**上投摩根纯债债券型证券投资基金**

**2022年第1季度报告**

**2022年3月31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**

**报告送出日期：二〇二二年四月二十二日**

# §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至3月31日止。

# §2 基金产品概况

|  |  |
| --- | --- |
| 基金简称 | 上投摩根纯债债券 |
| 基金主代码 | 371020 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年6月24日 |
| 报告期末基金份额总额 | 106,927,772.61份 |
| 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。 |
| 投资策略 | 1、目标久期管理策略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。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。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。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为中国债券总指数。 |
| 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。根据2017年7月1日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和相关销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。 |
| 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 |
| 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 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 59,327,833.57份 | 47,599,939.04份 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

**3.1 主要财务指标**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 主要财务指标 | 报告期(2022年1月1日-2022年3月31日) |
| 上投摩根纯债债券A | 上投摩根纯债债券B |
| 1.本期已实现收益 | -216,706.12 | -215,315.85 |
| 2.本期利润 | -2,388,305.61 | -2,073,025.79 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0399 | -0.0404 |
| 4.期末基金资产净值 | 76,133,490.42 | 59,882,910.79 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.2833 | 1.2580 |

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。

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本报告期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**

**1、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 |
| 过去三个月 | -2.99% | 0.28% | -0.29% | 0.10% | -2.70% | 0.18% |
| 过去六个月 | 3.47% | 0.40% | 0.48% | 0.09% | 2.99% | 0.31% |
| 过去一年 | 7.03% | 0.39% | 2.20% | 0.09% | 4.83% | 0.30% |
| 过去三年 | 10.13% | 0.31% | 2.78% | 0.11% | 7.35% | 0.20% |
| 过去五年 | 19.28% | 0.24% | 6.17% | 0.11% | 13.11% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 65.67% | 0.19% | 8.60% | 0.11% | 57.07% | 0.08% |

**2、上投摩根纯债债券B：**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 |
| 过去三个月 | -3.07% | 0.28% | -0.29% | 0.10% | -2.78% | 0.18% |
| 过去六个月 | 3.28% | 0.40% | 0.48% | 0.09% | 2.80% | 0.31% |
| 过去一年 | 6.61% | 0.39% | 2.20% | 0.09% | 4.41% | 0.30% |
| 过去三年 | 8.98% | 0.30% | 2.78% | 0.11% | 6.20% | 0.19% |
| 过去五年 | 17.11% | 0.24% | 6.17% | 0.11% | 10.94% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 57.62% | 0.19% | 8.60% | 0.11% | 49.02% | 0.08% |

**3.2.2　自基金合同生效以来基金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**

上投摩根纯债债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2009年6月24日至2022年3月31日)

1．上投摩根纯债债券A：



注：本基金合同生效日为2009年6月24日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

2．上投摩根纯债债券B：



注：本基金合同生效日为2009年6月24日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，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 基金经理（或基金经理小组）简介**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | 证券从业年限 | 说明 |
| 任职日期 | 离任日期 |
| 聂曙光 | 本基金基金经理、债券投资部总监 | 2014-08-29 | - | 16年 | 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月至2021年8月同时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月起同时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月至2021年9月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，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，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，2016年8月至2020年7月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，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，2017年4月至2022年1月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，2018年9月至2020年5月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，2019年8月至2021年4月同时担任上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金，自2019年8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2020年8月起同时担任上投摩根瑞盛87个月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.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。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。除以下情况外，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：本基金曾出现个别由于市场原因引起的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形，但已在规定时间内调整完毕。

**4.3 公平交易专项说明**

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、交易方向等的分析，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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：无。

