

**上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金**  
**2019 年半年度报告**  
**2019 年 6 月 30 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

报告送出日期：二〇一九年八月二十四日

## 1 重要提示及目录

### 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。本半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 2019 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
<b>4 管理人报告</b> .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>5 托管人报告</b> .....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>7 投资组合报告</b> .....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 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.....	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	39
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	41
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>41</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4 基金投资策略的改变 .....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8 其他重大事件 .....	43
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>43</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>44</b>
12.1 备查文件目录 .....	44
12.2 存放地点 .....	44
12.3 查阅方式 .....	44

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	上投摩根岁岁益定期开放债券	
基金主代码	004627	
交易代码	004627	
基金运作方式	契约型定期开放式	
基金合同生效日	2018 年 1 月 25 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	103,775,291.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	上投摩根岁岁益定期开放 债券 A	上投摩根岁岁益定期开放 债券 C
下属分级基金的交易代码	004627	004628
报告期末下属分级基金的份额总额	103,543,240.16 份	232,051.34 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	<p>1、债券类属配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、久期管理策略</p> <p>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。</p> <p>3、收益率曲线策略</p> <p>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。</p> <p>4、信用策略</p> <p>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</p>

	<p>条款优惠的信用债进行投资。</p> <p>5、回购策略 本基金将通过对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。</p> <p>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。</p> <p>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下，以期获得长期稳定收益。</p>
业绩比较基准	中债总指数
风险收益特征	<p>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。</p> <p>本基金风险收益特征会定期评估并在公司网站发布，请投资者关注。</p>

### 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	陆志俊
	联系电话	021-38794888	95559
	电子邮箱	services@cifm.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-889-4888	95559
传真		021-20628400	021-62701216
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25楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
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25楼	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		陈兵	彭纯

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
----------------	---------

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cifm.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上投摩根基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 楼

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）	
	上投摩根岁岁益定期开放债券 A	上投摩根岁岁益定期开放债券 C
本期已实现收益	3,449,367.15	5,124.50
本期利润	1,811,430.31	3,365.40
加权平均基金份额本期利润	0.0159	0.0153
本期加权平均净值利润率	1.56%	1.50%
本期基金份额净值增长率	1.80%	1.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
	上投摩根岁岁益定期开放债券 A	上投摩根岁岁益定期开放债券 C
期末可供分配利润	2,510,295.83	4,919.80
期末可供分配基金份额利润	0.0242	0.0212
期末基金资产净值	106,053,535.99	236,971.14
期末基金份额净值	1.0242	1.0212
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
	上投摩根岁岁益定期开放债券 A	上投摩根岁岁益定期开放债券 C
基金份额累计净值增长率	7.10%	6.44%

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，期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

上投摩根岁岁益定期开放债券 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
过去一个月	0.64%	0.03%	0.47%	0.07%	0.17%	-0.04%
过去三个月	0.51%	0.09%	-0.53%	0.11%	1.04%	-0.02%
过去六个月	1.80%	0.08%	-0.37%	0.10%	2.17%	-0.02%
过去一年	5.65%	0.06%	2.70%	0.10%	2.95%	-0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	7.10%	0.05%	6.09%	0.11%	1.01%	-0.06%

上投摩根岁岁益定期开放债券 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
过去一个月	0.61%	0.03%	0.47%	0.07%	0.14%	-0.04%
过去三个月	0.42%	0.09%	-0.53%	0.11%	0.95%	-0.02%
过去六个月	1.51%	0.07%	-0.37%	0.10%	1.88%	-0.03%
过去一年	5.17%	0.06%	2.70%	0.10%	2.47%	-0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.44%	0.05%	6.09%	0.11%	0.35%	-0.06%

