

---

# 上投摩根纯债债券型证券投资基金

## 招募说明书（更新）摘要

**基金合同生效日期：2009年6月24日**

**基金管理人：上投摩根基金管理有限公司**

**基金托管人：中国工商银行股份有限公司**

**重要提示：**

1. 投资有风险，投资人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. 基金投资者购买基金并不等于将资金作为存款存入银行或者存款类金融机构，基金管理人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，并经中国证监会核准。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《基金法》、《运作办法》、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. 本招募说明书摘要根据中国证监会于2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定以及本基金的基金合同及托管协议的修订更新了相关章节，并更新了“基金管理人”章节中的相关内容，截止日为2020年3月31日；本招募说明书摘要所载其他内容截止日为2019年6月23日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2019年3月31日。

二〇二〇年四月

---

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人简况

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 25 层

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 层

法定代表人：陈兵

总经理：王大智

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有限公司 67%和摩根资产管理（英国）有限公司 33%变更为目的的 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：陈兵

博士研究生，高级经济师。

曾任上海浦东发展银行大连分行资金财务部总经理，上海浦东发展银行总行资金财务部总经理助理，上海浦东发展银行总行个人银行总部管理会计部、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，上海国际信托有限公司党委副书记、总经理。

现任上海国际信托有限公司党委书记、总经理；上投摩根基金管理有限公司董事长。

**董事：Paul Bateman**

大学本科学位。

曾任 Chase Fleming Asset Management Limited 全球总监、摩根资产管理全球投资管理业务行政总裁。

现任摩根资产管理全球主席、资产管理营运委员会成员及投资委员会成员。

**董事：Daniel J. Watkins**

学士学位。

曾任欧洲业务副首席执行官、摩根资产欧洲业务首席运营官、全球投资管理运营总监、欧洲运营总监、欧洲注册登记业务总监、卢森堡运营总监、欧洲注册登记业务及伦敦投资运营经理、富林明投资运营团队经理等职务。

现任摩根资产管理亚洲业务首席执行官、资产管理运营委员会成员、集团亚太管理团队成员。

**董事：Richard Titherington**

牛津大学政治、哲学和经济硕士学位。

曾任摩根资产管理环球新兴市场股票投资部总监。

现任摩根资产管理董事总经理、新兴市场及亚太股票组别投资总监。

**董事：王大智**

学士学位。

曾任摩根资产管理香港及中国基金业务总监、摩根投信董事长暨摩根资产管理集团台湾区负责人。

现任上投摩根基金管理有限公司总经理。

**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：丁蔚**

硕士研究生。

曾就职于中国建设银行上海分行个人银行业务部副总经理，上海浦东发展银行个人银行总部银行卡部总经理，个人银行总部副总经理兼银行卡部总经理。

现任上海浦东发展银行总行零售业务部总经理。

**董事：林仪桥**

硕士研究生、会计师、经济师。

曾任浦发银行总行资金总部投资组合业务部总经理助理，浦发银行总行金融市场部总经

理助理，海口分行行长助理(挂职)，浦发银行总行金融机构部总经理助理。

现任浦发银行总行金融机构部副总经理和金融市场部（深圳）副总经理。

独立董事：刘红忠

国际金融系经济学博士。

现任复旦大学经济学院教授，复旦大学金融研究中心副主任；同时兼任华泰证券股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、申银万国期货有限责任公司、东海期货有限责任公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事：汪棣

美国加州大学洛杉矶分校金融专业工商管理硕士学位，并先后获得美国加州注册会计师执照和中国注册会计师证书。

曾担任普华永道金融服务部合伙人及普华永道中国投资管理行业主管合伙人。

现担任招商证券股份有限公司、复星联合健康保险股份有限公司、亚太财产保险有限公司及 51 信用卡有限公司独立董事、中国台湾旭昶生物科技股份有限公司监事。

独立董事：曾翀

英国特许公认会计师公会资深会员。

曾任香港赛马会集团财务总监，香港证监会产品咨询委员会委员，协康会名誉司库和执行委员会和投资小组委员会成员，戴麟趾爵士康乐基金、警察子女教育信托基金和警察教育及福利信托基金投资咨询委员会主席，香港房屋协会资金管理特设委员会成员，以及另类投资管理协会（AIMA）全球投资者指导委员会成员。