**4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2022年第一季度，国内外形势错综复杂。国际上，俄乌冲突恶化，大宗商品暴涨导致通胀压力进一步加剧，加息预期持续强化，美国国债收益率曲线出现倒挂。国内经济方面，政策对经济托举力度不足以抵消疫情对经济的负面冲击，需求下行、供给冲击和预期转弱的局面未得到根本扭转，经济未能从下行通道走向复苏。在一季度货币政策例会上，央行对货币政策的表述相比2021年第四季度更加积极，由 “加大跨周期调节力度，与逆周期相结合”更改为“强化跨周期和逆周期调节，加大稳健的货币政策实施力度”。一季度，央行下调了一次MLF、OMO利率，降幅10bp，以及一次LPR5年期利率，降幅5bp。债券市场方面，受1-2月经济数据好转且流动性宽松的双重影响，国债收益率曲线在第一季度呈现扁平化并小幅下行的趋势。截至3月末，1年期以内品种下行幅度最为明显，下行约10bp；3-5年期下行约5bp；7年期小幅上行约3bp，10年期国债基本持平于2021年年末水平。可转债受股票市场下跌拖累，一季度也出现较大幅度回撤。

展望第二季度，为了实现全年经济增速目标，势必加大政策力度，货币环境预计仍将宽松，体现货币政策“以我为主”，但美联储进入紧缩周期可能一定程度上仍会形成掣肘。债券策略上仍计划保持相对谨慎，追寻确定性收益为主，预计很难有趋势性机会，但存在一定博取预期差的波段交易机会。若托底政策超预期或者赎回压力超预期而导致收益率显著上行，将带来较好的配置型机会。随着股票市场估值吸引力的提升和经济基本面的好转，二季度可转债市场将迎来较好的建仓机会。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期上投摩根纯债债券A份额净值增长率为:-2.99%，同期业绩比较基准收益率为:-0.29%,

上投摩根纯债债券B份额净值增长率为:-3.07%，同期业绩比较基准收益率为:-0.29%。

**4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明**

无。

# §5 投资组合报告

**5.1 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 | 152,742,966.34 | 97.97 |
|  | 其中：债券 | 152,742,966.34 | 97.97 |
|  | 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 | 3,028,705.47 | 1.94 |
| 7 | 其他各项资产 | 137,253.91 | 0.09 |
| 8 | 合计 | 155,908,925.72 | 100.00 |

**5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

 **5.2.1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。

**5.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细5.3.1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。

**5.4 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 | 13,327,002.19 | 9.80 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 13,638,828.38 | 10.03 |
|  | 其中：政策性金融债 | 11,547,099.06 | 8.49 |
| 4 | 企业债券 | 58,950,543.82 | 43.34 |
| 5 | 企业短期融资券 | 40,213,078.90 | 29.56 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 26,613,513.05 | 19.57 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 152,742,966.34 | 112.30 |

**5.5 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 | 012105490 | 21南电SCP015 | 100,000 | 10,061,991.78 | 7.40 |
| 2 | 012280069 | 22中交建SCP001 | 100,000 | 10,052,633.97 | 7.39 |
| 3 | 012105548 | 21电网SCP036 | 100,000 | 10,050,620.27 | 7.39 |
| 4 | 012280097 | 22上海机场SCP002 | 100,000 | 10,047,832.88 | 7.39 |
| 5 | 143526 | 18老窖01 | 80,000 | 8,084,931.51 | 5.94 |

**5.6　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。

**5.7 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。

**5.8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权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 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。

**5.10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。

**5.11投资组合报告附注**

5.11.1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。

5.11.2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。

**5.11.3其他资产构成**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 名称 | 金额(元) |
| 1 | 存出保证金 | 13,244.31 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 124,009.60 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 137,253.91 |