注：本基金的业绩比较基准为：中债总指数

#### 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

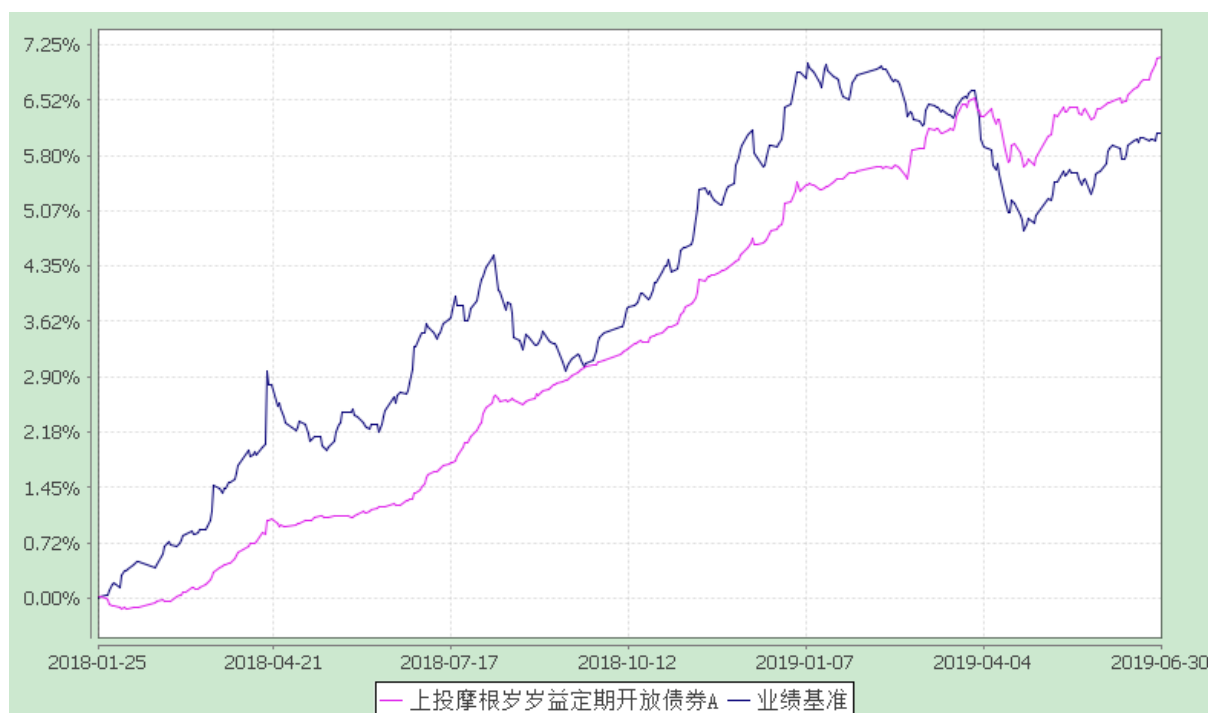
上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 1 月 25 日至 2019 年 6 月 30 日)

