

# 上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘

## 要

核准文号：中国证监会证监许可[2013]800号文

核准日期：[2013年6月18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

重要提示：

1. 投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应当认真阅读招募说明书；
2. 基金的过往业绩并不预示其未来表现；
3. 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。
4. 本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。
5. 本基金可以参与中小企业私募债券的投资。中小企业私募债发行人为中小微、非上市企业，存在着公司治理结构相对薄弱、企业经营风险高、信息披露透明度不足等特点。投资中小企业私募债将存在违约风险和流动性不足的风险，这将在一定程度上增加基金的信用风险和流动性风险。
6. 本招募说明书摘要所载内容截止日为2016年8月27日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2016年6月30日。

二零一六年十月

### 一、基金管理人

#### (一)基金管理人概况

本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基本信息如下：

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼20楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼20楼

法定代表人：穆矢

总经理：章硕麟

成立日期：2004年5月12日

实缴注册资本：贰亿伍仟万元人民币

股东名称、股权结构及持股比例：

上海国际信托投资有限公司 51%

JPMorgan Asset Management (UK) Limited 49%

上投摩根基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[2004]56号文批准，于2004年5月12日成立的合资基金管理公司。2005年8月12日，基金管理人完成了股东之间的股权变更事项。公司注册资本保持不变，股东及出资比例分别由上海国际信托投资有限公司67%和摩根富林明资产管理（英国）有限公司33%变更为目前的51%和49%。

2006年6月6日，基金管理人的名称由“上投摩根富林明基金管理有限公司”变更为“上投摩根基金管理有限公司”，该更名申请于2006年4月29日获得中国证监会的批准，并于2006年6月2日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

2009年3月31日，基金管理人的注册资本金由一亿五千万人民币增加到二亿五千万人民币，公司股东的出资比例不变。该变更事项于2009年3月31日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

基金管理人无任何受处罚记录。

## (二) 主要人员情况

### 1. 董事会成员基本情况：

董事长：穆矢

硕士研究生学历、高级经济师职称。

曾任天津市人大财经委办公室副主任、天津信托投资公司总裁助理、上海浦东发展银行天津分行副行长、行长、党委书记、总行风险管理总部总监、上海浦东发展银行党委委员、副行长。

