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. 本招募说明书摘要所载内容截止日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。

二〇一九年八月

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：陈氏
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元人民币增加到二亿五千万元人民币，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：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：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、上海国际信托有限公司党委书记。
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董事长。

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兼任总行战略发展部总经理。

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。

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金融与治理中心主任。曾经在加里伯利大学经济系、新加坡国立大学经济系、复旦大学金融系等单位任教。

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：戴立宇
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，东吳大学法学院副教授。
现任北京大学法学院及光华管理学院兼职教授。

独立董事：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。

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。

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。

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2019年1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月起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12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2019年3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。

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；黄栋，量化投资部总监兼高级基金经理；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，投资经理兼固收研究部总监；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；叶承泰，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

(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

(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

(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

(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

(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

(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：高国富
客户服务热线：95528
网址：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

(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

(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

(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

(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

(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

(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.nbcb.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

(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

(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

(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
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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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
公司网站：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

(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
公司网站：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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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 及 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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

(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

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：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。

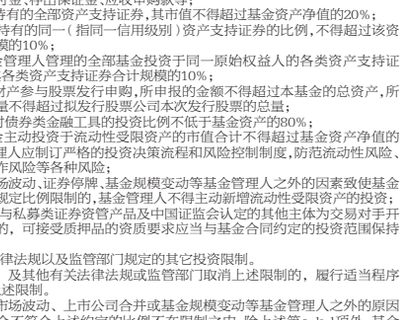
（三）投资理念

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的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基础股票，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。