

# 摩根纯债丰利债券型证券投资基金

## 2023 年中期报告

### 2023 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

## 1 重要提示及目录

### 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。本中期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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>5 托管人报告</b> .....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>7 投资组合报告</b> .....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 本报告期投资基金情况.....	42
7.13 投资组合报告附注.....	42
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	43

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
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 .....	44
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>44</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>44</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4	基金投资策略的改变 .....	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
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 .....	45
10.6.1	管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	45
10.6.2	托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
10.8	其他重大事件 .....	46
<b>11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>47</b>
<b>12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>47</b>
12.1	备查文件目录 .....	47
12.2	存放地点 .....	48
12.3	查阅方式 .....	48

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	摩根纯债丰利债券型证券投资基金	
基金简称	摩根纯债丰利债券	
基金主代码	000839	
交易代码	000839	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 11 月 18 日	
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,595,745.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	摩根纯债丰利债券 A	摩根纯债丰利债券 C
下属分级基金的交易代码	000839	000840
报告期末下属分级基金的份额总额	3,255,531.20 份	340,214.43 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	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。本基金将以内部信用评级为主、外部信用评级为辅，研究债券发行主体的基本面，以确定债券的违约风险和合理的信用利差水平，判断债券的投资价值。本基金将重点分析债券发行人所处行业的发展前景、市场竞争地位、财务质量（包括资产负债水平、资产变现能力、偿债能力、运营效率以及现金流质量）等要素，综合评价其信用等级，谨慎选择债券发行人基本面良好、债券条款优惠的信用类债券进行投资。具体的投资策略包括：债权类属配置策略、信用策略、久期调整策略、期限结构配置策略、息差策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略。
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。 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。
---------------

### 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		摩根基金管理（中国）有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邹树波	许俊
	联系电话	021-38794888	010-66596688
	电子邮箱	services@cifm.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-889-4888	95566
传真		021-20628400	010-66594942
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楼	北京市西城区复兴门内大街1号
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楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		王琼慧	葛海蛟

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	am.jpmorgan.com/cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	摩根基金管理（中国）有限公司	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 楼

## 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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	摩根纯债丰利债券 A	摩根纯债丰利债券 C
本期已实现收益	222,201.48	-170.10

本期利润	159,025.66	2,100.31
加权平均基金份额本期利润	0.0026	0.0054
本期加权平均净值利润率	0.25%	0.53%
本期基金份额净值增长率	0.64%	0.58%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	摩根纯债丰利债券 A	摩根纯债丰利债券 C
期末可供分配利润	-3,598.58	-590.07
期末可供分配基金份额利润	-0.0011	-0.0017
期末基金资产净值	3,318,497.26	346,552.28
期末基金份额净值	1.0193	1.0186
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	摩根纯债丰利债券 A	摩根纯债丰利债券 C
基金份额累计净值增长率	25.87%	24.10%

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 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

摩根纯债丰利债券 A

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	-0.04%	0.04%	0.50%	0.06%	-0.54%	-0.02%
过去三个月	-0.26%	0.05%	1.78%	0.04%	-2.04%	0.01%
过去六个月	0.64%	0.08%	2.73%	0.04%	-2.09%	0.04%
过去一年	1.31%	0.08%	4.24%	0.05%	-2.93%	0.03%
过去三年	6.07%	0.06%	12.39%	0.05%	-6.32%	0.01%
自基金合同生效起至今	25.87%	0.08%	43.27%	0.07%	-17.40%	0.01%

