

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:二〇一四年三月二十八日

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。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字确认，并由董事长签章。

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2014年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配政策、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核后报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本年度报告摘要自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2013年8月28日起至2013年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
基金代码	000257
交易代码	000257/000258
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	675,507,942份
基金合同的存续	
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
下属分级基金的交易代码	000257
报告期末下属分级基金的份额总额	656,605,817.08份
报告期末下属分级基金的份额总额	19,902,067.94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，在风险可控的前提下，通过参与固定收益类资产的投资，为基金份额持有人创造稳定的收入。
1. 债券类配置策略	本基金将对不同券种的信用风险、评级水平、市场流动性、收益率曲线等因素进行综合分析，通过久期调整和债券选择来优化组合的票息收入和资本利得部分。
2. 久期管理策略	本基金通过深入研究宏观经济、金融环境变化、宏观经济政策等因素的综合分析，适时调整久期并根据预期利率变动情况，适时调整久期。
3. 收益曲面策略	本基金将通过信用评价体系对发行人及发行品种的风险特征、信用评级、还款水平、市场流动性、历史回报率等进行综合分析，从而选择收益较高的债券品种。
4. 信用策略	本基金将利用信用评价体系对发行人及发行品种的风险特征、信用评级、还款水平、市场流动性、历史回报率等进行综合分析，从而选择收益较高的债券品种。
业绩基准	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，属于债券型基金中的最低风险品种，预期风险和预期收益低于货币基金和股票型基金。

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	
姓名	胥鸣伟	胥鸣伟	
信息披露负责人	021-59784888 电子邮箱	95599 peisong@junk.com	
客户服务电话	400-899-4888 传真	95599 021-26284000	

2.4 信息披露方式	基金业协会指定的互联网网址	http://www.cifn.com
基金份额持有人的公告发布地点	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

单位:人民币元	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				
本期已实现收益	9,150,179.06				
本期利润	-6,459,039.50				
加权平均基金份额本期利润	-0.098				
本期基金份额净值增长率	-1.00%				

3.1.1 期间数据和指标	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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券A类
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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券C类

3.1.2 期末数据和指标	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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券C类
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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券A类

3.1.3 利润指标	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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券C类
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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券A类

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	2013年8月28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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券C类
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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券A类

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变化与同期业绩比较基准收益率变化的比较	2013年8月28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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券C类
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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券A类

3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率变化与同期业绩比较基准收益率变化的比较	2013年8月28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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券C类
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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券A类

3.2.4 自基金合同生效以来基金净值增长率变化与同期业绩比较基准收益率变化的比较	2013年8月28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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券C类
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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券A类

3.2.5 自基金合同生效以来基金净值增长率变化与同期业绩比较基准收益率变化的比较	2013年8月28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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券C类
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类	上投摩根岁岁盈定期开放债券A类

3.2.6 自基金合同生效以来基金净值增长率变化与同期业绩比较基准收益率变化的比较	2013年8月28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