现任上海浦东发展银行董事会秘书、上投摩根基金管理有限公司董事长。

董事：

董事：Paul Bateman

毕业于英国Leicester大学。

历任Chase Fleming Asset Management Limited全球总监，摩根资产管理全球

投资管理业务 CEO。

现任摩根资产管理全球主席、摩根资产管理委员会主席及投资委员会会员。同时也是摩根大通高管委员会资深成员。

董事：Jed Laskowitz

美国伊萨卡学院学士学位（主修政治）及布鲁克林法学院荣誉法学博士学位。

曾任摩根资产管理亚太区行政总裁。

现任摩根资产管理全球投资管理方案联席总监。

董事：Michael I. Falcon

学士学位（主修金融）。

曾任摩根资产退休业务总监。

现任摩根资产管理全球投资管理的亚太区行政总裁、亚太区基金业务总监、环球投资管理营运委员会成员、集团亚太管理团队成员、集团投资管理亚太区营运委员会主席。

董事：潘卫东

硕士研究生，高级经济师。

曾任上海市金融服务办公室金融机构处处长（挂职）、上海国际集团有限公司副总裁。

现任上海浦东发展银行股份有限公司副行长、上海国际信托有限公司党委书记、董事长。

董事：陈兵

博士研究生，高级经济师。

曾任浦发银行总行个人银行总部财富管理部总经理、上海国际信托有限公司副总经理兼董事会秘书。

现任上海国际信托有限公司党委副书记、副董事长、总经理。

董事：陈海宁

研究生学历、经济师。

曾任上海浦东发展银行金融部总经理助理、公投总部贸易融资部总经理、武汉分行副行长、武汉分行党委书记、行长。

现任上海浦东发展银行总行资产负债管理部总经理。

董事：章硕麟

获台湾大学商学硕士学位。

曾任怡富证券股份有限公司副总经理（现名摩根大通证券）、摩根富林明证券股份有限公司董事长。

现任上投摩根基金管理有限公司总经理。

独立董事：

独立董事：刘红忠

国际金融系经济学博士

现任复旦大学金融研究中心副主任、复旦大学国际金融系教授。

独立董事：戴立宁

获台湾大学法学硕士及美国哈佛大学法学硕士学位。

曾任台湾财政部常务次长，东吴大学法学院副教授。

现任北京大学法学院及光华管理学院兼职教授。

独立董事：李存修

获美国加州大学柏克利校区企管博士(主修财务)、企管硕士、经济硕士等学位。

现任台湾大学财务金融学系专任特聘教授。

独立董事：俞樵

经济学博士。

现任清华大学公共管理学院经济与金融学教授及公共政策研究所所长。曾经在加利伯利大学经济系、新加坡国立大学经济系、复旦大学金融系等单位任教。

## 2. 监事会成员基本情况：

监事长：郁忠民

研究生毕业，高级经济师。

历任华东政法学院法律系副主任；上海市证券管理办公室稽查处、机构处处长；

上海国际集团有限公司投资管理部经理；上海证券有限责任公司副董事长、总经理、党委副书记；上海国际集团金融管理总部总经理。

现任上海国际信托有限公司监事长。

监事：石恬华

台湾大学财务金融系学士及芝加哥大学布斯商学院硕士。

历任摩根资产管理集团台湾区摩根投顾总经理、摩根投信总经理等职务；现任摩根资产管理集团台湾区负责人暨摩根投信董事长，负责台湾区的资产管理业务。

监事：张军

曾任上投摩根基金管理有限公司交易部总监。

现任上投摩根基金管理有限公司国际投资部总监兼基金经理，管理上投摩根亚太优势混合型证券投资基金和上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金。

监事：万隽宸

曾任上海国际集团有限公司高级法务经理。

现任上投摩根基金管理有限公司首席风险官；尚腾资本管理有限公司董事。

### 3. 总经理基本情况：

章硕麟先生，总经理。

获台湾大学商学硕士学位。

曾任怡富证券股份有限公司副总经理（现名摩根大通证券）、摩根富林明证券股份有限公司董事长。

### 4. 其他高级管理人员情况：

侯明甫先生，副总经理。

毕业于台湾中国文化大学，获企业管理硕士。曾任职于台湾金鼎证券公司、摩根富林明（台湾）证券投资顾问股份有限公司、摩根富林明（台湾）证券股份有限公司、摩根富林明证券投资信托股份有限公司，主要负责证券投资研究、公司管理兼投资相关业务管理。

上投摩根基金管理有限公司于2016年9月24日发布公告，侯明甫先生自2016年9月22日起不再担任上投摩根基金管理有限公司副总经理一职，转任上投摩根基金管理有限公司投资董事。

张军先生，副总经理

毕业于同济大学，获管理工程硕士学位。

历任中国建设银行上海市分行办公室秘书、公司业务部业务科科长，徐汇支行副行长、个人金融部副总经理，并曾担任上投摩根基金管理有限公司总经理助理一职。

刘万方先生，督察长。

获经济学博士学位。

曾任职于中国普天信息产业集团公司、美国MBP咨询公司、中国证监会。

上投摩根基金管理有限公司于2016年9月24日发布公告，杜猛先生、孙芳女士、郭鹏先生自2016年9月22日起担任上投摩根基金管理有限公司副总经理一职。

### 5. 本基金基金经理

唐璐女士，英国爱丁堡大学硕士，2008年2月至2010年4月任

JPMorgan(EMEA)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和上投摩根轮动添利债券型证券投资基金基金经理，自2016年5月起同时担任上投摩根双债增利债券型证券投资基金基金经理，自2016年6月起同时担任上投摩根分红添利债券型证券投资基金及上投摩根纯债添利债券型证券

投资基金基金经理。

本基金的历任基金经理为赵峰先生，任职时间为自本基金合同生效日起至2015年11月20日。

#### 6. 基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

侯明甫，副总经理；杜猛，总经理助理兼国内权益投资一部投资总监；孙芳，总经理助理兼国内权益投资二部投资总监；朱晓龙，研究总监；孟晨波，总经理助理兼货币市场投资部总监；赵峰，债券投资部总监；张军，国际投资部总监；黄栋，量化投资部总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：牛锡明

住 所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.62 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：汤嵩彦

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。根据 2015 年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第 17 位，较上年上升 2 位；根据 2015 年美国《财富》杂志发布的世界 500 强公司排行榜，交通银行营业收入位列第 190 位，较上年上升 27 位。

截至 2016 年 6 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 79,563.22 亿元。2016 年 1-6 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 376.61 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多

年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

## （二）主要人员情况

牛锡明先生，董事长、执行董事。

牛先生 2013 年 10 月至今任本行董事长、执行董事，2013 年 5 月至 2013 年 10 月任本行董事长、执行董事、行长，2009 年 12 月至 2013 年 5 月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生 1983 年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997 年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999 年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。