现为独立顾问，宝积资本控股有限公司独立非执行董事以及安联环球投资香港有限公司兼职顾问。

## 2. 监事会成员基本情况：

监事会主席：赵峥嵘

硕士学位，高级经济师。

历任工商银行温州分行副行长、浦发银行温州分行副行长、行长及杭州分行行长等职务。

现任上海国际信托有限公司监事长、党委副书记。

监事：梁斌

学士学位。

曾在高伟绅律师事务所（香港）任职律师多年。

现任摩根大通集团中国法律总监。

监事：张军

曾任上投摩根基金管理有限公司交易部总监、基金经理、投资组合管理部总监、投资绩效评估总监、国际投资部总监、组合基金投资部总监。

现任上投摩根基金管理有限公司投资董事，管理上投摩根亚太优势混合型证券投资基

金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金和上投摩根全球多元配置证券投资基金（QDII）。

监事：万隽宸

曾任上海国际集团有限公司高级法务经理，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。

现任尚腾资本管理有限公司总经理。

### 3. 总经理基本情况：

王大智先生，总经理

学士学位。

曾任摩根资产管理香港及中国基金业务总监、摩根投信董事长暨摩根资产管理集团台湾地区负责人。

### 4. 其他高级管理人员情况：

杨红女士，副总经理

毕业于同济大学，获技术经济与管理博士

曾任招商银行上海分行稽核监督部业务副经理、营业部副经理兼工会主席、零售银行部副总经理、消费信贷中心总经理；曾任上海浦东发展银行上海分行个人信贷部总经理、个人银行发展管理部总经理、零售业务管理部总经理。

杜猛先生，副总经理

毕业于南京大学，获经济学硕士学位。

历任天同证券、中原证券、国信证券、中银国际研究员；上投摩根基金管理有限公司行业专家、基金经理助理、基金经理、总经理助理/国内权益投资一部总监兼资深基金经理。

孙芳女士，副总经理

毕业于华东师范大学，获世界经济学硕士学位。

历任华宝兴业基金研究员；上投摩根基金管理有限公司行业专家、基金经理助理、研究部副总监、基金经理、总经理助理/国内权益投资二部总监兼资深基金经理。

郭鹏先生，副总经理

毕业于上海财经大学，获企业管理硕士学位。

历任上投摩根基金管理有限公司市场经理、市场部副总监，产品及客户营销部总监、市场部总监兼互联网金融部总监、总经理助理。

刘鲁旦先生，副总经理。

博士研究生。

历任华夏基金管理有限公司固定收益总监、中国国际金融股份有限公司资产管理部固定收益总监/董事总经理。

邹树波先生，督察长。

获管理学学士学位。

曾任天健会计师事务所高级项目经理，上海证监局主任科员，上投摩根基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监。

#### 5. 本基金基金经理

聂曙光先生自 2004 年 8 月至 2006 年 3 月在南京银行任债券分析师；2006 年 3 月至 2009 年 9 月在兴业银行任债券投资经理；2009 年 9 月至 2014 年 5 月在中欧基金管理有限公司先后担任研究员、基金经理助理、基金经理、固定收益部总监、固定收益事业部临时负责人等职务，自 2014 年 5 月起加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任基金经理、债券投资部总监兼资深基金经理，自 2014 年 8 月起担任上投摩根纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2014 年 10 月起担任上投摩根红利回报混合型证券投资基金基金经理，自 2014 年 11 月起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 1 月起同时担任上投摩根稳进回报混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 4 月至 2018 年 11 月同时担任上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 6 月至 2020 年 1 月同时担任上投摩根优信增利债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 8 月起同时担任上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 9 月担任上投摩根岁岁丰定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2017 年 1 月至 2018 年 12 月同时担任上投摩根安瑞回报混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 4 月起同时担任上投摩根安通回报混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 9 月起同时担任上投摩根安裕回报混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 8 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和上投摩根丰瑞债券型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理王亚南先生，其任职日期为 2009 年 6 月 24 日至 2014 年 9 月 15 日。

