

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  
基金合同生效日：二〇一三年三月二十六日

## § 1 重要提示

1. 基金管理人、基金托管人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法律责任。本基金报告公告之日前二十二个工作日内，发生影响该基金投资运作的实质性事件，经核查，没有导致或可能导致基金份额持有人利益损害的重大事件，且基金管理人、基金托管人没有进行披露。

2. 本基金管理人和基金托管人根据本基金合同规定，于2015年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比等数据，保证复核结果与基金管理人计算的结果一致。

3. 本基金管理人和基金托管人承诺以诚实信用、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。

4. 本年度报告摘要须待年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

5. 本报告期自2014年1月1日起至2014年12月31日止。

## § 2 基金简介

基金简称	上投摩根岁岁盈定期开放债券A
基金代码	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3月26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
报告期末基金总资产	519,433,222.65
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
下属分级基金的交易代码	000257 000765 000258
报告期末下属分级基金的份额总额	212,006,347,185.79 294,699,417,731.00 2,466,076,911.00
报告期末下属分级基金的单位净值	10,261,980.40份 不定期

2.2 基金产品说明

1. 投资目标 在合理充分的分析及定价基础上，在风险可控的前提下，通过参与固定收益类资产的投资封闭运作，力争获取稳定的收益。

2. 债券类资产配置策略 本基金将综合考虑宏观经济、利率水平、市场流动性、市场利率等方面变化，通过分析、评估不同债券品种之间的相对投资价值，确定债券配置策略，并根据市场变化及时调整配置。

3. 收益率曲线策略 本基金将综合考虑收益率曲线变化趋势，结合收益率曲线变化的预期，适时采用收益曲线变动策略，即根据收益率曲线上不同期限的收益率及其变化的反应，并据此调整债券组合，以进行动态调整。

4. 利率风险管理 本基金利用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，分析违约风险及其对信用利差水平、判断债券的投资价值，谨慎选择债券的基本属性，博弈其信用价值进行投资。

5. 风险收益特征 本基金为债券基金，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

信息披露义务人

姓名	胡波
联系电话	021-38794888
电子邮箱	services@cmfchina.com
客户服务电话	400-889-4888
传真	95559
客户服务中心网址	http://www.cifn.com
基金管理人书面报告地址	基金管理人办公的场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	
年初至报告期期末基金合同生效日止	2013年3月26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B
本期已实现收益	37,247,730.16
本期利润	5,699,587.11
加权平均基金份额本期利润	0.1024
本期基金份额净值增长率为	-0.6%
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B
期末可供分配基金份额利润	0.0030
期末基金财产净值	218,247,145.57
期末基金份额净值	650,146,777.58

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	
年初至报告期期末基金合同生效日止	2014年12月31日
上投摩根岁岁盈定期开放债券B	
本期已实现收益	6,130,478.85
本期利润	5,659,587.11
加权平均基金份额本期利润	0.0219
本期基金份额净值增长率为	2.18%
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
期末可供分配基金份额利润	0.0028
期末基金财产净值	303,473,923.59
期末基金份额净值	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	
年初至报告期期末基金合同生效日止	2013年3月26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
本期已实现收益	980,691.86
本期利润	249,990.34
加权平均基金份额本期利润	0.0105
本期基金份额净值增长率为	-0.32%
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
期末可供分配基金份额利润	0.0296
期末基金财产净值	2,359,185.74
期末基金份额净值	1.030

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	
年初至报告期期末基金合同生效日止	2014年12月31日
上投摩根岁岁盈定期开放债券D	
本期已实现收益	200,943.78
本期利润	185,426.46
加权平均基金份额本期利润	0.0194
本期基金份额净值增长率为	1.99%
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
期末可供分配基金份额利润	0.00274
期末基金财产净值	10,542,273.09
期末基金份额净值	1.027

注: 本报告期已实现收益为基金利息收入、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,本期利润为扣除公允价值变动收益后,对期末可供分配利润、采用期末资产净值法未分配利润与未分配利润之和。

2.1 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.2 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.3 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.4 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.5 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.6 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.7 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.8 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.9 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.10 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.11 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.12 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.13 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.14 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.15 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.16 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.17 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.18 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.19 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.20 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.21 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.22 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.23 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.24 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.25 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.26 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.27 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.28 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.29 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.30 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.31 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用由投资人承担,在申购赎回时从基金资产中扣除。

2.32 基金利润总额不包括持有人认购基金时支付的申购费和赎回时支付的申购赎回手续费,基金申购赎回费用