上投摩根纯债添利债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十七日

1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月24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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	上投摩根纯债添利债券	
基金主代码	000889	
交易代码	000889	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年12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	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,327,999.27份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	上投摩根纯债添利债券A类	上投摩根纯债添利债券C类
下属分级基金的交易代码	000889	000890
报告期末下属分级基金的份额总额	8,003,207.41份	3,324,791.86份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动地投资管理，力争实现长期稳定的投资回报。
投资策略	在实际操作中，本基金将采用自上而下的方法，对宏观经济形势和货币政策进行分析，并结合债券市场供需状况、市场流动性水平等重要市场指标，对不同债券板块之间的相对投资价值进行考量，确定债券类属配置策略，并根据市场变化及时进行调整，从而选择既能匹配目标久期、同时又能获得较高持有期收益的类属债券配置比例。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。
业绩比较基准	中证综合债券指数
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，其预期风险与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。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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡迪	田青
	联系电话	021-38794888	010-67595096
	电子邮箱	services@cifm.com	tianqing1zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-4888	010-67595096
传真		021-20628400	010-66275853

2.4 信息披露方式

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、基金托管人的办公场所

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（2018年1月1日至2018年6月30日）	
	上投摩根纯债添利债券A类	上投摩根纯债添利债券C类
本期已实现收益	2,849,892.48	22,623.28
本期利润	8,995,887.82	77,628.30
加权平均基金份额本期利润	0.0206	0.0224
本期基金份额净值增长率	5.26%	2.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018年6月30日）	
	上投摩根纯债添利债券A类	上投摩根纯债添利债券C类
期末可供分配基金份额利润	0.0341	0.0044
期末基金资产净值	8,470,455.60	3,418,242.54
期末基金份额净值	1.058	1.028

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

上投摩根纯债添利债券A类

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	3.22%	0.69%	0.61%	0.05%	2.61%	0.64%
过去三个月	3.82%	0.40%	1.97%	0.09%	1.85%	0.31%
过去六个月	5.26%	0.29%	4.04%	0.07%	1.22%	0.22%
过去一年	5.99%	0.20%	4.20%	0.06%	1.79%	0.14%
过去三年	8.98%	0.18%	11.00%	0.07%	-2.02%	0.11%
自基金合同生效起至今	12.58%	0.24%	13.90%	0.07%	-1.32%	0.17%

上投摩根纯债添利债券C类

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	0.29%	0.06%	0.61%	0.05%	-0.32%	0.01%
过去三个月	0.88%	0.06%	1.97%	0.09%	-1.09%	-0.03%
过去六个月	2.18%	0.05%	4.04%	0.07%	-1.86%	-0.02%
过去一年	2.59%	0.05%	4.20%	0.06%	-1.61%	-0.01%
过去三年	4.66%	0.14%	11.00%	0.07%	-6.34%	0.07%
自基金合同生效起至今	7.80%	0.21%	13.90%	0.07%	-6.10%	0.14%

注：本基金的业绩比较基准于2015年10月10日由原"中信标普全债指数"变更为："中证综合债券指数收益率"。

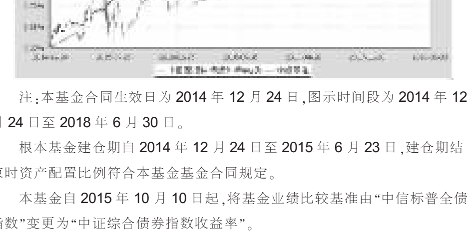
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根纯债添利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

（2014年12月24日至2018年6月30日）

上投摩根纯债添利债券A类



注：本基金合同生效日为2014年12月24日，图示时间段为2014年12月24日至2018年6月30日。

根本基金建仓期自2014年12月24日至2015年6月23日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金自2015年10月10日起，将基金业绩比较基准由"中信标普全债指数"变更为"中证综合债券指数收益率"。

上投摩根纯债添利债券C类

注：本基金合同生效日为2014年12月24日，图示时间段为2014年12月24日至2018年6月30日。

根本基金建仓期自2014年12月24日至2015年6月23日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金自2015年10月10日起，将基金业绩比较基准由"中信标普全债指数"变更为"中证综合债券指数收益率"。