#### 6. 基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

杜猛，副总经理兼投资总监；孙芳，副总经理兼投资副总监；刘鲁旦，副总经理兼债券投资总监；张军，投资董事、国际投资部总监、投资绩效评估总监兼高级基金经理；朱晓龙，研究部总监兼基金经理；陈圆明，绝对收益投资部总监兼基金经理；聂曙光，债券投资部总监兼资深基金经理；孟晨波，总经理助理/货币市场投资部总监兼资深基金经理；任翔，固收研究部总监兼基金经理；钟维伦，资深投资经理；刘凌云，组合基金投资部总监兼基金经理；张文峰，组合基金投资部副总监兼投资经理；孟鸣，基金经理兼资深投资组合经理；叶承焘，投资经理；陈晨，投资经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币34,932,123.46万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至2018年12月，中国工商银行资产托管部共有员工202人，平均年龄33岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年12月，中国工商银行共托管证券投资基金923只。自2003年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的64项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 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) 中国建设银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人: 田国立

客户服务电话: 95533

网址: [www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人: 易会满

客户服务统一咨询电话: 95588

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

(3) 中国农业银行股份有限公司

住所: 北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人: 周慕冰

客户服务电话: 95599

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

(4) 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

法定代表人: 陈四清

客服电话: 95566

网址: [www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(5) 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)

(6) 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: 彭纯



客户服务热线：95559

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

(7) 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：郑杨

客户服务热线：95528

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

(8) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

客服电话：95561

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

(9) 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：金煜

客户服务热线：95594

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

(10) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：李晓鹏

客服电话：95595

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

(11) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

24 小时客户服务热线：95558

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

(12) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

24 小时客户服务热线：95568

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

(13) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：张东宁

客户服务电话：95526

公司网站：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

(14) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁东路345号

法定代表人：陆华裕

客户服务统一咨询电话：95574

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

(15) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人：谢永林

客户服务统一咨询电话：95511转3

网址：[www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com)

(16) 广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

客服电话：400-830-8003

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

(17) 东莞农村商业银行股份有限公司

地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

法定代表人：王耀球

客服电话：961122

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

(18) 上海农村商业银行股份有限公司

地址：中山东二路 70 号上海农商银行大厦

法定代表人：冀光恒

门户网站：[www.srcb.com](http://www.srcb.com)

客户服务电话：021-962999

(19) 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

客服电话：95523

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

(20) 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：李琦

客户服务电话：400-800-0562

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

(21) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

客户服务电话：021-962518

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

(22) 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：上海市静安区新闸路 669 号 博华大厦 21 楼

法定代表人：杨德红

客户服务咨询电话：95521

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

(23) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(24) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

客户服务电话：95565

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

(25) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：周健男

客服热线：95525

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

(26) 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 2-6 层

法定代表人：陈共炎

客服电话：4008888888

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

(27) 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

客户服务咨询电话：400-8888-108

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

(28) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：杨华辉

客户服务热线：95562

公司网站：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(29) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客服电话：95553

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

(30) 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：翁振杰

客户服务电话：4008188118

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

(31) 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

客户服务电话: 95536

公司网址:www.guosen.com.cn

(32) 华泰证券股份有限公司

注册地址:江苏省南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人: 周易

客户咨询电话: 95597

网址: www.htsc.com.cn

(33) 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: 张佑君

客户服务热线: 95548

公司网址: www.cs.ecitic.com

(34) 东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人: 潘鑫军

客户服务热线: 95503

东方证券网站: www.dfzq.com.cn

(35) 财富证券有限责任公司

注册地址:长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

法定代表人: 蔡一兵

客服电话: 95317

公司网址: www.cfzq.com

(36) 湘财证券有限责任公司

地址:长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人: 孙永祥

客服电话: 95351

公司网址: www.xcsc.com

(37) 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: 姜晓林

客户服务电话: 95548

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

(38) 中银国际证券有限责任公司

注册地址: 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人: 宁敏

客服电话: 4006208888或各地营业网点咨询电话

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

(39) 长城证券股份有限公司

住所、办公地址: 深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层

法定代表人: 曹宏

客户服务热线: 400 6666 888

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

(40) 德邦证券股份有限公司

办公地址: 上海浦东新区福山路 500 号城建国际中心 29 楼

法定代表人: 武晓春

电话: 021-68761616

客服电话: 4008888128

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

(41) 中国中投证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层

01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址: 深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人: 高涛