摩根纯债丰利债券 C

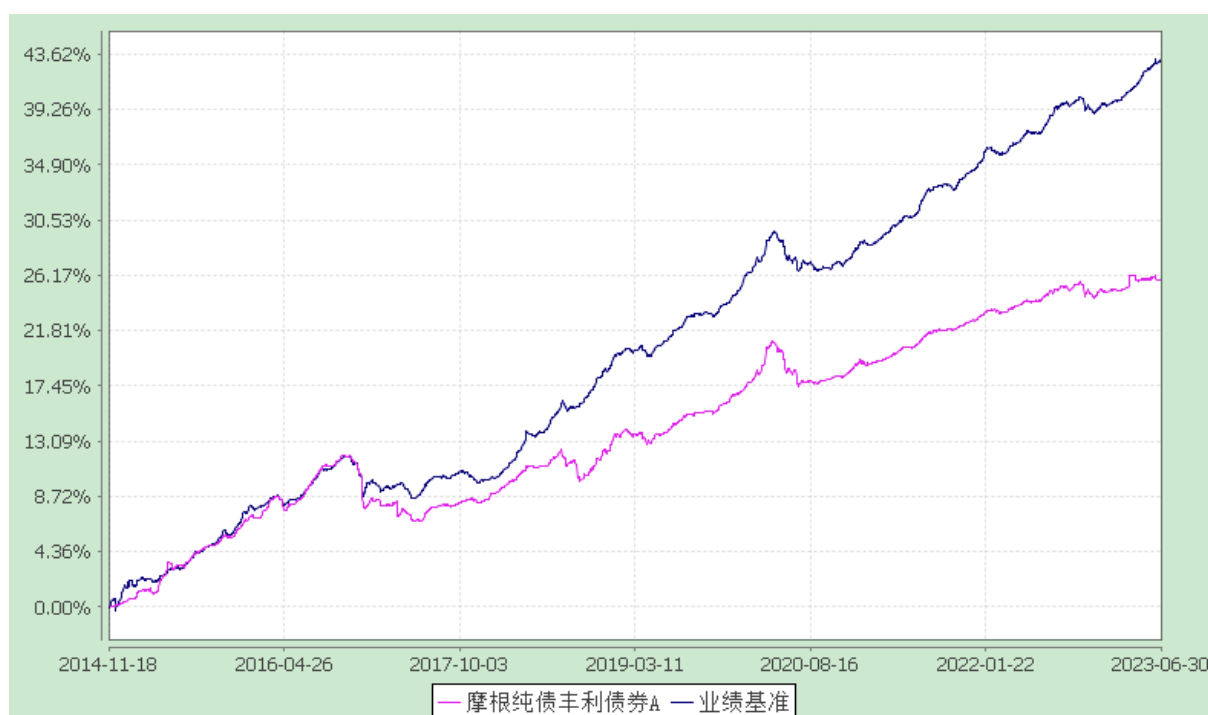
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.05%	0.04%	0.50%	0.06%	-0.55%	-0.02%
过去三个月	-0.29%	0.05%	1.78%	0.04%	-2.07%	0.01%
过去六个月	0.58%	0.08%	2.73%	0.04%	-2.15%	0.04%
过去一年	1.22%	0.08%	4.24%	0.05%	-3.02%	0.03%

过去三年	5.68%	0.06%	12.39%	0.05%	-6.71%	0.01%
自基金合同生效起至今	24.10%	0.08%	43.27%	0.07%	-19.17%	0.01%

### 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

摩根纯债丰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 11 月 18 日至 2023 年 6 月 30 日)

