募说明书。

报告期天数：2014年4月1日起至6月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	上投摩根岁岁盈定期开放债券
基金合同生效方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月28日
报告期末基金资产总额	932,324,479.00
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过参与定期收益类资产的投资实现收益。



注：本基金合同期生效日为2013年8月28日，截至报告期末基金合同尚未满一年。本基金建仓期自2013年8月28日至2014年2月27日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

注：本基金合同期生效日为2013年8月28日，截至报告期末基金合同尚未满一年。本基金建仓期自2013年8月28日至2014年2月27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主要财务指标

报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)	
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	-11,490,774.85
2.本期利润	79,411,414.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0262
4.期末基金资产净值	3,363,310,455.13
5.期末基金份额净值	0.9586

注：本基金在申购时收取申购费，赎回时收取赎回费，其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为期末已实现收益加上本期利润。本期利润不包括持有人申购或赎回时产生的申购费和赎回费。

本基金在申购时不存在申购费，赎回时不存在赎回费。

本基金在申购时并不代表买卖基金，投资者风险，投资者在申购或赎回时应仔细阅读本基金的招募说明书。

报告期天数：2014年4月1日起至6月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	上投摩根岁岁盈定期开放债券
基金合同生效方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月28日
报告期末基金资产总额	3,363,310,455.13
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过参与定期收益类资产的投资实现收益。



注：本基金建仓期自2006年4月20日至2006年10月25日，合同期限内资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金的12月1日起，将基金业绩基准由“中国国债指数收益率+4%”调整为“中国国债指数收益率+4%\*同业存款利率\*10%”，即更改为“中国国债指数收益率+4%\*0.04\*0.1\*10%”。

§3主要财务指标

报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)	
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	-11,490,774.85
2.本期利润	79,411,414.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0262
4.期末基金资产净值	3,363,310,455.13
5.期末基金份额净值	0.9586

注：本基金建仓期自2006年4月20日至2006年10月25日，合同期限内资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金的12月1日起，将基金业绩基准由“中国国债指数收益率+4%”调整为“中国国债指数收益率+4%\*同业存款利率\*10%”，即更改为“中国国债指数收益率+4%\*0.04\*0.1\*10%”。

报告期天数：2014年4月1日起至6月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	上投摩根岁岁盈定期开放债券
基金合同生效方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月28日
报告期末基金资产总额	3,363,310,455.13
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过参与定期收益类资产的投资实现收益。



注：本基金建仓期自2006年4月20日至2006年10月25日，合同期限内资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金的12月1日起，将基金业绩基准由“中国国债指数收益率+4%”调整为“中国国债指数收益率+4%\*同业存款利率\*10%”，即更改为“中国国债指数收益率+4%\*0.04\*0.1\*10%”。

§3主要财务指标

报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)	
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	-11,490,774.85
2.本期利润	79,411,414.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0262
4.期末基金资产净值	3,363,310,455.13
5.期末基金份额净值	0.9586

注：本基金建仓期自2006年4月20日至2006年10月25日，合同期限内资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金的12月1日起，将基金业绩基准由“中国国债指数收益率+4%”调整为“中国国债指数收益率+4%\*同业存款利率\*10%”，即更改为“中国国债指数收益率+4%\*0.04\*0.1\*10%”。

报告期天数：2014年4月1日起至6月30日止。