客户服务热线: 95532

网址: [www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

(42) 华福证券有限责任公司

注册地址: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人: 黄金琳

客户服务热线: 0591-96326

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

(43) 中国国际金融股份有限公司

注册地址: 北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址: 北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人: 丁学东

电话：021-58881690  
公司网址：www.cicc.com.cn

(44) 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：王连志  
客服电话：95517

公司网址：www.essence.com.cn

(45) 上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 环球金融中心 9 楼  
法定代表人：陈灿辉  
客户服务电话：400-820-5999

公司网站：www.shhxzq.com

(46) 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：李新华  
客户服务热线：95579 或 4008-888-999

长江证券客户服务网站：www.95579.com

(47) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层  
办公地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层  
法定代表人：何之江  
客服电话：95511-8

网址：www.stock.pingan.com

(48) 诺亚正行基金销售有限公司

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

(49) 上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室  
办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层  
法定代表人：张跃伟  
客服电话：400-820-2899

公司网站: [www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(50) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址: 北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址: 北京市朝阳区安苑路11号邮电新闻大厦6层

法定代表人: 闫振杰

客服电话: 400-818-8000

公司网站: [www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(51) 上海华夏财富投资管理有限公司

住所: 上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

办公地址: 北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人: 毛淮平

客户服务电话: 400-817-5666

(52) 上海万得基金销售有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址: 上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人: 王廷富

客户服务电话: 400-799-1888

网址: [www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(53) 嘉实财富管理有限公司

住所: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元

法定代表人: 赵学军

客服电话: 400-021-8850

网站: [www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

(54) 上海基煜基金销售有限公司

办公地址: 上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人: 王翔

咨询电话: 400-820-5369

网站: [www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

(55) 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](http://www.ehowbuy.com)



(56) 深圳众禄基金销售股份有限公司

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](http://www.zlfund.cn) [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(57) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6 楼

法定代表人：祖国明

客服电话：400-0766-123

公司网站：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(58) 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](http://www.1234567.com.cn)

(59) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼

法定代表人：凌顺平

客服电话：4008-773-772

公司网站：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(60) 上海陆金所基金销售有限公司

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：胡学勤

客服电话：400-821-9031

网站：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(61) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：郑毓栋

客服电话：400-618-0707

网站： [www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

(62) 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](http://www.yingmi.cn)

(63) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

法定代表人：李昭琛

客服电话：010-62675369

网站： [www.xincai.com](http://www.xincai.com)

(64) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部

法定代表人：江卉

客服电话：4000988511/4000888816

网址： <http://fund.jd.com/>

(65) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

客服电话：4008-909-998

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

(66) 奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

客服电话：400-684-0500

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

(67) 腾安基金销售(深圳)有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15层

法定代表人：刘明君

客户服务热线：95017

公司网站：[www.tenganxinxi.com/www.txfund.com](http://www.tenganxinxi.com/www.txfund.com)

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，并在基金管理人网站公示。

(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：国浩律师集团(上海)事务所

注册地址：上海市南京西路580号南证大厦31层

负责人：管建军

联系电话：021-5234 1668

传真：021-5234 1670

经办律师：宣伟华

(四) 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：沈兆杰

经办注册会计师：薛竞、沈兆杰

#### 四、基金概况

基金名称：上投摩根纯债债券型证券投资基金

基金类型：契约型开放式

## 五、基金的申购与赎回

### 1、申购费率

类基金份额的申购费率具体如下：

购买金额（M）	申购费率
M<100 万	0.80%
100 万≤M<500 万	0.40%
M≥500 万	1000 元/笔

B 类基金份额的申购费率为 0。

### 2、赎回费用

本基金赎回费用按持有人持有该部分基金份额的时间分段，不同类型基金份额的赎回费率如下：

A 类基金份额：

持有时间（N）	赎回费率
N<7 天	1.5%
7 天≤N<1 年	0.1%
1 年≤N<2 年	0.05%
N≥2 年	0

B 类基金份额：

持有时间（N）	赎回费率
N<7 天	1.5%
7 天≤N<30 天	0.1%
N≥30 天	0

### 3、基金的转换

为方便基金份额持有人，投资者可以依照基金管理人的有关规定选择在本基金和本基金管理人管理的其他基金之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定并公告。