摩根纯债丰利债券 A



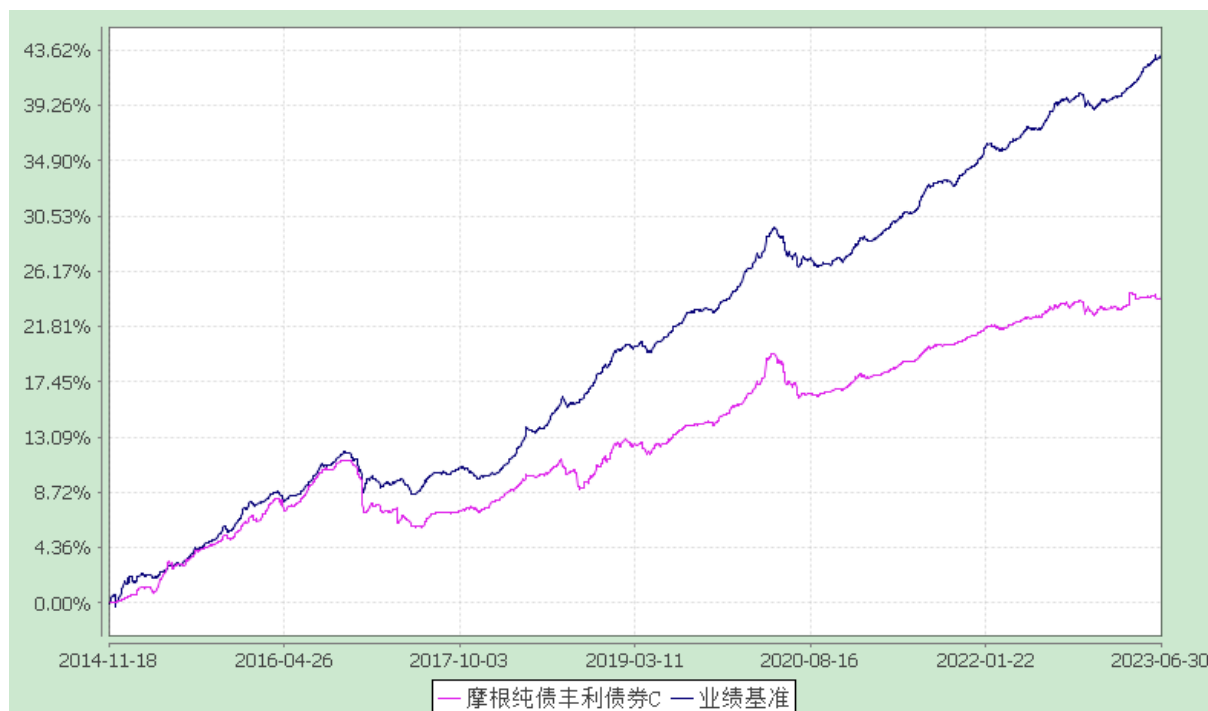
注：本基金合同生效日为 2014 年 11 月 18 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

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。

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”。

摩根纯债丰利债券 C





注：本基金合同生效日为 2014 年 11 月 18 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。

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

摩根基金管理（中国）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，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。2023 年 1 月 19 日，经中国证监会批准，本公司原股东之一上海国际信托有限公司将其持有的本公司 51% 股权，与原另一股东 JPMorgan Asset Management (UK) Limited 将其持有的本公司 49% 股权转让给摩根资产管理控股公司 (JPMorgan Asset Management Holdings Inc.)，从而摩根资产管理控股公司取得本公司全部股权。2023 年 4 月 10 日，基金管理人的名称由“上投摩根基金管理有限公司”变更为“摩根基金管理（中国）有限公司”。截至 2023 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有八十七只，均为开放式基金，分别是：摩根中国优势证券投资基金、摩根货币市场基金、摩根阿尔法混合型证券投资基金、摩根双息平衡混合型证券投资基金

金、摩根成长先锋混合型证券投资基金、摩根内需动力混合型证券投资基金、摩根亚太优势混合型证券投资基金(QDII)、摩根双核平衡混合型证券投资基金、摩根中小盘混合型证券投资基金、摩根纯债债券型证券投资基金、摩根行业轮动混合型证券投资基金、摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)、摩根新兴动力混合型证券投资基金、摩根强化回报债券型证券投资基金、摩根健康品质生活混合型证券投资基金、摩根全球天然资源混合型证券投资基金(QDII)、摩根核心优选混合型证券投资基金、摩根智选 30 混合型证券投资基金、摩根成长动力混合型证券投资基金、摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、摩根双债增利债券型证券投资基金、摩根核心成长股票型证券投资基金、摩根民生需求股票型证券投资基金、摩根纯债丰利债券型证券投资基金、摩根天添盈货币市场基金、摩根天添宝货币市场基金、摩根安全战略股票型证券投资基金、摩根卓越制造股票型证券投资基金、摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、摩根智慧互联股票型证券投资基金、摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、摩根新兴服务股票型证券投资基金、摩根医疗健康股票型证券投资基金、摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、摩根全球多元配置证券投资基金(QDII-FOF)、摩根安通回报混合型证券投资基金、摩根丰瑞债券型证券投资基金、摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、摩根安隆回报混合型证券投资基金、摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)、摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、摩根安裕回报混合型证券投资基金、摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金(QDII)、摩根核心精选股票型证券投资基金、摩根动力精选混合型证券投资基金、摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)、摩根领先优选混合型证券投资基金、摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)、摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根瑞益纯债债券型证券投资基金、摩根慧选成长股票型证券投资基金、摩根瑞泰 38 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根锦程稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、摩根研究驱动股票型证券投资基金、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根瑞盛 87 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根慧见两年持有期混合型证券投资基金、摩根远见两年持有期混合型证券投资基金、摩根安享回报一年持有期债券型证券投资基金、摩根行业睿选股股票型证券投资基金、摩根优势成长混合型证券投资基金、摩根安荣回报混合型证券投资基金、摩根中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、摩根景气甄选混合型证券投资基金、摩根均衡优选混合型证券投资基金、摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、摩根月月盈 30 天滚动持有发起式短债债券型证券投资基金、摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、摩根

