上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金

2015 年度报告摘要

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:二〇一六年三月三十日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2016年3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	上投摩根岁岁盈定期开放债券			
基金主代码	000257			
交易代码	000257			
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			
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			
报告期末基金份额总额	674,406,515.23份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	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B	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D
下属分级基金的交易代码	000257	000765	000258	000766
报告期末下属分级基金的份额总额	322,426,259.72份	341,485,750.56份	4,387,562.84份	6,105,942.11份

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理充分的定量分析及定性研究基础上,在风险可控的原则下,通过参与固定收益类资产的投资封闭运作,力争获取超越基准的稳健回报。
投资策略	1.债券类属配置策略 本基金将对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、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,确定债券类属配置策略,并根据市场变化及时进行调整。 2.久期管理策略 本基金通过对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,并据此影响调整债券组合的久期。 3.收益率曲线策略 本基金在确定固定收益资产组合平均久期的基础上,将结合收益率曲线变化的预测,适时采用跟踪收益率曲线的骑乘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 本基金将利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估,并结合外部评级机构的信用评级,分析违约风险以及合理信用利差水平,判断债券的投资价值,谨慎选择债券发行人基本面良好、债券条款优惠的信用债进行投资。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)+0.5%
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,低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上投摩根基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡迪	汤嵩彦
	联系电话	021-38794888	96559
	电子邮箱	services@cifm.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400-889-4888	96559
传真		021-20628400	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cifm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

1. 上投摩根岁岁盈定期开放债券A:

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	2015年	2014年	2013年8月28日(基金合同生效日)至2013年12月31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A	上投摩根岁岁盈定期开放债券A
本期已实现收益	14,564,361.90	37,247,730.16	9,150,179.06
本期利润	16,301,764.78	52,289,679.75	-6,459,039.50
加权平均基金份额本期利润	0.0649	0.1024	-0.0098
本期基金份额净值增长率	6.87%	9.63%	-1.00%
3.1.2期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
	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A	上投摩根岁岁盈定期开放债券A
期末可供分配基金份额利润	0.0266	0.0303	-0.0098
期末基金资产净值	332,788,624.07	218,424,714.57	650,146,777.58
期末基金份额净值	1.032	1.030	0.990

2. 上投摩根岁岁盈定期开放债券B:

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	2015年	2014年	2013年8月28日(基金合同生效日)至2013年12月31日
	上投摩根岁岁盈定期开放债券B	上投摩根岁岁盈定期开放债券B	上投摩根岁岁盈定期开放债券B
本期已实现收益	18,357,533.03	6,130,478.85	-
本期利润	20,507,031.65	5,659,581.79	-
加权平均基金份额本期利润	0.0690	0.0219	-
本期基金份额净值增长率	7.08%	2.18%	-
3.1.2期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
	上投摩根岁岁盈定期开放债券B	上投摩根岁岁盈定期开放债券B	上投摩根岁岁盈定期开放债券B
期末可供分配基金份额利润	0.0286	0.0298	-
期末基金资产净值	353,046,299.81	303,473,923.59	-
期末基金份额净值	1.034	1.030	-

3. 上投摩根岁岁盈定期开放债券C:

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	2015年	2014年	2013年8月28日(基金合同生效日)至2013年12月31日
	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C	上投摩根岁岁盈定期开放债券C
本期已实现收益	160,985.73	980,669.86	249,969.34
本期利润	182,937.94	1,441,210.36	-222,755.85
加权平均基金份额本期利润	0.0553	0.1015	-0.0112
本期基金份额净值增长率	6.38%	9.32%	-1.10%
3.1.2期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
	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C	上投摩根岁岁盈定期开放债券C
期末可供分配基金份额利润	0.0246	0.0296	-0.0112
期末基金资产净值	4,520,094.68	2,539,185.74	19,679,331.99
期末基金份额净值	1.030	1.030	0.989

4. 上投摩根岁岁盈定期开放债券D:

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	2015年	2014年	2013年8月28日(基金合同生效日)至2013年12月31日
	上投摩根岁岁盈定期开放债券D	上投摩根岁岁盈定期开放债券D	上投摩根岁岁盈定期开放债券D
本期已实现收益	541,624.34	200,943.78	-
本期利润	604,748.58	185,426.46	-
加权平均基金份额本期利润	0.0694	0.0194	-
本期基金份额净值增长率	6.79%	1.99%	-
3.1.2期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
	上投摩根岁岁盈定期开放债券D	上投摩根岁岁盈定期开放债券D	上投摩根岁岁盈定期开放债券D
期末可供分配基金份额利润	0.0263	0.0274	-
期末基金资产净值	6,298,268.63	10,543,273.09	-
期末基金份额净值	1.031	1.027	-

注:1. 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。

2. 上述基金业绩指标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),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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. 上投摩根岁岁盈定期开放债券A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.18%	0.07%	0.58%	0.01%	0.60%	0.06%
过去六个月	2.30%	0.06%	1.45%	0.01%	0.85%	0.05%
过去一年	6.87%	0.07%	3.21%	0.01%	3.66%	0.06%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	15.99%	0.12%	7.98%	0.01%	8.01%	0.11%

2. 上投摩根岁岁盈定期开放债券B:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.17%	0.07%	0.58%	0.01%	0.59%	0.06%
过去六个月	2.60%	0.06%	1.45%	0.01%	1.15%	0.05%
过去一年	7.08%	0.07%	3.21%	0.01%	3.87%	0.06%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	9.42%	0.13%	4.42%	0.01%	5.00%	0.12%

3. 上投摩根岁岁盈定期开放债券C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.08%	0.06%	0.58%	0.01%	0.50%	0.05%
过去六个月	2.02%	0.05%	1.45%	0.01%	0.57%	0.04%
过去一年	6.38%	0.06%	3.21%	0.01%	3.17%	0.05%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	15.02%	0.12%	7.98%	0.01%	7.04%	0.11%

4. 上投摩根岁岁盈定期开放债券D:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.98%	0.07%	0.58%	0.01%	0.40%	0.06%
过去六个月	2.50%	0.07%	1.45%	0.01%	1.05%	0.06%
过去一年	6.79%	0.07%	3.21%	0.01%	3.58%	0.06%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.91%	0.13%	4.42%	0.01%	4.49%	0.12%

注:本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)+0.5%

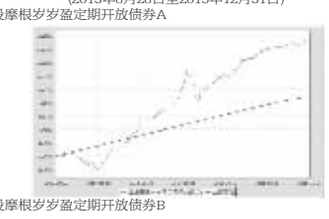
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金

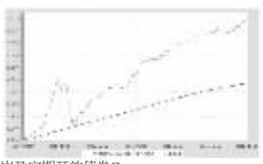
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年8月28日至2015年12月31日)

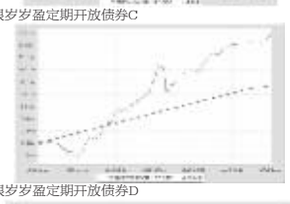
1、上投摩根岁岁盈定期开放债券A



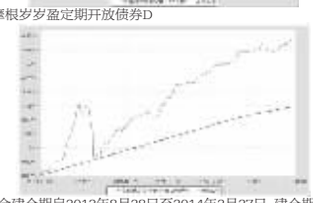
2、上投摩根岁岁盈定期开放债券B



3、上投摩根岁岁盈定期开放债券C



4、上投摩根岁岁盈定期开放债券D



注: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。

本基金AC类份额生效日为2013年8月28日,图示时间段为2013年8月28日至2015年12月31日。

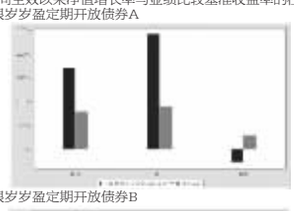
本基金BD类份额生效日为2014年8月29日,图示时间段为2014年8月29日至2015年12月31日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

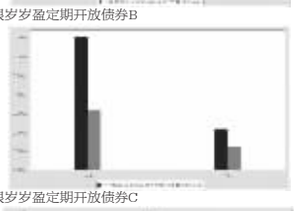
上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

