

上投摩根纯债债券型证券投资基金

2018年度报告摘要

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

报告送出日期：二〇一九年三月二十日

§ 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认，并由董事长签发。

基金经理人中银中国银行股份有限公司根据基金合同的规定，于2019年3月10日复核了本基金中的财务指标、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。

基金经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。

基金经理的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，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。

本年度报告摘要摘自年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称：上投摩根纯债债券

基金代码：371020

交易场所：上海证券交易所

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2000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

报告期末基金总资产：1,158,613,386.06元

不适用

下属分级基金的基金简称：上投摩根纯债债券A 上投摩根纯债债券B

下属分级基金的交易代码：371020 371120

报告期末基金的份额总额：1,047,086,110.06份 111,527,276.40份

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金将坚持对利率的判断，即期判断和长期判断相结合，力求在主动管理资产配置、在风格切换和资产配置的均衡下，提高资产流动性与稳定性，以实现资产的保值增值。

投资策略 本基金管理人坚持对利率的判断，即期判断和长期判断相结合，通过即期资产配置和长期资产配置相结合的策略，追求绝对收益。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为：中信债基指数。

风险收益特征 本基金为债券型基金，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。本基金的风险收益特征以定期评估和审慎调整为主。

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

上投摩根基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

姓名 胡迪 郭明

联系电话 021-38794888 010-66106799

电子邮箱 services@ctfm.com.cn cutedy@ctcm.com

客户服务电话 400-899-4998 95588

传真 021-20029400 010-66106798

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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：2018年 2017年 2016年

本期末 基金份额 11,300,1260 10,630,297.00 269,404.33 33,692,164.68 1,164,503.89

本期 利润 20,268,1206 16,100,870.58 332,666.01 10,398,240.00 736,266.52

加权平均基金份额本期利润 0.00602 0.0059 0.00303 0.0229 0.0121 0.0191

本期 基金份额净值增长 率 4.07% 3.70% 2.38% 2.01% 0.80% 0.37%

3.1.2 期间数据和指标：2018年末 2017年末 2016年末

本期末 基金份额 1,050.40 1,032.02 0.3473 0.3009 0.3106 0.2788

本期末 基金份额 净值 1,202.00 1,287.17 436,512,289,071.00 1,064,456,297.29 29,728,613.71

本期末 基金份额 增长率 9.02% 9.12% 963,108.40 402,23 839,17

注：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，对本期可供分配利润的影响，采用期末净资产减去未实现利润与未分配利润后的影响列示。

2.上述基金行业指标不包括任何买入或卖出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 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根纯债债券A：

阶段 份额净值增长 率(%) 分期净值增 长率(%) 业绩比较基 准收益率(%) 业绩比较基 准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一个月 1.36% 0.06% 2.91% 0.09% -1.55% -0.03%

过去六个月 0.99% 0.07% 3.08% 0.10% -1.21% -0.03%

过去一年 4.07% 0.06% 6.17% 0.11% -2.10% -0.06%

过去三年 7.41% 0.05% -0.10% 0.11% 7.69% -0.06%

过去五年 36.93% 0.16% 12.12% 0.12% 24.81% 0.04%

自基金合同生 效以来 47.47% 0.14% 6.51% 0.11% 41.96% 0.03%

2. 上投摩根纯债债券B：

阶段 份额净值增 长率(%) 分期净值增 长率(%) 业绩比较基 准收益率(%) 业绩比较基 准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一个月 1.36% 0.06% 2.91% 0.09% -1.55% -0.03%

过去六个月 0.99% 0.07% 3.08% 0.10% -1.21% -0.03%

过去一年 4.07% 0.06% 6.17% 0.11% -2.10% -0.06%

过去三年 7.41% 0.05% -0.10% 0.11% 7.69% -0.06%

过去五年 36.93% 0.16% 12.12% 0.12% 24.81% 0.04%

自基金合同生 效以来 47.47% 0.14% 6.51% 0.11% 41.96% 0.03%

3. 上投摩根纯债债券C：

阶段 份额净值增 长率(%) 分期净值增 长率(%) 业绩比较基 准收益率(%) 业绩比较基 准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一个月 1.36% 0.06% 2.91% 0.09% -1.55% -0.03%