全景优势股票型证券投资基金、摩根沃享远见一年持有期混合型证券投资基金、摩根鑫睿优选一年持有期混合型证券投资基金、摩根博睿均衡一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、摩根慧享成长混合型证券投资基金、摩根瑞享纯债债券型证券投资基金、摩根中证碳中和 60 交易型开放式指数证券投资基金、摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、摩根标普 500 指数型发起式证券投资基金(QDII)、摩根锦颐养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、摩根海外稳健配置混合型证券投资基金(QDII-FOF)、摩根时代睿选股票型证券投资基金。

#### 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
雷杨娟	本基金基金经理	2022-08-26	-	17 年	雷杨娟女士曾任厦门国际银行总裁（总经理）办公室副行长秘书兼集团秘书、资金运营部外汇及外币债券交易员，中国民生银行人民币债券自营交易员、银行账户投资经理、投顾账户投资经理。2017 年 7 月起加入摩根基金管理（中国）有限公司（原上投摩根基金管理有限公司），历任专户投资二部副总监兼资深投资经理，现任债券投资部副总监兼资深基金经理。
刘鲁旦	本基金基金经理、副总经理兼债券投资总监	2022-06-01	2023-03-31	18 年	刘鲁旦先生曾任德意志银行担任全球市场研究部分析师，SAC 资产管理全球宏观交易组高级研究员/交易员，摩根士丹利资产管理公司新兴市场债券组投资经理，华夏基金管理有限公司投资经理/固定收益部副总经理/机构债券部总经理/固定收益总监，中国国际金融股份有限公司董事总经理，负责资产管理部固定收益工作。2019 年 11 月加入摩根基金管理（中国）有限公司（原上投摩根基金管理有限公司），曾任副总经理兼债券投资总监。
文雪婷	本基金基金经理助理	2023-06-05	-	6 年	清华大学应用经济学博士，现任固收研究部宏观研究员/基金经理助理。文雪婷女士自 2017 年 6 月至 2020 年 10 月在泰康资产管理有限

					责任公司任资产配置研究高级经理；自 2020 年 10 月加入摩根基金管理（中国）有限公司（原“上投摩根基金管理有限公司”），现任固收研究部宏观研究员/基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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、本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：本基金曾出现因巨额赎回，资产需变现的个别原因引起投资组合的投资指标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 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，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

2023 年第一季度，国际方面，海外金融风险事件持续发酵，继美国地方性银行风险暴露后，欧洲银行业也出现瑞银收购瑞信等事件，加剧了市场担忧，降低了市场对美联储的加息预期。国内经济主线则为疫后修复。随着国内防疫政策明显转变，社会和经济生活逐渐正常化，经济呈现复苏态势。固定资产投资总体保持回升态势。1-2 月份社会零售品消费总额同比回升，服务类消费因为疫情放开后消费场景恢复而超预期回升。就业市场复苏进程偏慢，失业率环比及同比均略有抬升。1-2 月的新增社会融资规模大幅超出市场预期。货币政策方面，央行在 3 月份宣布全面降准 0.25 个百分点，此举旨在保持流动性合理充裕，巩固经济回稳向上基础，后续货币政策进入观望期。资金利率延续了去年第四季度以来的中枢缓慢抬升趋势，已经回归政策利率，和经济的发展状态一致，应处于央行合意水平。通胀方面，通胀水平总体保持温和，通胀压力可控。进入二季度，国际方面，美国就业市场韧性仍在，核心通胀仍较顽固，6 月美联储如期暂停加息一次，但鹰派指引超预期。国内方面，二季度经济复苏进入阶段性瓶颈期，复苏斜率有所放缓，市场对于政策的预期升温。6 月官方制造业 PMI 相比 5 月有小幅改善但仍处于枯荣线以下。5 月经济数据显示，生产端较 4 月有小幅改善，但需求端依旧偏软，经济运行情况弱于一季度。5 月工增同比增长 3.5%；固定资产投资累计同比增长 4%，其中基建、制造业、房地产投资均有明显回落，投资对于经济增长的支撑作用进一步减弱，地产新开工、施工和销售面积均处于过去 5 年低位；5 月社零同比增长 12.7%。二季度在贷款需求偏弱的背景下，4 月以来央行不断压降银行存款利率，资金利率持续处于偏低的位置。货币政策方面，央行 6 月先后调降公开市场操作（OMO）、中期借贷便利（MLF）利率，打开了新一轮宽松空间。通胀方面，通胀水平总体保持温和，通胀压力可控。