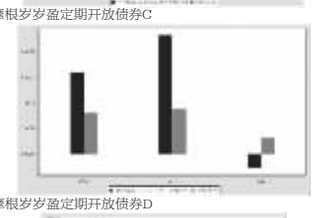
1、上投摩根岁岁盈定期开放债券A



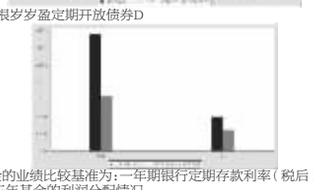
2、上投摩根岁岁盈定期开放债券B



3、上投摩根岁岁盈定期开放债券C



4、上投摩根岁岁盈定期开放债券D



注:本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)+0.5%

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、上投摩根岁岁盈定期开放债券A:

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	0.680	32,489,905.20	1,929,235.47	34,419,140.67	-
2014	0.540	33,730,810.13	1,725,904.27	35,456,714.40	-
2013	-	-	-	-	-
合计	1.220	66,220,715.33	3,655,139.74	69,875,855.07	-

3、上投摩根岁岁盈定期开放债券C:

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	0.650	797,453.84	27,409.00	824,862.84	-
2014	0.500	973,343.88	21,760.51	995,104.39	-
2013	-	-	-	-	-
合计	1.150	1,770,797.72	49,169.51	1,819,967.23	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准,于2004年5月12日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司(2007年10月8日更名为"上海国际信托有限公司")与摩根资产管理(英国)有限公司合资设立,注册资本为2.5亿元人民币,注册地上海。截至2015年12月底,公司管理的基金共有四十七只,均为开放式基金,分别是:上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根阿尔法混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋混合型证券投资基金、上投摩根内需动力混合型证券投资基金、上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘混合型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金、上投摩根分红添利债券型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选混合型证券投资基金、上投摩根轮动添利债券型证券投资基金、上投摩根智选30混合型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金、上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金、上投摩根红利回报混合型证券投资基金、上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根优信增利债券型证券投资基金、上投摩根现金管理货币市场基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添益货币市场基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根纯债添利债券型证券投资基金、上投摩根稳进回报混合型证券投资基金、上投摩根安全战略股票型证券投资基金、上投摩根卓越制造股票型证券投资基金、上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置证券投资基金、上投摩根智慧互联股票型证券投资基金、上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根新兴服务股票型证券投资基金、上投摩根医疗健康股票型证券投资基金和上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵峰	本基金基金经理、债券投资部总监	2013-08-28	2015-11-20	13年	上海财经大学金融学硕士。2003年4月至2006年5月在中银万国证券研究所担任研究员负责债券研究方面的工作;2006年6月至2011年3月在富国基金管理有限公司担任投资经理负责债券投资方面的工作;2011年4月加入上投摩根基金管理有限公司,2011年9月至2014年12月担任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理,2012年6月起任上投摩根分红添利债券型证券投资基金基金经理,2013年7月至2014年12月担任上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金经理,2013年8月至2015年11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,自2014年6月起任上投摩根优信增利债券型证券投资基金基金经理,自2014年12月起同时担任上投摩根纯债添利债券型证券投资基金基金经理。
唐璐	本基金基金经理	2015-05-19	-	8年	英国爱丁堡大学硕士,2008年2月至2010年4月任JPMorgan (JMEA)分析师,2011年3月加入上投摩根基金管理有限公司,先后担任研究员及基金经理助理,自2015年5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,自2015年12月起同时担任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.赵峰先生为本基金首任基金经理,其任职日期指本基金合同生效之日。

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

本报告期内中国证监会上海监管局对公司进行了常规全面现场检查,就公司内部控制提出了相应改进意见并采取责令改正的行政监管措施,公司已经按照要求完成了改进工作。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求,制订了《上投摩根基金管理有限公司公平交易制度》,规范了公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动,同时涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节,以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