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2018年6月底，公司管理的基金共有六十七只，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、上投摩根轮动添利债券型证券投资基金、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、上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金、上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金、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、上投摩根现金管理货币市场基金、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、上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、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、上投摩根岁岁丰定期开放债券型证券投资基金、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、上投摩根安泽回报混合型证券投资基金、上投摩根安瑞回报混合型证券投资基金、上投摩根岁岁金定期开放债券型证券投资基金、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及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、上投摩根安腾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。

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 任职日期	任本基金的基金经理（助理）期限 离任日期	证券从业年限	说明
刘阳	本基金基金经理	2016-04-01	-	7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；自2015年12月至2017年8月担任上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金，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及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月起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。
唐瑭	本基金基金经理	2016-06-03	-	10年	唐瑭女士，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，自2016年8月起同时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月起同时担任上投摩根安丰回报混合型证券投资基金基金经理及上投摩根安泽回报混合型证券投资基金基金经理，自2018年2月起同时担任上投摩根安隆回报混合型证券投资基金和上投摩根安腾回报混合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.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遵规守信情况的说明

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。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根纯债添利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，公司未发现存在异常交易行为。

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%的情形：无。

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

上半年，经济增长缓步下行、通胀平稳，整体环境有利于债券市场。但随着央行货币边际放松，资金利率持续维持在较低水平，以及意料之外的中美贸易摩擦不断升级，债券市场收益率出现明显下行。受到民营企业信用负面事件影响，市场对于中低等级、民营企业债券普遍规避，信用债流动性快速下降，信用利差扩大明显。在此背景下，本基金在报告期内一方面拉长组合久期，一方面提高了整体组合的信用等级。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A类份额净值增长率为5.26%，本基金C类基金份额净值增长率为2.18%，同期业绩比较基准收益率为4.04%。

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，经济增长的疲态逐步显现，信用利差长期居于高位将实质性影响到企业的再融资和经营，中国经济将在内外压力的推动下加快转型升级。在这一背景下债市仍然具备配置价值。同时，随着政策上对中小微企业融资更加重视，信用风险的逐步释放将为信用债投资带来新的机会，但这一过程尚需严格的观察和考证。转债方面，转债和正股估值均处于历史相对低位，市场情绪脆弱，但随着货币政策和财政政策发力，风险偏好的回升将阶段性带来权益市场和可转债市场的投资机会。基于以上分析，本基金将保持偏乐观的仓位和久期，转债方面优选个券，把握转债市场的投资机会。

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2018年04月16日为收益分配基准日，于2018年04月17日实施收益分配，A类份额每10份基金份额派发红利0.10元，C类份额每10份基金份额派发红利0.03元，合计发放红利4,476,109.00元。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配4,476,109.00元。

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

本托管人复核审查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。

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：上投摩根纯债添利债券型证券投资基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	337,438.69	362,220.80
结算备付金		2,559,014.50	3,962,994.02
存出保证金		14,391.38	57,625.29
交易性金融资产	6.4.7.2	9,721,053.00	548,616,177.40
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		9,721,053.00	548,616,177.40
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		129,947.59	10,540,873.86
应收利息	6.4.7.5	167,355.50	9,526,353.67
应收股利		-	-
应收申购款		148,510.12	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		13,077,710.78	573,066,245.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		700,000.00	111,300,000.00
应付证券清算款		39,880.00	25,927.71
应付赎回款		13,772.43	71,641.32
应付管理人报酬		238,968.66	301,020.78
应付托管费		68,276.77	86,005.95
应付销售服务费		1,103.86	1,395.42
应付交易费用	6.4.7.7	53,043.10	49,538.53
应交税费		24,490.29	-
应付利息		-111.07	-46,263.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	49,588.60	125,000.28
负债合计		1,189,012.64	111,914,266.55
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	11,327,999.27	454,566,527.31
未分配利润	6.4.7.10	560,698.87	6,585,451.18
所有者权益合计		11,888,698.14	461,151,978.49
负债和所有者权益总计		13,077,710.78	573,066,245.04