过去六个月 0.99% 0.07% 3.08% 0.10% -1.21% -0.03%

过去一年 4.07% 0.06% 6.17% 0.11% -2.10% -0.06%

过去三年 7.41% 0.05% -0.10% 0.11% 7.69% -0.06%

过去五年 36.93% 0.16% 12.12% 0.12% 24.81% 0.04%

自基金合同生 效以来 47.47% 0.14% 6.51% 0.11% 41.96% 0.03%

4. 上投摩根纯债债券D：

阶段 份额净值增 长率(%) 分期净值增 长率(%) 业绩比较基 准收益率(%) 业绩比较基 准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一个月 1.36% 0.06% 2.91% 0.09% -1.55% -0.03%

过去六个月 0.99% 0.07% 3.08% 0.10% -1.21% -0.03%

过去一年 4.07% 0.06% 6.17% 0.11% -2.10% -0.06%

过去三年 7.41% 0.05% -0.10% 0.11% 7.69% -0.06%

过去五年 36.93% 0.16% 12.12% 0.12% 24.81% 0.04%

自基金合同生 效以来 47.47% 0.14% 6.51% 0.11% 41.96% 0.03%

5. 上投摩根纯债债券E：

阶段 份额净值增 长率(%) 分期净值增 长率(%) 业绩比较基 准收益率(%) 业绩比较基 准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一个月 1.36% 0.06% 2.91% 0.09% -1.55% -0.03%

过去六个月 0.99% 0.07% 3.08% 0.10% -1.21% -0.03%

过去一年 4.07% 0.06% 6.17% 0.11% -2.10% -0.06%

过去三年 7.41% 0.05% -0.10% 0.11% 7.69% -0.06%

过去五年 36.93% 0.16% 12.12% 0.12% 24.81% 0.04%

自基金合同生 效以来 47.47% 0.14% 6.51% 0.11% 41.96% 0.03%

6. 上投摩根纯债债券F：

阶段 份额净值增 长率(%) 分期净值增 长率(%) 业绩比较基 准收益率(%) 业绩比较基 准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一个月 1.36% 0.06% 2.91% 0.09% -1.55% -0.03%

过去六个月 0.99% 0.07% 3.08% 0.10% -1.21% -0.03%

过去一年 4.07% 0.06% 6.17% 0.11% -2.10% -0.06%

过去三年 7.41% 0.05% -0.10% 0.11% 7.69% -0.06%

过去五年 36.93% 0.16% 12.12% 0.12% 24.81% 0.04%

自基金合同生 效以来 47.47% 0.14% 6.51% 0.11% 41.96% 0.03%

7. 上投摩根纯债债券G：

阶段 份额净值增 长率(%) 分期净值增 长率(%) 业绩比较基 准收益率(%) 业绩比较基 准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一个月 1.36% 0.06% 2.91% 0.09% -1.55% -0.03%

过去六个月 0.99% 0.07% 3.08% 0.10% -1.21% -0.03%

过去一年 4.07% 0.06% 6.17% 0.11% -2.10% -0.06%

过去三年 7.41% 0.05% -0.10% 0.11% 7.69% -0.06%

过去五年 36.93% 0.16% 12.12% 0.12% 24.81% 0.04%

自基金合同生 效以来 47.47% 0.14% 6.51% 0.11% 41.96% 0.03%

8. 上投摩根纯债债券H：

阶段 份额净值增 长率(%) 分期净值增 长率(%) 业绩比较基 准收益率(%) 业绩比较基 准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一个月 1.36% 0.06% 2.91% 0.09% -1.55% -0.03%

过去六个月 0.99% 0.07% 3.08% 0.10% -1.21% -0.03%

过去一年 4.07% 0.06% 6.17% 0.11% -2.10% -0.06%

过去三年 7.41% 0.05% -0.10% 0.11% 7.69% -0.06%

过去五年 36.93% 0.16% 12.12% 0.12% 24.81% 0.04%

自基金合同生 效以来 47.