## 六、基金的投资

### （一）投资目标

本基金将根据对利率趋势的预判，适时规划与调整组合目标久期，结合主动性资产配置，在严格控制组合投资风险的同时，提高基金资产流动性与收益性水平，以追求超过业绩比较基

准的投资回报。

## （二）投资范围

本基金投资于国债、金融债、公司债、企业债、可转换公司债券（包括分离交易的可转换公司债券）、债券回购，央行票据、短期融资券、资产支持证券等，以及中国证监会允许基金投资的其它固定收益类金融工具。本基金投资于债券类金融工具的比例不低于基金资产的80%。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发。本基金通过分离交易可转债认购所获得的认股权证，在其可上市交易后10个交易日内全部卖出。本基金所持可转换公司债券转股获得的股票在其可上市交易后的10个交易日内全部卖出。

此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

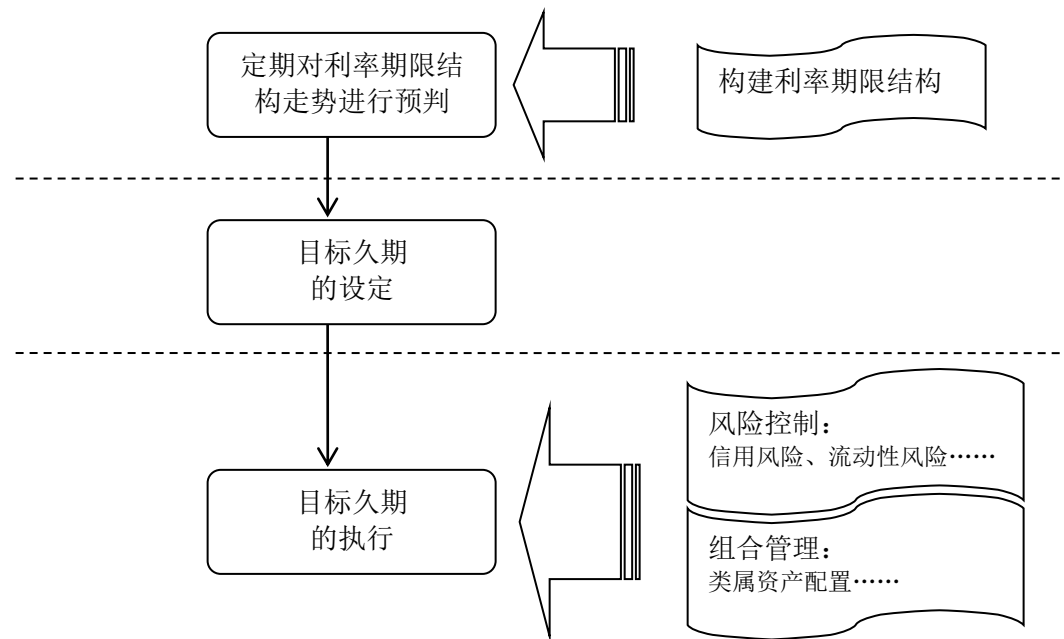
## （三）投资理念

目标久期管理将优化固定收益投资的安全性、收益性与流动性。本基金严格遵循投资流程，对宏观经济、财政货币政策、市场利率水平及债券发行主体的信用情况等因素进行深入研究，通过审慎把握利率期限结构的变动趋势，适时制定目标久期管理计划，通过合理的资产配置及组合目标久期管理，控制投资风险，追求可持续的、超出业绩比较基准的投资收益。

## （四）投资策略

### 1、目标久期管理（Target Duration Management）

目标久期管理的资产品种包括在交易所和银行间市场中发行交易的国债、公司债、企业债、金融债等债券品种。本基金债券投资的主动性操作主要体现在对债券组合进行目标久期管理这一过程。本基金将综合考虑宏观经济运行指标、货币市场运行情况、国家财政货币政策动向等因素，由固定收益研究小组对债券市场利率期限结构的变化做出合理预判。在此判断基础上，本基金将对债券组合的久期做出适当调整，同时结合对信用风险、流动性风险等各类风险识别与控制，优化类属资产配置与品种选择。具体而言，目标久期管理将包含以下内容：