公司执行自上而下的三级授权体系,依次为投资决策委员会、投资总监、经理人,经理人在其授权范围内自主决策,投资决策委员会和投资总监均不得干预其授权范围内的投资活动。公司已建立客观的研究方法,严禁利用内幕信息作为投资依据,各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立集中交易制度,执行公平交易分配。对于交易所市场投资活动,不同投资组合在买卖同一证券时,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易机会;对于银行间市场投资活动,通过交易对手库控制和交易室询价机制,严格防范交易对手风险并抽检价格公允性;对于一级市场申购投资行为,遵循价格优先、比例分配的原则,根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

公司制订了《异常交易监控与报告制度》,通过系统和人工相结合的方式进行投资交易行为的监控分析,并执行异常交易行为监控分析记录工作机制,确保公平交易可稽核。公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析,并留存报告备查。

4.3.2公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行上述公平交易制度和控制方法,开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的收益率差异、以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易时机和交易价差等方面的监控分析,公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

其中,在同向交易的监控和分析方面,根据法规要求,公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控,通过定期抽查前述的同向交易行为,定性分析交易时机、对比不同投资组合长期的交易趋势,重点关注任何可能导致不公平交易的情形,对于识别的异常情况,由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释。同时,公司根据法规的要求,通过系统模块定期对连续四个季度内不同投资组合在不同时间窗内(日内、3日内、5日内)的同向交易价差进行分析,采用概率统计方法,主要关注不同投资组合之间同向交易价差均值为零的显著性检验,以及同向交易价格占优的交易次数占比分析。

报告期内,通过前述分析方法,未发现不同投资组合之间同向交易价差异常的情况。

4.3.3异常交易行为的专项说明

报告期内,通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析,公司未发现存在异常交易行为。

报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形:报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为两次,均发生在纯量化投资组合与主动管理投资组合之间。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年的债券牛市是2014年以来债牛周期的一个组成部分。这一轮债券牛市产生于我国经济周期步入发展的新常态时期,并处于增速换挡、结构调整、政策消化"三期叠加"的特定阶段。如果说2014年的牛市动力更多的来源于前期的超调和经济增速换挡,那么在经历过前期政策消化之后,2015年的牛市更受益于降息降准周期的打开以及全社会风险偏好的下降。这个过程伴随着稳经济力度加大、债务置换供给增多、IPO抢升无风险利率等因素对债券市场的阶段性冲击,但在经济周期大趋势难以逆转的背景下,债市牛市趋势尚未改变。10年国债和10年国开分别从年初的3.63和4.08下降81bp、95bp至2.82和3.13。信用债在2015年呈现出分化的特点。随着经济继续下行,信用风险事件频频出现,产能过剩周期性行业与弱周期或周期平稳行业之间、中高评级和低评级债券之间,出现了明显的分化现象。中高评级债券更受市场青睐和追捧,而低资质债券的流动性相对较差、信用溢价要求更高。