上投摩根岁岁益定期开放债券 A

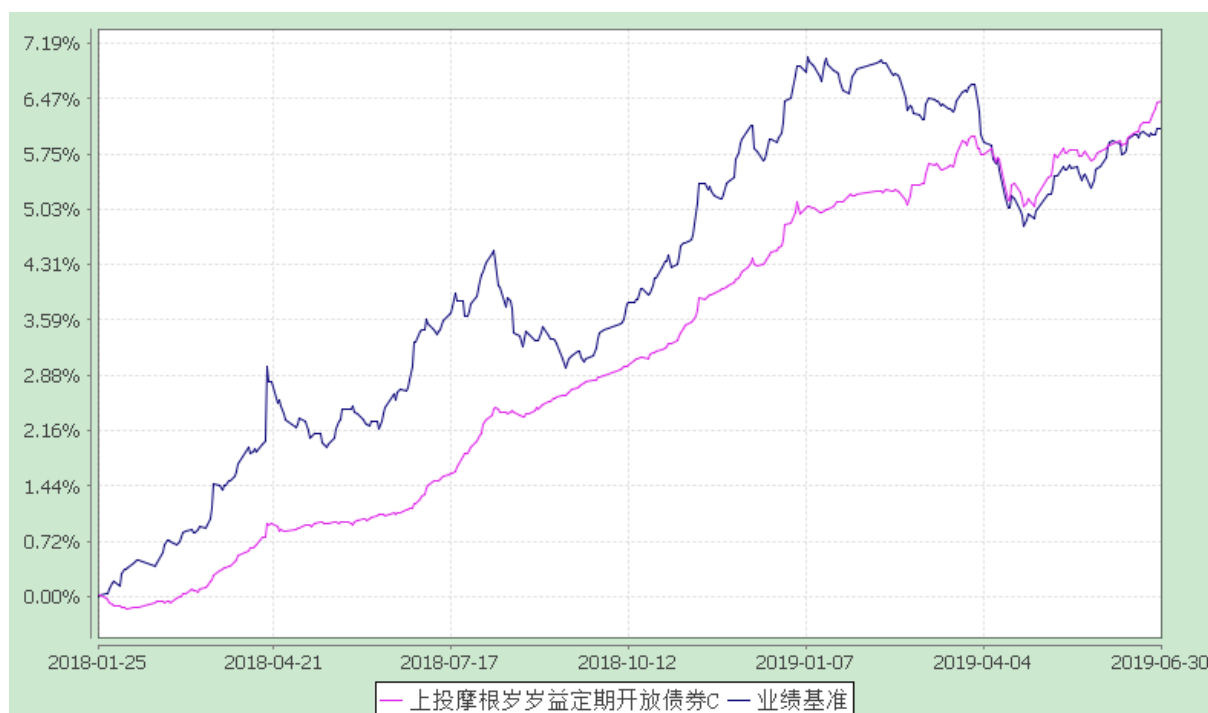




注：本基金合同生效日为 2018 年 1 月 25 日，图示时间段为 2018 年 1 月 25 日至 2019 年 6 月 30 日。

本基金建仓期自 2018 年 1 月 25 日至 2018 年 7 月 24 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

#### 上投摩根岁岁益定期开放债券 C



注：本基金合同生效日为 2018 年 1 月 25 日，图示时间段为 2018 年 1 月 25 日至 2019 年 6 月

30 日。

本基金建仓期自 2018 年 1 月 25 日至 2018 年 7 月 24 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

## 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 2019 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有六十四只，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、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添盈货币市场基金、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、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）、上投摩根

策略精选灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金、上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、上投摩根全球多元配置证券投资基金(QDII)、上投摩根安丰回报混合型证券投资基金、上投摩根安通回报混合型证券投资基金、上投摩根优选多因子股票型证券投资基金、上投摩根丰瑞债券型证券投资基金、上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金、上投摩根安隆回报混合型证券投资基金、上投摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金 (QDII)、上投摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、上投摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、上投摩根安裕回报混合型证券投资基金、上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金 (QDII)、上投摩根核心精选股票型证券投资基金、上投摩根动力精选混合型证券投资基金、上投摩根领先优选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		
刘阳	本基金基金经理	2018-01-25	-	8 年	刘阳女士自 2011 年 5 月至 2012 年 6 月在申银万国证券研究所担任分析师，2012 年 6 月至 2013 年 5 月在广发证券研发中心担任高级分析师，2013 年 6 月起加入上投摩根基金管理有限公司，历任投资经理助理兼研究员、投资经理、债券研究部总监兼基金经理，现任基金经理；自 2015 年 12 月至 2017 年 8 月期间、2019 年 4 月至今担任上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金基金经理，自 2015 年 12 月起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 4 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，自 2016 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，2016 年 12 月至 2019 年 1 月同时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 2017 年 4 月至 2019 年 8 月同时担任上投摩根岁岁金定期开放债券型证券投资基

					金基金经理,自 2017 年 11 月起同时担任上投摩根丰瑞债券型证券投资基金基金经理,自 2018 年 1 月起同时担任上投摩根岁岁益定期开放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. 刘阳女士为本基金首任基金经理,其任职日期指本基金基金合同生效之日。