(1) 目标久期设定的依据是对利率期限结构的预判

当前利率期限结构的构建:

本基金将根据国债市场各个券种的价格, 计算各个券种的到期收益率, 进而分别在银行间市场和交易所市场中构建出国债利率期限结构。

对利率期限结构走势的预判:

本基金将密切关注国内外经济形势的运行, 根据市场投资环境的变化趋势, 综合考虑宏观经济运行指标、货币市场运行情况、国家财政货币政策动向等因素, 由固定收益研究小组每月定期对各个时间段利率的变化做出合理预期, 从而形成利率期限结构的预判 (在特殊情况下, 固定收益小组在认为利率期限结构可能会发生重大变化时, 可以临时对利率期限结构的走势给出评测报告)。

预判形成后, 将对实际利率期限结构和预判结果进行比较, 如固定收益研究小组认为必要, 将对预判结果做出一定的修正。

(2) 目标久期规划

久期又称麦考利久期 (Macaulay Duration), 反映了债券价格相对于市场利率变动的一个敏感性指标。为了更好显示其特性, 实际中往往对麦考利久期进行修正, 得到修正久期, 本基金将采用修正久期的定义。

久期管理是现代固定收益管理中重要的利率投资策略。根据对利率期限结构变化的预判, 本基金将对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案, 以降低可能的利率变化给组合带来的损失。具体久期目标的确定将视利率期限结构变化方向而定, 例如在预计利率期限结构可能变的更加陡峭时, 不久的将来长期债券的价格可能会由于长期利率的上升而下跌, 短期债券的价格可能会由于短期利率的下降而上涨, 因此可制定适量降低组合久期的目标, 增加

对短期债券的投资，同时减少对长期债券的投资。

此外，本基金将定期根据固定收益小组对利率期限结构的预判结果，制定相应的久期目标，尽量避免基金资产因利率波动而造成的损失。特殊情况下，固定收益小组对利率期限结构给出临时评测报告的时候，本基金将视评测报告内容以确定是否对目标久期进行调整。

### （3）目标久期的执行

根据当前目标久期的设定情况，本基金将采取相应的措施，调整债券组合的久期及持仓结构，实现目标久期。在目标久期的执行过程中，需要特别注意对信用风险、流动性风险及类属资产配置的管理，以使得组合的各种风险在控制范围之内。

信用风险管理：

对于存在信用风险的公司债，信用风险是评判其收益率溢价大小的重要因素，本基金将采用一定的风险分析模型来确定债券的信用水平，同时根据市场中现有的总体风险溢价水平，以确定该信用水平下的债券的合理估值。

流动性风险管理：

流动性是资金能否顺利进出该债券的关键，本基金将综合考虑历史成交量、历史盘口买卖价差等因素，对各债券每日无冲击买卖数量做出合理的评估。

类属资产配置管理：

在类属资产配置层面上，本基金根据市场和类属资产的信用水平，在判断各类属的利率期限结构与国债利率期限结构应具有合理利差水平基础上，将市场细分为交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债等子市场。结合各类属资产的市场容量、信用等级和流动性特点，在目标久期管理的基础上，运用修正的均值-方差等模型，定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。

## 2、可转换公司债券（包括分离交易可转债）的投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对发债券公司基本面和可转债条款进行深入研究的基础上，以其纯债价值作为评价的主要标准，利用可转换公司债券定价等数量化估值工具评定其投资价值，投资于公司基本素质优良、具有较高安全边际和良好流动性的可转换公司债券，获取稳健的投资回报。

### （1）投资可转换公司债券时，本基金重点关注以下品种：

选取可转换公司债券的实际价格较理论价值偏低的品种。可转债实际价值与理论估值相比较低的品种，可以认为是市场更多地低估了其价值，因而相对风险较低。本基金从规避风险的角度出发，重点关注此类品种。

选择纯债券价值高，有利率调整条款的品种。此类可转换公司债券一般提供了较高的保底收益，利率调整条款的存在可使投资者回避利率变动的风险，锁定收益。

关注满足向下修正条款的可转债。对于股票价格位于修正条款所规定修正价格区域的转债品种，主要受纯债券价值的支撑，表现出强烈的抗跌性，而且由于存在转股价格向下调整而增加可转债的价值。