彭先生 2013 年 11 月起任本行副董事长、执行董事，2013 年 10 月起任本行行长；2010 年 4 月至 2013 年 9 月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限公司执行董事、总经理；2005 年 8 月至 2010 年 4 月任本行执行董事、副行长；2004 年 9 月至 2005 年 8 月任本行副行长；2004 年 6 月至 2004 年 9 月任本行董事、行长助理；2001 年 9 月至 2004 年 6 月任本行行长助理；1994 年至 2001 年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生 1986 年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

## （三）基金托管业务经营情况

截至 2016 年 6 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 175 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

## 三、相关服务机构

(一) 基金销售机构:

1. 直销机构: 上投摩根基金管理有限公司(同上)

2. 代销机构:

(1) 中国银行股份有限公司

地址: 北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街1号 客户服务电话: 95566

法定代表人: 田国立

网址: [www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(2) 招商银行股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区深南大道7088号

办公地址: 广东省深圳市福田区深南大道7088号

法人代表: 李建红

客户服务中心电话: 95555

网址: [www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(3) 交通银行股份有限公司

注册地址: 上海市银城中路188号

办公地址: 上海市银城中路188号

法定代表人: 牛锡明

客户服务热线: 95559

网址: [www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(4) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址: 上海市中山东一路12号

法定代表人: 吉晓辉

联系人: 虞谷云

联系电话: 021-61618888

客户服务热线: 95528

网址: [www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

(5) 上海银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区银城中路168号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人: 范一飞

联系电话: 021-68475888



传真：021-68476111

客户服务热线：021-962888

网址：[www.bankofshanghai.com](http://www.bankofshanghai.com)

(6) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层（邮编：200031）

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

国际互联网网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

联系人：黄莹

(7) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦  
20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼  
2005 室（邮编：830002）

法定代表人：李季

电话：010-88085858

传真：010-88085195 客户服务热线：400-800-0562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

联系人：李巍

(8) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：龚德雄

电话：(021) 53519888

传真：(021) 53519888

客户服务热线：4008918918（全国）、021-962518

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

(9) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

电话：(021) 38676666 转 6161

传真：(021) 38670161

客户服务咨询电话：95521

网址：www.gtja.com

(10) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

网址：www.newone.com.cn

(11) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

客户服务电话：95525 联系人：刘晨

网址：www.ebscn.com

(12) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：田薇

电话：010-66568430

传真：010-66568536

客服电话：4008888888

网址：www.chinastock.com.cn

(13) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

电话：(010)65186758

传真：(010)65182261

联系人：魏明

客户服务咨询电话：400-8888-108；

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(14) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

联系人：李笑鸣

客服电话：95553

公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(15) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：周杨

客户服务电话：95536

公司网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(16) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

联系人：李航

客户服务电话：4008188118

网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

(17) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

传真：010-60833739

客户服务热线：010-95558

(18) 中信证券（山东）有限责任公司

注册和办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

(19) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

客服电话：4008001001

公司网址：www.essence.com.cn

(20) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

长江证券客户服务网站：www.95579.com

(21) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

公司网站：www.noah-fund.com

(22) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

公司网站：www.ehowbuy.com

(23) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

公司网站：www.zlfund.cn www.jjmmw.com

(24) 杭州数米基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客服电话：400-0766-123

公司网站：www.fund123.cn

(25) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

网站：www.1234567.com.cn

(26) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服电话：4009200022, 021-20835588

网站：licaikexun.com

(27) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

客服电话：400-001-1566

网站：www.yilucaifu.com

(28) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系电话：010-62020088

传真：010-62020035

客服电话：4008886661

公司网址：www.myfund.com

(29) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

客服电话：4000676266

网站：www.leadbank.com.cn

(30) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

客服电话：400-820-2819

网站：fund.bundtrade.com

(31) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

客服电话：400-821-9031

网站：www.lufunds.com

(32) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

客服电话：400-898-0618

网站：www.chtfund.com

(33) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

法定代表人：董浩

客服电话：400-628-1176

网站：www.jimufund.com

(34) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

网站：www.yingmi.cn

(35) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：杨懿

客服电话：400-166-1188

网站：<http://8.jrj.com.cn/>

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

(二) 基金注册登记机构：

上投摩根基金管理有限公司（同上）

(三) 律师事务所与经办律师：

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

联系电话：021-5115 0298

传真：021-5115 0398

经办律师：刘佳、张兰

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：曹阳

经办注册会计师：陈玲、曹阳

四、基金概况

基金名称:上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金

基金类型:契约型开放式

## 五、基金的投资

### (一)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。

### (二)投资范围

本基金主要投资于固定收益类金融工具,具体包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益品种及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场的新股申购或增发新股,可转换债券仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金的债券投资比例不低于基金资产的80%,但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内,基金投资不受上述比例限制;开放期内现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%;如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