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额总额11,327,999.27份，其中A类份额8,003,207.41份，C类份额3,324,791.86份。A类份额净值1.058元，C类份额净值1.028元。

6.2 利润表

会计主体：上投摩根纯债添利债券型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		11,860,320.07	50,723,882.25
1.利息收入		9,843,275.05	78,836,624.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	125,937.27	3,038,652.79
债券利息收入		9,451,946.18	71,260,542.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		265,391.60	4,537,429.07
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）		-4,242,231.69	-81,412,216.45
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	-4,242,231.69	-81,412,216.45
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	6,201,000.36	52,383,451.87
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	58,276.35	916,022.12
减：二、费用		2,786,803.95	20,271,756.76
1. 管理人报酬		1,576,133.44	14,295,308.38
2. 托管费		450,323.83	4,084,373.89
3. 销售服务费		7,005.93	13,665.57
4. 交易费用	6.4.7.18	68,532.59	350,393.27
5. 利息支出		578,368.02	1,406,722.74
其中：卖出回购金融资产支出		578,368.02	1,406,722.74
6.税金及附加		31,328.12	-
7. 其他费用	6.4.7.19	75,112.02	121,292.91
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		9,073,516.12	30,452,125.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		9,073,516.12	30,452,125.49

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根纯债添利债券型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1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）	454,566,527.31	6,585,451.18	461,151,978.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,073,516.12	9,073,516.12
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）	-443,238,528.04	-10,622,159.43	-453,860,687.47
其中：1.基金申购款	693,020.09	17,215.90	710,235.99
2.基金赎回款	-443,931,548.13	-10,639,375.33	-454,570,923.46
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）	-	-4,476,109.00	-4,476,109.00
五、期末所有者权益（基金净值）	11,327,999.27	560,698.87	11,888,698.14
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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）	4,967,047,217.08	-6,409,738.45	4,960,637,478.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,452,125.49	30,452,125.49
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）	-3,657,854,603.86	-13,272,465.64	-3,671,127,069.50
其中：1.基金申购款	857,046.66	1,951.80	858,998.46
2.基金赎回款	-3,658,711,650.52	-13,274,417.44	-3,671,986,067.96
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）	1,309,192,613.22	10,769,921.40	1,319,962,534.62

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：章硕麟，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

上投摩根纯债添利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[2014]第1153号《关于同意上投摩根纯债添利债券型证券投资基金募集的批复》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《上投摩根纯债添利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715,118,748.29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(2014)第828号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根纯债添利债券型证券投资基金基金合同》于2014年12月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为715,246,801.28份基金份额，其中认购资金利息折合128,052.99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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《上投摩根纯债添利债券型证券投资基金招募说明书》和《上投摩根纯债添利债券型证券投资基金基金份额发售公告》的规定，根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，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"。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根纯债添利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。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增发新股，可转债仅投资可分离交易可转债的纯债部分。本基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于80%，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%。本基金的业绩比较基准为中证综合债券指数。

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2018年8月24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》、《上投摩根纯债添利债券型证券投资基金基金合同》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2018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2018年6月30日的财务状况以及2018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行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、沪府发[2011]2号《上海市人民政府关于本市开征地方教育附加的通知》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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起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) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

6.4.7.2 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
中国建设银行股份有限公司（"中国建设银行"）	基金托管人、基金代销机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,576,133.44	14,295,308.38
其中：支付销售机构的客户维护费	17,805.22	6,376,047.50

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0.7%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 0.7%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	450,323.83	4,084,373.89

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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 0.2%/当年天数。

6.4.8.2.3 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 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 上投摩根纯债添利债券A类	上投摩根纯债添利债券C类	合计
上投摩根基金管理有限公司	-	208.46	208.46
中国建设银行	-	4,675.30	4,675.30
浦发银行	-	254.01	254.01
合计	-	5,137.77	5,137.77
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 上投摩根纯债添利债券A类	上投摩根纯债添利债券C类	合计
上投摩根基金管理有限公司	-	225.93	225.93
中国建设银行	-	8,755.18	8,755.18
浦发银行	-	897.51	897.51
合计	-	9,878.62	9,878.62