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合规守信情况的说明

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。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根岁岁益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。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求,严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动,通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析,以确保本公司管理的不同投资组合在授权、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环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动,本公司执行集中交易制度,确保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量;对于银行间市场投资活动,本公司通过对手库控制和交易室询价机制,严格防范对手风险并检查价格公允性;对于申购投资行为,本公司遵循价格优先、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。

报告期内,通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析,未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

##### 4.3.2 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,未发现存在异常交易行为。

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% 的次数为一次，发生在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

2019 年上半年，债券收益率经历震荡和快速上行调整后，于 5 月起再次缓慢下行。一季度整体来看，10 年期国开债收益率围绕开年 3.65% 的中枢，在 3.55-3.75% 的区间运行；短端收益率受益于宽松的流动性，整体维持低位，1 年期国开债从开年的 2.65% 附近小幅下行，在 2.5-2.6% 的区间窄幅波动，收益率曲线进一步陡峭化，10-1 年期限利差至一季末在 103BP，处于历史 60% 分位以上。进入二季度，债券市场结束上季度的震荡走势，出现明显调整。4 月，长期债券收益率突破一季度的震荡区间，出现持续大幅上行，10 年期国开债活跃券收益率最高上冲至 3.9% 附近。进入 5 月，贸易谈判出现反复，市场风险偏好回落，收益率向下修复，经济金融数据对比一季度出现回落，流动性环境回暖，月末包商银行事件导致非银机构信用债质押融资出现困难，但利率债市场未受影响，收益率维持缓慢下行。6 月，市场聚焦月底 G20 峰会，长端收益率维持盘整，短端利率持续下行。整体来看，上半年债券市场短端收益率优于长端，杠杆策略优于久期策略，长期利率债在一季度冲量信贷和社融数据影响下，波动加大，权益市场上行叠加悲观经济预期修复，是导致市场间歇性调整的主要原因。5 月以来的收益率下行，部分受贸易谈判导致的风险偏好回落提振，更多受益于融资底到经济底的预期路径被证伪，货币政策相机抉择之下，流动性整体维持充裕，支持收益率从高点下行近 30BP。岁岁益在打开申购赎回的过程中，维持组合高流动性，再次进入运作后，以利率债为底仓，维持整体中性久期和高杠杆，并于 4 月的市场调整中，增加了部分 2-3 年期商业银行金融债配置，同时阶段性参与了长债交易。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期上投摩根岁岁益定期开放债券 A 份额净值增长率为:1.80%，同期业绩比较基准收益率为:-0.37%，

上投摩根岁岁益定期开放债券 C 份额净值增长率为:1.51%，同期业绩比较基准收益率为:-0.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，基本面对债市依然存在正面支撑，经济企稳仍需时间和政策的配合，总需求疲弱的背景下，出现持续通胀压力的概率不大，但收益率相对前期已至低位，进一步趋势行情的出现需要政策和基本面的催化因素，阶段性博弈预期增厚组合收益的机会仍存，关注可能的财政发力以及

贸易谈判波折等带来的波段交易机会。这一过程中，将密切关注市场变化，继续关注利率债和优质商业银行金融债的投资机会，遇阶段性冲击导致的市场调整积极进行波段操作，力争增厚整体组合收益。

#### 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投资基金行业从业经验。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 2019 年 01 月 02 日为收益分配基准日，于 2019 年 01 月 17 日实施收益分配，A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.460 元，C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.426 元，合计发放红利 9,223,942.24 元。符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