### (三)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,研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势,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

本基金将基于对市场利率的变化趋势的预判,相应的调整债券组合的久期。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



积极调整债券组合的久期。在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。

### 3、收益率曲线策略

本基金资产组合中的长、中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置。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

本基金将深入挖掘信用债的投资价值，在承担适度风险的前提下追求较高收益。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。

### 5、回购策略

本基金将通过对比回购利率和现券收益率以及其他投资品种收益率的比较，通过回购融入短期资金滚动操作，投资于收益率高于回购成本的债券以及其他获利机会，从而获得杠杆放大收益，并根据市场利率水平以及对利率期限结构的预期等，对回购放大的杠杆比例适时进行调整。

### 6、中小企业私募债券投资策略

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，其中，投资决策流程和风险控制制度需经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

本基金对中小企业私募债的投资主要从自上而下判断景气周期和自下而上精选标的两个角度出发，通过自上而下的宏观环境分析、市场指标分析结合自下而上的基本面分析和估值分析，精选个券构建组合。为了提高对私募债券的投资效率，严格控制投资的信用风险，在个券甄选方面，本基金将通过信用调查方案对债券发行主体的信用状况进行分析。

### 7、资产支持证券投资策略

本基金将在严格控制组合投资风险的前提下投资于资产支持证券。本基金综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量等因素，主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估，在严格控制风险的情况下，确

定资产合理配置比例，在保证资产安全性的前提条件下，以期获得长期稳定收益。

#### （四）投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金的债券投资比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；

（2）开放期内保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（4）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（5）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（6）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（7）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（8）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（9）本基金持有的全部中小企业私募债券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金持有一家企业发行的中小企业私募债，不得超过该债券的 10%，本基金投资中小企业私募债券的剩余期限，不得超过本基金的剩余运作周期；

（10）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

（11）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起

开始。

如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。如法律法规或监管部门取消上述限制，且适用于本基金，则本基金在履行适当程序后不再受相关限制，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 依照法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## (五) 业绩比较基准

一年期银行定期存款利率（税后）+0.5%

上述“一年期银行定期存款利率”是指每个运作周期首日中国人民银行公布并执行的一年期“金融机构人民币存款基准利率”，以后每一个年度开放期结束后的第一个运作周期首日进行调整。

本基金是债券型基金，每封闭运作满一年开放一次，主要投资于各类固定收益类金融工具，追求基金资产的稳定增值，因此，上述业绩比较基准与本基金定期开放的运作方式相匹配，符合本基金的风险收益特征，是衡量本基金投资业绩的理想基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人在与基金托管人协商一致，并履行适当程序后调整或变更业绩比较基准并及时公告，而无须召开基金份额持有人大会。

## (六) 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。

## (七) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有

人的利益；

2. 有利于基金财产的安全与增值；

3. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### (八) 基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

#### (九) 基金的投资组合报告

(1) 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 --

其中：股票 --

2 固定收益投资 842,695,344.03 93.96

其中：债券 838,464,144.03 93.49

资产支持证券 4,231,200.00 0.47

3 贵金属投资 --

4 金融衍生品投资 --

5 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

6 银行存款和结算备付金合计 17,039,757.40 1.90

7 其他各项资产 37,121,729.83 4.14

8 合计 896,856,831.26 100.00

(2) 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

(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

本基金本报告期末未持有股票。

(4) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 --

2 央行票据 --

3 金融债券 73,897,000.00 10.45

其中：政策性金融债 73,897,000.00 10.45

4 企业债券 434,598,044.03 61.45

5	企业短期融资券	110,343,000.00	15.60
6	中期票据	219,626,100.00	31.06
7	可转债（可交换债）	--	
8	同业存单	--	
9	其他	--	
10	合计	838,464,144.03	118.56

(5) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	140202	14 国开 02	500,000	53,445,000.00	7.56
2	1182277	11 中铁建 MTN1	200,000	21,520,000.00	3.04
3	1182057	11 中建 MTN1	200,000	20,912,000.00	2.96
4	1282501	12 电网 MTN4	200,000	20,588,000.00	2.91
5	101551010	15 电网 MTN001	200,000	20,542,000.00	2.90