重点关注发债公司基本面良好的可转换债券。

本基金投资可转换公司债券时主要考察纯债券部分的价值，但当存在明显的市场套利机会时或通过转股后能有效保障或提升基金份额持有人利益等情形时，本基金将把相关的可转换公司债券转换为股票，并在其可上市交易后的 10 个交易日内卖出。

#### （2）分离交易可转债的投资策略

本基金投资分离交易可转债主要是通过网下申购和网上申购的方式。在分离交易可转债的认股权证可上市交易后的 10 个交易日内全部卖出，分离后的公司债券作为普通的企业债券进行投资。

### 3. 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各个分支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。

#### （五）投资限制

##### 1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1) 承销证券；
- 2) 向他人贷款或提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- 5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- 6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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

##### 2、投资组合限制



本基金的投资组合将遵循以下限制：

- a、持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- b、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- c、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%；
- d、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；
- e、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- f、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%；
- g、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%；
- h、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%；
- i、本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- j、本基金对债券类金融工具的投资比例不低于基金资产的 80%；
- k、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%。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；
- l、本基金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的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
- m、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，除上述第 e、k、l 项外，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

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。除投资资产配置比例外，基金托管人对基金的投资比例的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

#### （六）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中国债券总指数。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于2001年12月31日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势，测算债券投资回报率水平，判断债券供求动向提供了很好的依据。因此，本基金的业绩比较基准选择中国债券总指数。中国债券总指数通过中央国债登记结算有限责任公司的官方网站 [www.chinabond.com.cn](http://www.chinabond.com.cn) 对外公布。

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债券指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

#### （七）风险收益特征

本基金是债券型基金，在证券投资基金中属于较低风险品种，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于货币市场基金。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。

#### （八）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金财产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金投资者的利益。

#### （九）基金的融资融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

#### （十）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	1,214,850,947.53	93.19
	其中：债券	1,214,850,947.53	93.19

	资产支持证券	-	-
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	66,263,190.60	5.08
7	其他各项资产	22,475,452.68	1.72
8	合计	1,303,589,590.81	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	33,889,754.00	2.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	921,288,579.90	77.45
	其中：政策性金融债	820,853,579.90	69.00
4	企业债券	72,977,172.03	6.13
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	52,894,600.00	4.45
7	可转债（可交换债）	133,800,841.60	11.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,214,850,947.53	102.12

## 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	180208	18国开08	2,500,000	255,350,000.00	21.47
2	180211	18国开11	1,500,000	152,115,000.00	12.79
3	180212	18国开12	1,200,000	121,752,000.00	10.23
4	180204	18国开04	700,000	73,325,000.00	6.16
5	180203	18国开03	700,000	72,184,000.00	6.07

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7、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没有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、处罚的情况。

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。

3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	26,024.46
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	22,150,758.39
5	应收申购款	298,669.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,475,452.68

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123006	东财转债	16,468,896.50	1.38
2	128016	雨虹转债	16,197,459.30	1.36
3	128035	大族转债	15,440,718.30	1.30
4	128024	宁行转债	13,895,757.90	1.17
5	113011	光大转债	7,324,111.20	0.62
6	113018	常熟转债	7,247,127.20	0.61
7	110042	航电转债	5,828,878.50	0.49
8	113014	林洋转债	4,822,345.30	0.41
9	113516	吴银转债	4,494,236.80	0.38
10	132015	18 中油 EB	4,030,856.40	0.34
11	128041	盛路转债	3,967,482.00	0.33
12	110038	济川转债	2,643,415.40	0.22
13	113517	曙光转债	2,504,600.00	0.21
14	132013	17 宝武 EB	2,041,400.00	0.17
15	127005	长证转债	1,724,850.00	0.14
16	128015	久其转债	1,551,752.20	0.13
17	123009	星源转债	1,396,379.40	0.12
18	113518	顾家转债	1,228,300.00	0.10
19	113013	国君转债	1,184,100.00	0.10
20	128020	水晶转债	1,119,500.00	0.09
21	128029	太阳转债	1,099,000.00	0.09