注：1.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0.40%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。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日C类基金份额资产净值X 0.40%/当年天数。

2.上述支付浦发银行的销售服务费仅涵盖浦发银行作为关联方期间的相关费用。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
中国建设银行	-	110,313,622.60	-	-	-	-
浦发银行资管	71,421,313.56	-	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 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

上投摩根纯债添利债券A类

份额单位：份

关联方名称	上投摩根纯债添利债券A类本期末 2018年6月30日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上投摩根纯债添利债券A类上年度末 2017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
中国建设银行	-	-	437,965,605.91	96.35%

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国建设银行	337,438.69	104,101.41	1,105,899.13	525,994.78

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8.7.2 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。

6.4.9 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年06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700,000.00元，于2018年07月02日(先后)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。

6.4.10 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	9,721,053.00	74.33
	其中：债券	9,721,053.00	74.33
	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	2,896,453.19	22.15
8	其他各项资产	460,204.59	3.52
9	合计	13,077,710.78	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前十名股票投资明细

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	3,935,886.90	33.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,101,951.00	42.91
	其中：政策性金融债	5,101,951.00	42.91
4	企业债券	396,342.00	3.33
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	286,873.10	2.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,721,053.00	81.77

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	018005	国开1701	33,950	3,407,901.00	28.67
2	018006	国开1702	17,000	1,694,050.00	14.25
3	019571	17国债17	13,450	1,345,134.50	11.31
4	010303	03国债(3)	12,640	1,253,382.40	10.54
5	019547	16国债19	9,000	786,870.00	6.62

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 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 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 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	14,391.38
2	应收证券清算款	129,947.59
3	应收股利	-
4	应收利息	167,355.50
5	应收申购款	148,510.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	460,204.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128027	崇达转债	57,445.00	0.48
2	110038	济川转债	47,677.50	0.40
3	123005	万信转债	35,712.10	0.30
4	110042	航电转债	34,699.50	0.29
5	110031	航信转债	11,257.40	0.09
6	128020	水晶转债	11,022.00	0.09

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

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

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	机构投资者 持有份额	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
上投摩根纯债添利债券A类	237	33,768.81	-	0.00%	8,003,207.41	100.00%
上投摩根纯债添利债券C类	137	24,268.55	-	0.00%	3,324,791.86	100.00%
合计	374	30,288.77	-	0.00%	11,327,999.27	100.00%

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	上投摩根纯债添利债券A类	0.00	0.0000%
	上投摩根纯债添利债券C类	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

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	上投摩根纯债添利债券A类	0
	上投摩根纯债添利债券C类	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	上投摩根纯债添利债券A类	0
	上投摩根纯债添利债券C类	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	上投摩根纯债添利债券A类	上投摩根纯债添利债券C类
基金合同生效日（2014年12月24日）基金份额总额	486,356,235.64	228,890,565.64
本报告期期初基金份额总额	450,519,776.87	4,046,750.44
本报告期基金总申购份额	341,143.07	351,877.02
减：本报告期基金总赎回份额	442,857,712.53	1,073,835.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,003,207.41	3,324,791.86

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：

无。

基金托管人：

无。

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

本报告期内，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 成交金额	股票交易 占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	应支付该券商的佣金 占当期佣金总量的比例	备注
海通证券	1	-	-	45,932.48	87.43%	-
招商证券	1	-	-	6,606.14	12.57%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-

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.本半年度本基金无新增席位，无注销席位。

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 成交金额	债券交易 占当期债券成交总额的比例	回购交易 成交金额	回购交易 占当期回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	权证交易 占当期权证成交总额的比例
海通证券	227,448,888.45	86.06%	3,083,000,000.00	97.69%	-	-
招商证券	36,840,361.69	13.94%	73,000,000.00	2.31%	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

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 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180626	437,965,605.91	0.00	437,965,605.91	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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

上投摩根基金管理有限公司

二〇一八年八月二十七日