债券市场方面，一季度，债市逐渐走出去年理财赎回的影响，呈现回暖的态势。1-2 月利率震荡上行，3 月收益率小幅回落，十年国债收益率最低点为 2.81%，最高点为 2.93%。春节前债市由于“弱现实强预期”逻辑而走弱，春节后市场对于经济复苏的速度进行了重新定价，两会后 2023 年经济增长目标设定谨慎，叠加略超预期降准及海外银行体系风险事件，共同推动债市走强。二季度以来，在基本面修复预期转弱、资产荒叠加降息等货币预期落地的利好下，债券市场利率重归下行，中枢从 2.85%下行至 2.65%附近，十年期国债收益率最低点为 2.62%，最高点为 2.86%。6 月降息后，利率调整速度和幅度远超历史降息后表现，稳增长政策预期发酵后长债利率 V 型调整，当前市场对较弱基本面的定价较为充分。临近 7 月政治局会议，政策预期博弈下，利率波动或加大。信用债方面，

经济修复缓慢，政策层面呵护实体经济融资需求，目前信用利差、期限利差处在偏低水平。中债总财富指数二季度以来上涨 1.86%，中债信用债总财富指数上涨 1.24%。

上半年，本基金一二季度的投资策略有较大调整，一季度时大幅降低账户杠杆水平，控制账户久期。第二季度，保持了杠杆水平并明显提升了久期水平，保持了资产配置比例。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期摩根纯债丰利 A 份额净值增长率为:0.64%，同期业绩比较基准收益率为:2.73%

摩根纯债丰利 C 份额净值增长率为:0.58%，同期业绩比较基准收益率为:2.73%。

#### 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，市场对出台托底政策的预期正在变强，但高质量发展的定力仍在，短期政策的出台可能对收益率造成扰动，但在资金保持宽松的预期下，预计收益率上行空间较为有限。

#### 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，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 2023 年 03 月 31 日为收益分配基准日，于 2023 年 04 月 19 日实施收益分配，A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.073 元，C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.070 元，合计发放红利 26,046.95 元。

符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

#### 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

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，出现该情况的时间范围为 2023 年 04 月 03 日至 2023 年 06 月 30 日。

基金管理人拟调整本基金运作方式，加大营销力度，提升基金规模，方案已报监管机关。

## 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在摩根纯债丰利债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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共 26,046.95 元。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## 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：摩根纯债丰利债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	68,797.62	1,482,945.23
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,862,844.79	206,314,269.02
其中：股票投资		-	-

基金投资		-	-
债券投资		3,862,844.79	206,314,269.02
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		511.00	68,057.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,932,153.41	207,865,271.84
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>		-	-
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		-	18,017,869.90
应付清算款		-	-
应付赎回款		9.89	933.28
应付管理人报酬		918.05	48,746.34
应付托管费		306.02	16,248.78
应付销售服务费		30.67	35.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	265,839.24	194,902.99
负债合计		267,103.87	18,278,736.49
<b>净资产:</b>		-	-
实收基金	6.4.7.7	3,595,745.63	185,844,177.30
未分配利润	6.4.7.8	69,303.91	3,742,358.05
净资产合计		3,665,049.54	189,586,535.35
负债和净资产总计		3,932,153.41	207,865,271.84

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日,基金份额总额:3,595,745.63 份,其中:

A 类,基金份额净值:1.0193 元,基金份额:3,255,531.20 份,

C 类,基金份额净值:1.0186 元,基金份额:340,214.43 份。



## 6.2 利润表

会计主体：摩根纯债丰利债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>515,348.75</b>	<b>3,135,953.39</b>
1.利息收入		5,294.94	16,991.77
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,294.94	9,628.83
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	7,362.94
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		538,932.27	3,629,903.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	538,932.27	3,629,903.56
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-60,905.41	-515,253.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	32,026.95	4,311.43
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>354,222.78</b>	<b>809,521.35</b>
1. 管理人报酬		95,622.92	294,389.62
2. 托管费		31,874.37	98,129.86
3. 销售服务费		195.77	1,015.38
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		120,268.07	303,634.86
其中：卖出回购金融资产支出		120,268.07	303,634.86
6. 信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.16	106,261.65	112,351.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>161,125.97</b>	<b>2,326,432.04</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>161,125.97</b>	<b>2,326,432.04</b>

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		161,125.97	2,326,432.04

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：摩根纯债丰利债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	185,844,177.30	-	3,742,358.05	189,586,535.35
二、本期期初净资产（基金净值）	185,844,177.30	-	3,742,358.05	189,586,535.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-182,248,431.67	-	-3,673,054.14	-185,921,485.81
（一）、综合收益总额	-	-	161,125.97	161,125.97
（二）、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）	-182,248,431.67	-	-3,808,133.16	-186,056,564.83
其中：1.基金申购款	1,066,283.95	-	21,844.39	1,088,128.34
2.基金赎回款	-183,314,715.62	-	-3,829,977.55	-187,144,693.17
（三）、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）	-	-	-26,046.95	-26,046.95
四、本期期末净资产（基金净值）	3,595,745.63	-	69,303.91	3,665,049.54
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	219,435,652.56	-	6,554,410.17	225,990,062.73
二、本期期初净资产	219,435,652.56	-	6,554,410.17	225,990,062.7

产（基金净值）				3
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-99,809,825.27	-	-3,204,058.36	-103,013,883.63
（一）、综合收益总额	-	-	2,326,432.04	2,326,432.04
（二）、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）	-99,809,825.27	-	-2,731,928.03	-102,541,753.30
其中：1.基金申购款	10,450,558.45	-	292,766.68	10,743,325.13
2.基金赎回款	-110,260,383.72	-	-3,024,694.71	-113,285,078.43
（三）、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）	-	-	-2,798,562.37	-2,798,562.37
四、本期期末净资产（基金净值）	119,625,827.29	-	3,350,351.81	122,976,179.10

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：王琼慧，主管会计工作负责人：王敏，会计机构负责人：俞文涵

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

摩根纯债丰利债券型证券投资基金(原名为上投摩根纯债丰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]1005号《关于同意上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金募集的批复》核准，由摩根基金管理(中国)有限公司(原上投摩根基金管理有限公司，已于2023年4月10日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根纯债丰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，首次募集期间为2014年10月27日至2014年11月14日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,032,574,160.68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682号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根纯债丰

利债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 11 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,032,760,303.77 份基金份额，其中认购资金利息折合 186,143.09 份基金份额。本基金的基金管理人为摩根基金管理(中国)有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据摩根基金管理(中国)有限公司 2023 年 4 月 12 日发布的《关于公司法定名称变更的公告》，本基金管理人的中文法定名称由“上投摩根基金管理有限公司”变更为“摩根基金管理(中国)有限公司”。根据同一天发布的《摩根基金管理(中国)有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金自该日起更名为摩根纯债丰利债券型证券投资基金。

根据《摩根纯债丰利债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时，不收取认购/申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，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，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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根纯债丰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、可分离交易可转债的纯债部分、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%，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摩根基金管理(中国)有限公司于 2023 年 8 月 30 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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<年度报告和中期报告>》、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》、《摩根纯债丰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 2023 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净资产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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

### 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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项税额抵扣等增值税政策的通知》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) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	68,797.62
等于：本金	68,790.46
加：应计利息	7.16
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	68,797.62

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	52,164.79	3,862,844.79	21,355.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	52,164.79	3,862,844.79	21,355.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,789,325.00	52,164.79	3,862,844.79	21,355.00

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 6.4.7.5 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	40.61
其中：交易所市场	40.61
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	265,798.63
合计	265,839.24