#### 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

2019 半年度，基金托管人在上投摩根岁岁益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

2019 半年度，上投摩根基金管理有限公司在上投摩根岁岁益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 9,223,942.24 元，符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2019 半年度，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益定期开放债券型证券投资基金的半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	262,061.82	1,479,375.98
结算备付金		4,248,055.12	8,775,855.11
存出保证金		50,003.87	37,704.61
交易性金融资产	6.4.7.2	167,747,334.00	258,415,825.33
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		167,747,334.00	258,415,825.33
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	2,917,513.96
应收利息	6.4.7.5	2,539,532.65	6,958,624.56
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		174,846,987.46	278,584,899.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款	6.4.7.3	68,299,835.00	67,300,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		26,101.50	53,488.61
应付托管费		8,700.50	17,829.53
应付销售服务费		67.90	58.55
应付交易费用	6.4.7.7	38,270.31	103,125.52
应交税费		-	26,443.90
应付利息		17,870.37	-12,584.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	165,634.75	140,000.00
负债合计		68,556,480.33	67,628,362.00
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	103,775,291.50	200,534,432.39
未分配利润	6.4.7.10	2,515,215.63	10,422,105.16
所有者权益合计		106,290,507.13	210,956,537.55
负债和所有者权益总计		174,846,987.46	278,584,899.55

注：报告截止日 2019 年 06 月 30 日,基金份额总额 103,775,291.50 份,其中:

A 类,基金份额净值 1.0242 元,基金份额 103,543,240.16 份,

C 类,基金份额净值 1.0212 元,基金份额 232,051.34 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 25 日（基 金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>2,786,436.47</b>	<b>4,133,980.44</b>
1.利息收入		3,142,476.60	4,225,783.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	125,283.86	90,123.16
债券利息收入		3,002,305.24	3,966,538.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14,887.50	169,121.51
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,282,899.84	-6,378.13



其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,282,899.84	-6,378.13
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,639,695.94	-85,424.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	755.97	-
<b>减：二、费用</b>		<b>971,640.76</b>	<b>1,394,978.32</b>
1. 管理人报酬		172,383.06	258,673.95
2. 托管费		57,461.00	86,224.63
3. 销售服务费		386.90	283.97
4. 交易费用	6.4.7.18	88,493.97	55,131.21
5. 利息支出		545,755.66	909,694.47
其中：卖出回购金融资产支出		545,755.66	909,694.47
6.税金及附加		2,086.79	13,235.15
7. 其他费用	6.4.7.19	105,073.38	71,734.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,814,795.71</b>	<b>2,739,002.12</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,814,795.71</b>	<b>2,739,002.12</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）	200,534,432.39	10,422,105.16	210,956,537.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,814,795.71	1,814,795.71
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）	-96,759,140.89	-497,743.00	-97,256,883.89
其中：1.基金申购款	103,451,289.03	1,294,220.11	104,745,509.14
2.基金赎回款	-200,210,429.92	-1,791,963.11	-202,002,393.03

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）	-	-9,223,942.24	-9,223,942.24
五、期末所有者权益（基金净值）	103,775,291.50	2,515,215.63	106,290,507.13
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 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）	200,534,432.39	-	200,534,432.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,739,002.12	2,739,002.12
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	200,534,432.39	2,739,002.12	203,273,434.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王大智，主管会计工作负责人：杨怡，会计机构负责人：张璐

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]598 号《关于准予上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金注册的批复》核准，由上投摩根基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型、定期开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,514,655.20 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0030 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月

25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,534,432.39 份基金份额，其中认购资金利息折合 19,777.19 份基金份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时，收取认购/申购费用的，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值并分别公告。投资人可自由选择认购/申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，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、证券公司短期公司债、地方政府债、次级债、短期融资券、超短期融资券、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、同业存单、银行存款等固定收益品种以及法律法规或中国证监会允许基金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，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。本基金的投资组合比例为：债券投资比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，本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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债总指数。

本财务报表由本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于 2019 年 8 月 23 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根岁岁益定期开放债券型证券

投资基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2019 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品

管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	262,061.82
定期存款	-
其他存款	-
合计	262,061.82

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	59,773,167.60	59,848,334.00	75,166.40
	银行间市场	108,163,400.76	107,899,000.00	-264,400.76
	合计	167,936,568.36	167,747,334.00	-189,234.36
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		167,936,568.36	167,747,334.00	-189,234.36

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	84.95
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,911.70
应收债券利息	2,537,513.50
应收买入返售证券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	22.50
合计	2,539,532.65

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	29,537.81
银行间市场应付交易费用	8,732.50