本基金在运作周期内保持了较高的仓位和适度的久期,并逐步降低了低资质债券的配比,提高中高评级债券的仓位。基金在9月份打开第二个运作周期前期,主动提高组合流动性,确保了基金打开时的流动性应对;并在四季度基金封闭后快速建仓,使基金充分享受到了四季度债市收益率的下行。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A类份额净值增长率为6.87%,本基金C类基金份额净值增长率为6.38%,本报告期本基金B类份额净值增长率为7.08%,本基金D类基金份额净值增长率为6.79%,同期业绩比较基准收益率为3.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年,经济仍处于新常态的大周期中,供给侧改革力度的加大,去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板五大任务使得经济仍将在短期内处于寻底和转型的过程。货币政策在前期密集降息降准之后可能将暂时放缓,维持国内合理的流动性和利率稳定将更多依赖于定向工具和发挥利率走廊的作用。因此,债券市场的基本面环境依然向好。但我们看到美国再次加息仍有可能、M1\M2货币供给在过去四个季度呈现逐季回升的态势、汇率的波动将有所加大、部分企业在经济持续放缓过程中面临的经营困境越发严峻、债券市场利差压缩较为明显等,受这些因素影响,债券市场面临的波动也将有所加大。基于以上分析,本基金将维持中性杠杆,关注高资质信用债券的投资价值,并密切关注宏观经济环境和债市预期的变化,积极把握弹性品种的交易型机会。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责,根据相关的法律法规规定、基金合同的约定,制定了内部控制措施,对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制,目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会,并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理,所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见,评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员,参加估值委员会会议,参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金实际运作情况, 本基金以2015年08月27日为收益分配基准日,于2015年09月11日实施收益分配,A类份额每10份基金份额派发红利0.680元,C类份额每10份基金份额派发红利0.650元,合计发放红利35,244,003.51元。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2015年度,基金托管人在上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2015年度,上投摩根基金管理有限公司在上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了1次收益分配,分配金额为35,244,003.51元,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2015年度,由上投摩根基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金2015年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所审计、注册会计师陈玲、曹阳签字出具了"无保留意见的审计报告"(编号:普华永道中天审字(2016)第21353号)。投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:		-	-
银行存款	7.4.7.1	748,732.55	10,281,020.62
结算备付金		10,800,134.06	7,920,943.60
存出保证金		82,742.02	67,843.00
交易性金融资产	7.4.7.2	1,048,900,819.17	760,133,227.60
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,048,900,819.17	760,133,227.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		26,081,852.38	-
应收利息	7.4.7.5	22,315,048.00	15,940,211.81
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,108,929,328.18	794,343,256.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		389,099,650.00	253,300,000.00
应付证券清算款		22,278,965.36	5,254,542.56
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		296,373.36	235,159.91
应付托管费		117,803.06	90,900.94
应付销售服务费		3,659.37	4,446.66
应付交易费用	7.4.7.7	173,162.35	58,434.37
应交税费		-	-
应付利息		32,311.89	144,569.60
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	274,115.60	274,115.60
负债合计		412,276,040.99	259,362,169.64
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.9	674,405,515.23	519,433,822.22
未分配利润	7.4.7.10	22,247,771.96	15,547,274.77
所有者权益合计		696,653,287.19	534,981,096.99
负债和所有者权益总计		1,108,929,328.18	794,343,256.63

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额总额674,405,515.23份,其中A类份额322,426,259.72份,B类份额341,485,750.56份,C类份额4,387,562.84份,D类份额6,105,942.11份。A类份额净值1.032元,B类份额净值1.034元,C类份额净值1.030元,D类份额净值1.031元。7.2 利润表

会计主体:上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入		49,193,644.53	78,207,304.54
1.利息收入		41,815,366.27	53,654,945.71
其中:存款利息收入	7.4.7.11	596,140.57	2,264,406.32
债券利息收入		41,048,910.20	49,995,016.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		170,315.50	1,395,524.04
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		3,406,300.31	9,536,283.12
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,406,300.31	9,536,283.12
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	3,971,977.95	15,016,075.71
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	-	-
减:二、费用		11,597,161.58	18,631,406.18
1. 管理人报酬		2,993,856.12	3,642,356.69
2. 托管费		1,175,447.69	1,267,768.07
3. 销售服务费		50,494.11	71,142.83
4. 交易费用	7.4.7.18	503,684.03	246,673.53
5. 利息支出		6,613,245.76	13,150,805.61
其中:卖出回购金融资产支出		6,613,245.76	13,150,805.61
6. 其他费用	7.4.7.19	260,434.87	252,659.45
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		37,596,482.95	59,575,898.36
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		37,596,482.95	59,575,898.36

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	519,433,822.22	15,547,274.77	534,981,096.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	37,596,482.95	37,596,482.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	154,971,693.01	4,348,017.76	159,319,710.76
其中:1.基金申购款	654,066,976.09	34,232,439.83	688,299,415.92
2.基金赎回款	-499,095,283.08	-29,884,422.08	-528,979,705.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-35,244,003.51	-35,244,003.51
五、期末所有者权益(基金净值)	674,405,515.23	22,247,771.96	696,653,287.19
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	676,507,904.92	-6,681,795.35	669,826,109.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	59,575,898.36	59,575,898.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-157,074,082.70	-896,009.46	-157,969,092.15
其中:1.基金申购款	306,814,548.95	3,222,458.91	310,037,007.86
2