22	123003	蓝思转债	1,072,200.00	0.09
23	113511	千禾转债	555,050.00	0.05
24	110043	无锡转债	549,000.00	0.05
25	110031	航信转债	136,676.60	0.01
26	113512	景旺转债	3,875.10	0.00

5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票无流通受限情况

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。

## 七、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。

### (一) 上投摩根纯债债券 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
2009/06/24-2009/12/31	1.20%	0.04%	-1.58%	0.05%	2.78%	-0.01%
2010/01/01-2010/12/31	2.37%	0.06%	-0.87%	0.10%	3.24%	-0.04%
2011/01/01-2011/12/31	-0.29%	0.16%	2.52%	0.11%	-2.81%	0.05%
2012/01/01-2012/12/31	2.81%	0.11%	-0.67%	0.07%	3.48%	0.04%
2013/01/01-2013/12/31	1.41%	0.13%	-5.28%	0.11%	6.69%	0.02%
2014/01/01-2014/12/31	15.78%	0.23%	7.48%	0.15%	8.30%	0.08%
2015/01/01-2015/12/31	10.10%	0.26%	4.51%	0.12%	5.59%	0.14%
2016/01/01-2016/12/31	0.80%	0.07%	-1.80%	0.13%	2.60%	-0.06%
2017/01/01-2017/12/31	2.38%	0.03%	-4.26%	0.09%	6.64%	-0.06%
2018/01/01-2018/12/31	4.07%	0.06%	6.17%	0.11%	-2.10%	-0.05%
2019/01/01-2019/03/31	2.01%	0.13%	0.15%	0.09%	1.86%	0.04%

### (二) 上投摩根纯债债券 B:

阶段	净值增长率	净值增长率	业绩比较基准	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	--------	-------	-----	-----

	①	标准差②	收益率③	准收益率标 准差④		
2009/06/24-2009/12/31	0.90%	0.03%	-1.58%	0.05%	2.48%	-0.02%
2010/01/01-2010/12/31	1.98%	0.06%	-0.87%	0.10%	2.85%	-0.04%
2011/01/01-2011/12/31	-0.68%	0.16%	2.52%	0.11%	-3.20%	0.05%
2012/01/01-2012/12/31	2.35%	0.11%	-0.67%	0.07%	3.02%	0.04%
2013/01/01-2013/12/31	1.05%	0.13%	-5.28%	0.11%	6.33%	0.02%
2014/01/01-2014/12/31	15.33%	0.24%	7.48%	0.15%	7.85%	0.09%
2015/01/01-2015/12/31	9.68%	0.26%	4.51%	0.12%	5.17%	0.14%
2016/01/01-2016/12/31	0.37%	0.07%	-1.80%	0.13%	2.17%	-0.06%
2017/01/01-2017/12/31	2.01%	0.04%	-4.26%	0.09%	6.27%	-0.05%
2018/01/01-2018/12/31	3.70%	0.06%	6.17%	0.11%	-2.47%	-0.05%
2019/01/01-2019/03/31	1.88%	0.13%	0.15%	0.09%	1.73%	0.04%

## 八、基金费用概览

### （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、销售服务费；
  - 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
  - 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
  - 6、基金份额持有人大会费用；
  - 7、基金的证券交易费用；
  - 8、基金的银行汇划费用；
  - 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。
- 本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### （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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3. 基金销售服务费

本基金管理人仅对 B 类基金份额收取基金销售服务费。销售服务费按 0.35% 的年费率计提，具体的计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日 B 类基金份额所代表的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付，由基金管理人代收，基金管理人收到后支付给基金销售机构，专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

### （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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 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

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。



调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在指定媒体和基金管理人网站上公告。

#### （五）基金税收

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。

### 九、招募说明书更新部分说明

上投摩根纯债债券型证券投资基金于 2009 年 6 月 24 日成立。现依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集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 2019 年 8 月 7 日公告的《上投摩根纯债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. 本基金招募说明书根据中国证监会于 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定以及本基金的基金合同及托管协议的修订更新了相关章节。
2. 在重要提示中，对招募说明书所载内容的截止日进行了更新。
3. 在“三、基金管理人”中，对基金管理人的相关信息进行了更新。

上投摩根基金管理有限公司

2020 年 4 月