合计	38,270.31
----	-----------

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
其他应付款	-
应付指数使用费	-
预提费用	165,634.75
合计	165,634.75

#### 6.4.7.9 实收基金

上投摩根岁岁益定期开放债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	200,345,749.21	200,345,749.21
本期申购	103,391,513.45	103,391,513.45
本期赎回（以“-”号填列）	-200,194,022.50	-200,194,022.50
本期末	103,543,240.16	103,543,240.16

上投摩根岁岁益定期开放债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	188,683.18	188,683.18
本期申购	59,775.58	59,775.58
本期赎回（以“-”号填列）	-16,407.42	-16,407.42
本期末	232,051.34	232,051.34

#### 6.4.7.10 未分配利润

## 上投摩根岁岁益定期开放债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,963,844.54	1,449,099.92	10,412,944.46
本期利润	3,449,367.15	-1,637,936.84	1,811,430.31
本期基金份额交易产生的变动数	-545,061.37	46,886.80	-498,174.57
其中：基金申购款	1,248,515.90	45,111.63	1,293,627.53
基金赎回款	-1,793,577.27	1,775.17	-1,791,802.10
本期已分配利润	-9,215,904.37	-	-9,215,904.37
本期末	2,652,245.95	-141,950.12	2,510,295.83

## 上投摩根岁岁益定期开放债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,799.04	1,361.66	9,160.70
本期利润	5,124.50	-1,759.10	3,365.40
本期基金份额交易产生的变动数	456.34	-24.77	431.57
其中：基金申购款	623.28	-30.70	592.58
基金赎回款	-166.94	5.93	-161.01
本期已分配利润	-8,037.87	-	-8,037.87
本期末	5,342.01	-422.21	4,919.80

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	96,374.08
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	28,436.76
其他	473.02
合计	125,283.86

## 6.4.7.12 股票投资收益

无。

## 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日



卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	630,875,875.61
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	614,901,389.95
减：应收利息总额	14,691,585.82
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,282,899.84

**6.4.7.14 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.15 股利收益**

无。

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	-1,639,695.94
——股票投资	-
——债券投资	-1,639,695.94
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-1,639,695.94

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	755.97
合计	755.97

注：无。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	80,256.47
银行间市场交易费用	8,237.50
合计	88,493.97

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	55,881.97
银行费用	838.63
债券帐户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	105,073.38

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

无。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
上投摩根基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金代销机构

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

无

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月25日（基金合同生效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	172,383.06	258,673.95
其中：支付销售机构的客户维护费	2,400.46	190.58

注：支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.3% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月25日（基金合同生效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	57,461.00	86,224.63

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	上投摩根岁岁益定期开放债券 A	上投摩根岁岁益定期开放债券 C	合计
上投摩根基金管理有 限公司	-	50.67	50.67
交通银行	-	205.24	205.24
合计	-	255.91	255.91
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018年1月25日（基金合同生效日）至2018年6月30日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	上投摩根岁岁益定期开放债券A	上投摩根岁岁益定期开放债券C	合计
上投摩根基金管理有 限公司	-	43.25	43.25
交通银行	-	117.81	117.81
合计	-	161.06	161.06

注：1. 基金销售服务费对 C 类基金份额收取。

2. 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 0.35% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给上投摩根基金管理有限公司，再由上投摩根基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额资产净值} \times 0.35\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

上投摩根岁岁益定期开放债券 A

份额单位：份

关联方名称	上投摩根岁岁益定期开放债券A本期末 2019年6月30日		上投摩根岁岁益定期开放债券A上年度 末 2018年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
上海信托	-	-	30,003,850.00	14.96%

##### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月25日（基金合同生效 日）至2018年6月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	262,061.82	96,374.08	193,661.54	66,892.30

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

##### 6.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

上投摩根岁岁益定期开放债券 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2019-01-16	-	2019- 01-16	0.460	9,214,666.59	1,237.78	9,215,904.37	-
合计				0.460	9,214,666.59	1,237.78	9,215,904.37	-