**5.11.4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 | 113568 | 新春转债 | 858,770.30 | 0.63 |
| 2 | 128101 | 联创转债 | 845,970.41 | 0.62 |
| 3 | 113619 | 世运转债 | 823,433.59 | 0.61 |
| 4 | 113025 | 明泰转债 | 767,560.55 | 0.56 |
| 5 | 128095 | 恩捷转债 | 725,934.79 | 0.53 |
| 6 | 127044 | 蒙娜转债 | 708,359.51 | 0.52 |
| 7 | 123104 | 卫宁转债 | 676,725.21 | 0.50 |
| 8 | 110075 | 南航转债 | 651,541.93 | 0.48 |
| 9 | 113579 | 健友转债 | 630,055.34 | 0.46 |
| 10 | 110048 | 福能转债 | 623,992.33 | 0.46 |
| 11 | 110043 | 无锡转债 | 584,019.04 | 0.43 |
| 12 | 123083 | 朗新转债 | 540,791.51 | 0.40 |
| 13 | 113043 | 财通转债 | 534,990.96 | 0.39 |
| 14 | 113615 | 金诚转债 | 513,360.58 | 0.38 |
| 15 | 127038 | 国微转债 | 492,897.95 | 0.36 |
| 16 | 110079 | 杭银转债 | 489,890.52 | 0.36 |
| 17 | 118001 | 金博转债 | 489,664.66 | 0.36 |
| 18 | 127040 | 国泰转债 | 482,185.55 | 0.35 |
| 19 | 113050 | 南银转债 | 477,588.49 | 0.35 |
| 20 | 110081 | 闻泰转债 | 473,896.55 | 0.35 |
| 21 | 123022 | 长信转债 | 464,688.08 | 0.34 |
| 22 | 113550 | 常汽转债 | 431,647.32 | 0.32 |
| 23 | 113042 | 上银转债 | 418,982.90 | 0.31 |
| 24 | 113537 | 文灿转债 | 416,351.78 | 0.31 |
| 25 | 113629 | 泉峰转债 | 379,903.40 | 0.28 |
| 26 | 127031 | 洋丰转债 | 370,122.52 | 0.27 |
| 27 | 110053 | 苏银转债 | 363,152.22 | 0.27 |
| 28 | 113625 | 江山转债 | 356,753.26 | 0.26 |
| 29 | 118002 | 天合转债 | 349,895.67 | 0.26 |
| 30 | 127025 | 冀东转债 | 338,900.48 | 0.25 |
| 31 | 123088 | 威唐转债 | 337,452.49 | 0.25 |
| 32 | 113620 | 傲农转债 | 333,808.22 | 0.25 |
| 33 | 110076 | 华海转债 | 332,263.15 | 0.24 |
| 34 | 113605 | 大参转债 | 322,685.18 | 0.24 |
| 35 | 110074 | 精达转债 | 300,171.78 | 0.22 |
| 36 | 123121 | 帝尔转债 | 287,479.07 | 0.21 |
| 37 | 118000 | 嘉元转债 | 279,217.32 | 0.21 |
| 38 | 113621 | 彤程转债 | 277,362.47 | 0.20 |
| 39 | 110061 | 川投转债 | 258,898.08 | 0.19 |
| 40 | 127030 | 盛虹转债 | 256,597.53 | 0.19 |
| 41 | 123080 | 海波转债 | 252,660.82 | 0.19 |
| 42 | 128109 | 楚江转债 | 251,871.67 | 0.19 |
| 43 | 127017 | 万青转债 | 244,554.30 | 0.18 |
| 44 | 128119 | 龙大转债 | 244,449.10 | 0.18 |
| 45 | 128137 | 洁美转债 | 243,649.26 | 0.18 |
| 46 | 128081 | 海亮转债 | 238,894.25 | 0.18 |
| 47 | 113047 | 旗滨转债 | 234,371.69 | 0.17 |
| 48 | 128034 | 江银转债 | 225,790.41 | 0.17 |
| 49 | 128136 | 立讯转债 | 224,790.63 | 0.17 |
| 50 | 128131 | 崇达转2 | 216,601.81 | 0.16 |
| 51 | 113626 | 伯特转债 | 192,951.48 | 0.14 |
| 52 | 123060 | 苏试转债 | 177,929.70 | 0.13 |
| 53 | 128071 | 合兴转债 | 170,810.79 | 0.13 |
| 54 | 123114 | 三角转债 | 146,502.66 | 0.11 |
| 55 | 127027 | 靖远转债 | 131,997.29 | 0.10 |