(6) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比（%）
----	------	------	-------	---------	-------------

1	1689022	16 中赢新易贷 1B	80,000.00	4,231,200.00	0.60
---	---------	-------------	-----------	--------------	------

(7) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末未持有贵金属。

(8) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

(9) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
本基金本报告期末未持有股指期货。

(10) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
本基金本报告期末未持有国债期货。

(11) 投资组合报告附注

1、 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 3、其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1	存出保证金	55,244.13
2	应收证券清算款	17,987,866.28
3	应收股利	-
4	应收利息	19,078,619.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,121,729.83

### 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## 九、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### 上投摩根岁岁盈定期开放债券 A:

阶段 净值增长率① 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

基金成立日—2013/12/31 -1.00% 0.11% 1.23% 0.01% -2.23% 0.10%

2014/01/01—2014/12/31 9.63% 0.16% 3.55% 0.01% 6.08% 0.15%

2015/01/01—2015/12/31 6.87% 0.07% 3.21% 0.01% 3.66% 0.06%

2016/01/01—2016/06/30 1.55% 0.06% 1.14% 0.01% 0.41% 0.05%

### 上投摩根岁岁盈定期开放债券 B:

阶段 净值增长率① 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

基金成立日—2014/12/31 2.18% 0.24% 1.22% 0.01% 0.96% 0.23%

2015/01/01—2015/12/31 7.08% 0.07% 3.21% 0.01% 3.87% 0.06%

2016/01/01—2016/06/30 1.45% 0.07% 1.14% 0.01% 0.31% 0.06%

上投摩根岁岁盈定期开放债券 C:

阶段 净值增长率① 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

基金成立日—2013/12/31 -1.10% 0.10% 1.23% 0.01% -2.33% 0.09%

2014/01/01—2014/12/31 9.32% 0.16% 3.55% 0.01% 5.77% 0.15%

2015/01/01—2015/12/31 6.38% 0.06% 3.21% 0.01% 3.17% 0.05%

2016/01/01—2016/06/30 1.36% 0.07% 1.14% 0.01% 0.22% 0.06%

上投摩根岁岁盈定期开放债券 D:

阶段 净值增长率① 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

基金成立日—2014/12/31 1.99% 0.23% 1.22% 0.01% 0.77% 0.22%

2015/01/01—2015/12/31 6.79% 0.07% 3.21% 0.01% 3.58% 0.06%

2016/01/01—2016/06/30 1.36% 0.07% 1.14% 0.01% 0.22% 0.06%

## 七、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；

- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、销售服务费；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的 B 类和 D 类基金份额的年管理费率为 0.6%，A 类和 C 类基金份额的年管理费率为 0.4%。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 3、销售服务费

本基金 A 类和 B 类基金份额不收取销售服务费，C 类和 D 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值



基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

销售服务费不包括基金募集期间的上述费用。

上述“一、基金费用的种类中第3—7项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）费用调整

在遵守相关的法律法规并履行了必要的程序的前提下，基金管理人可酌情调低基金管理费率、销售服务费率，或基金托管人可酌情调低基金托管费率。此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前三个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 八、招募书说明书更新部分说明

上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金于2013年8月28日成立，至2016年8月27日运作满三年。现依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合基金管理人对本基金实施的投资经营活动，对2016年4月12日公告的《上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）》进行内容补充和更新，主要更新的内容如下：

- 1、在重要提示中，更新内容截止日为2016年8月27日，基金投资组合及基金

业绩的数据截止日为 2016 年 6 月 30 日。

- 2、在“三、基金管理人”的“基金管理人概况”中，对基金管理人的地址信息进行了更新。
- 3、在“三、基金管理人”的“主要人员情况”中，对董事、监事、总经理、其他高级管理人员、基金经理等信息进行了更新。
- 4、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的信息进行了更新。
- 5、在“五、相关服务机构”中，对代销机构的信息进行了更新。
- 6、在“八、基金的投资”的“基金的投资组合报告”中，根据本基金实际运作情况更新了最近一期投资组合报告的内容。
- 7、在“九、基金的业绩”中，根据基金的实际运作情况，对本基金成立以来的业绩进行了说明。
- 8、在“二十二、其他应披露事项”章节，对本披露期内的重大事项进行了披露。

上投摩根基金管理有限公司

2016 年 10 月 11 日