上投摩根岁岁益定期开放债券 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总	利润分配合 计	备注
----	-------	-----	----------------	--------------	--------------	------------	----

		场 内	场 外	分红数		额		
1	2019-01-16	-	2019-01-16	0.426	7,969.71	68.16	8,037.87	-
合计				0.426	7,969.71	68.16	8,037.87	-

#### 6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 29,999,835.00 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
140210	14 国开 10	2019-07-05	104.36	300,000.00	31,308,000.00
合计				300,000.00	31,308,000.00

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 38,300,000.00 元，于 2019 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型证券投资基金，属于较低风险品种。本基金投资范围为固定收益类金融工具。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本

基金在风险和收益之间取得平衡以实现“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”的风险收益目标。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律，法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监督和风险评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管并提出内控建议。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年末 2018年12月31日
A-1	-	30,328,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	30,214,000.00
合计	-	60,542,000.00

注：未评级的债券为短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年末 2018年12月31日
AAA	15,283,000.00	68,355,433.03
AAA 以下	-	12,597,808.40
未评级	152,464,334.00	116,920,583.90
合计	167,747,334.00	197,873,825.33

注：未评级的债券为国债和政策性金融债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可定期要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放申赎期间每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金



的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2019 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 68,299,835.00 元将在 2019 年 7 月 5 日以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动

性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	262,061.82	-	-	-	262,061.82
结算备付金	4,248,055.12	-	-	-	4,248,055.12
存出保证金	50,003.87	-	-	-	50,003.87
交易性金融资产	6,060,600.00	161,686,734.00	-	-	167,747,334.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	2,539,532.65	2,539,532.65
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,620,720.81	161,686,734.00	-	2,539,532.65	174,846,987.46
负债					
卖出回购金融 融资产款	68,299,835.00	-	-	-	68,299,835.00
应付证券清 算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	26,101.50	26,101.50
应付托管费	-	-	-	8,700.50	8,700.50
应付销售服 务费	-	-	-	67.90	67.90
应付交易费 用	-	-	-	38,270.31	38,270.31
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	17,870.37	17,870.37
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	165,634.75	165,634.75
负债总计	68,299,835.00	-	-	256,645.33	68,556,480.33
利率敏感 度缺口	-57,679,114.19	161,686,734.00	-	2,282,887.32	106,290,507.13
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,479,375.98	-	-	-	1,479,375.98
结算备付金	8,775,855.11	-	-	-	8,775,855.11
存出保证金	37,704.61	-	-	-	37,704.61
交易性金融 资产	121,963,291.43	103,733,406.90	32,719,127.00	-	258,415,825.33
应收证券清 算款	-	-	-	2,917,513.96	2,917,513.96
应收利息	-	-	-	6,958,624.56	6,958,624.56

资产总计	132,256,227.13				
		103,733,406.90	32,719,127.00	9,876,138.52	278,584,899.55
负债					
卖出回购金融 资产款	67,300,000.00	-	-	-	67,300,000.00
应付管理人 报酬	-	-	-	53,488.61	53,488.61
应付托管费	-	-	-	17,829.53	17,829.53
应付销售服 务费	-	-	-	58.55	58.55
应付交易费 用	-	-	-	103,125.52	103,125.52
应交税费	-	-	-	26,443.90	26,443.90
应付利息	-	-	-	-12,584.11	-12,584.11
其他负债	-	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	67,300,000.00	-	-	328,362.00	67,628,362.00
利率敏感 度缺口	64,956,227.13	103,733,406.90	32,719,127.00	9,547,776.52	210,956,537.55

表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末	上年度末
		2019年6月30日	2018年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	增加约194	增加约152
	2.市场利率上升25个基点	减少约194	减少约150

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	167,747,334.00	95.94
	其中：债券	167,747,334.00	95.94
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,510,116.94	2.58
8	其他各项资产	2,589,536.52	1.48
9	合计	174,846,987.46	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