| 56 | 123103 | 震安转债 | 129,510.68 | 0.10 |
| 57 | 127045 | 牧原转债 | 128,809.95 | 0.09 |
| 58 | 128134 | 鸿路转债 | 127,600.68 | 0.09 |
| 59 | 123025 | 精测转债 | 123,289.86 | 0.09 |
| 60 | 110057 | 现代转债 | 122,170.00 | 0.09 |
| 61 | 123119 | 康泰转2 | 119,730.96 | 0.09 |
| 62 | 110068 | 龙净转债 | 119,487.53 | 0.09 |
| 63 | 123109 | 昌红转债 | 117,670.00 | 0.09 |
| 64 | 128097 | 奥佳转债 | 116,736.71 | 0.09 |
| 65 | 113602 | 景20转债 | 116,129.32 | 0.09 |
| 66 | 127036 | 三花转债 | 115,293.26 | 0.08 |
| 67 | 128142 | 新乳转债 | 112,403.97 | 0.08 |
| 68 | 123039 | 开润转债 | 111,302.49 | 0.08 |
| 69 | 123117 | 健帆转债 | 110,195.42 | 0.08 |
| 70 | 113608 | 威派转债 | 110,059.40 | 0.08 |
| 71 | 127041 | 弘亚转债 | 109,098.22 | 0.08 |
| 72 | 113033 | 利群转债 | 108,950.00 | 0.08 |
| 73 | 123101 | 拓斯转债 | 107,724.11 | 0.08 |
| 74 | 113542 | 好客转债 | 107,372.60 | 0.08 |
| 75 | 128030 | 天康转债 | 19,715.45 | 0.01 |
| 76 | 128106 | 华统转债 | 18,999.82 | 0.01 |
| 77 | 110071 | 湖盐转债 | 12,940.85 | 0.01 |
| 78 | 123107 | 温氏转债 | 12,830.33 | 0.01 |
| 79 | 127043 | 川恒转债 | 12,760.34 | 0.01 |
| 80 | 128135 | 洽洽转债 | 12,025.44 | 0.01 |
| 81 | 110056 | 亨通转债 | 12,003.27 | 0.01 |
| 82 | 127037 | 银轮转债 | 11,959.59 | 0.01 |
| 83 | 128035 | 大族转债 | 11,509.94 | 0.01 |
| 84 | 113024 | XD核建转 | 11,371.47 | 0.01 |
| 85 | 128132 | 交建转债 | 11,234.04 | 0.01 |
| 86 | 128114 | 正邦转债 | 9,978.87 | 0.01 |

**5.11.5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中不存在流通受限情况。

**5.11.6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。

# §6 开放式基金份额变动

单位：份

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 上投摩根纯债债券A | 上投摩根纯债债券B |
| 本报告期期初基金份额总额 | 59,839,512.53 | 55,803,033.79 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 8,635,629.99 | 3,414,449.33 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 9,147,308.95 | 11,617,544.08 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 59,327,833.57 | 47,599,939.04 |

# §7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

**7.1基金管理人持有本基金份额变动情况**

无。

# §8 影响投资者决策的其他重要信息

**8.1 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 | 20220101-20220331 | 24,670,230.26 | 0.00 | 0.00 | 24,670,230.26 | 23.07% |
| 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。 |

# §9 备查文件目录

**9.1备查文件目录**

1、中国证监会批准上投摩根纯债债券型证券投资基金设立的文件；

2、《上投摩根纯债债券型证券投资基金基金合同》；

3、《上投摩根纯债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。

**9.2存放地点**

基金管理人或基金托管人处。

**9.3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。

**上投摩根基金管理有限公司**

**二〇二二年四月二十二日**