**7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细**

本基金本报告期末未持有股票。

**7.4 报告期内股票投资组合的重大变动****7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

本基金本报告期末未持有股票。

**7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

本基金本报告期末未持有股票。

**7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

本基金本报告期末未持有股票。

**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	7,499,952.00	7.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	160,247,382.00	150.76
	其中：政策性金融债	144,964,382.00	136.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	167,747,334.00	157.82

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	140210	14 国开 10	300,000	31,308,000.00	29.46
2	180203	18 国开 03	300,000	30,780,000.00	28.96
3	180208	18 国开 08	300,000	30,528,000.00	28.72
4	018007	国开 1801	278,300	28,072,121.00	26.41
5	018006	国开 1702	178,410	18,215,661.00	17.14

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 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。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

##### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	50,003.87
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	2,539,532.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,589,536.52

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
上投摩根岁岁益定期开放债券 A	95	1,089,928.84	99,737,118.40	96.32%	3,806,121.76	3.68%
上投摩根岁岁益定期开放债券 C	241	962.87	0.00	0.00%	232,051.34	100.00%
合计	336	308,855.03	99,737,118.40	96.11%	4,038,173.10	3.89%



**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	上投摩根岁岁益定期开放债券 A	2,087.54	0.0020%
	上投摩根岁岁益定期开放债券 C	4,512.41	1.9446%
	合计	6,599.95	0.0064%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	上投摩根岁岁益定期开放债券 A	0
	上投摩根岁岁益定期开放债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	上投摩根岁岁益定期开放债券 A	0
	上投摩根岁岁益定期开放债券 C	0
	合计	0

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	上投摩根岁岁益定期开放债券 A	上投摩根岁岁益定期开放债券 C
基金合同生效日（2018 年 1 月 25 日）基金份额总额	200,345,749.21	188,683.18
本报告期期初基金份额总额	200,345,749.21	188,683.18
本报告期基金总申购份额	103,391,513.45	59,775.58
减：本报告期基金总赎回份额	200,194,022.50	16,407.42
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	103,543,240.16	232,051.34

**10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

基金管理人：基金管理人于 2019 年 5 月 31 日公告，自 2019 年 5 月 31 日起，王大智先生担任公司总经理，章硕麟先生不再担任公司总经理。

基金托管人：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人、托管人未受稽查或处罚，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	1	-	-	2,157.74	2.71%	-
东方证券	1	-	-	77,456.86	97.29%	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 交易单元的选择标准：

1) 资本金雄厚,信誉良好。

2) 财务状况良好,经营行为规范。

3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。

4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

5) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 交易单元的选择程序：

1) 本基金管理人定期召开会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进行评估，确定选用交易单元的券商。

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议, 并通知基金托管人。

4. 本基金本期无新增席位、注销席位。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	11,601,281.09	2.86%	2,870,000.00	0.10%	-	-
东方证券	394,371,020.31	97.14%	2,825,000.00	99.90%	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金分红公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2019-01-14
2	上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告	同上	2019-01-22
3	上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2019-05-31
4	上投摩根基金管理有限公司关于旗下部分基金投资科创板的公告	同上	2019-06-22

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190128-20190226	40,000,800.00	49,376,851.67	40,000,800.00	49,376,851.67	47.58%
	2	20190301-20190630	0.00	49,376,851.67	0.00	49,376,851.67	47.58%

				7			
3	20190301-201906 30	40,000 ,800.0 0	49,376 ,851.6 7	40,000,8 00.00	49,376,851. 67	47.58%	
4	20190128-201902 26	30,000 ,350.0 0	0.00	30,000,3 50.00	0.00	0.00%	
5	20190101-201901 27	60,001 ,700.0 0	0.00	60,001,7 00.00	0.00	0.00%	
产品特有风险							
本基金的集中度风险主要体现在有单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%，如果投资者发生大额赎回，可能出现基金可变现资产无法满足投资者赎回需要以及因为资产变现成本过高导致投资者的利益受到损害的风险。							

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
2. 《上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
4. 《上投摩根开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

二〇一九年八月二十四日