#### 6.4.7.7 实收基金

摩根纯债丰利债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	185,455,733.54	185,455,733.54
本期申购	571,828.84	571,828.84
本期赎回（以“-”号填列）	-182,772,031.18	-182,772,031.18
本期末	3,255,531.20	3,255,531.20

摩根纯债丰利债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	388,443.76	388,443.76
本期申购	494,455.11	494,455.11
本期赎回（以“-”号填列）	-542,684.44	-542,684.44
本期末	340,214.43	340,214.43

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

摩根纯债丰利债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,022,227.95	2,712,489.51	3,734,717.46



本期利润	222,201.48	-63,175.82	159,025.66
本期基金份额交易产生的变动数	-1,224,389.84	-2,582,749.05	-3,807,138.89
其中：基金申购款	3,927.04	7,646.89	11,573.93
基金赎回款	-1,228,316.88	-2,590,395.94	-3,818,712.82
本期已分配利润	-23,638.17	-	-23,638.17
本期末	-3,598.58	66,564.64	62,966.06

摩根纯债丰利债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,990.13	5,650.46	7,640.59
本期利润	-170.10	2,270.41	2,100.31
本期基金份额交易产生的变动数	-1.32	-992.95	-994.27
其中：基金申购款	2,355.72	7,914.74	10,270.46
基金赎回款	-2,357.04	-8,907.69	-11,264.73
本期已分配利润	-2,408.78	-	-2,408.78
本期末	-590.07	6,927.92	6,337.85

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,991.54
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	303.40
其他	-
合计	5,294.94

6.4.7.10 股票投资收益

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,072,002.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及	-533,069.75

债券到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	538,932.27

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	287,542,318.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	283,746,679.59
减：应计利息总额	4,323,933.46
减：交易费用	4,775.16
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-533,069.75

**6.4.7.12 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.13 股利收益**

无。

**6.4.7.14 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-60,905.41
——股票投资	-
——债券投资	-60,905.41
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-60,905.41

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	31,933.78
转换费收入	93.17
合计	32,026.95

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	26,291.26
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,863.02
其他	600.00
账户维护费	18,000.00
合计	106,261.65

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

根据中国证监会证监许可(2023)151 号《关于核准上投摩根基金管理有限公司变更股东、实际控制人的批复》，核准摩根资产管理控股公司(JPMorgan Asset Management Holdings Inc.)成为上投摩根基金管理有限公司主要股东；核准摩根大通公司(JPMorgan Chase & Co.)成为上投摩根基金管理有限公司实际控制人；对摩根资产管理控股公司依法受让上投摩根基金管理有限公司 2.5 亿元出资(占注

册资本比例 100%)无异议。相关股权变更工商变更手续于 2023 年 3 月 24 日完成。公司股东由摩根资产管理(英国)有限公司及上海浦东发展银行股份有限公司变更为摩根资产管理控股公司。

#### 6.4.9.2 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
摩根基金管理(中国)有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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	基金管理人的股东上海国际信托有限公司的控股股东(2023 年 3 月 24 日前)、基金销售机构

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	95,622.92	294,389.62
其中：支付销售机构的客户维护费	2,600.98	3,961.88

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3%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 × 0.3%/当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	31,874.37	98,129.86

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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 0.1% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 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 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	摩根纯债丰利债券A	摩根纯债丰利债券C	合计
中国银行	-	30.49	30.49
浦发银行	-	0.82	0.82
摩根基金管理(中国)有限公司	-	0.48	0.48
合计	-	31.79	31.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	摩根纯债丰利债券A	摩根纯债丰利债券C	合计
中国银行	-	36.97	36.97
上投摩根基金管理有 限公司	-	2.21	2.21
合计	-	39.18	39.18

注：1.支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

2.2023 年 3 月 24 日公司完成股权变更，浦发银行作为本期关联方的期间为：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 23 日。

### 6.4.10.3 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 2023年1月1日至2023年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
浦发银行	-	21,545,463.	-	-	-	-

		84				
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

注：2023 年 3 月 24 日公司完成股权变更，故而浦发银行作为本期关联方的期间为：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 23 日。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

##### 6.4.10.5.2 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

无。

#### 6.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	68,797.62	4,991.54	689,967.12	9,618.18

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10.8.2 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。

6.4.11 利润分配情况

摩根纯债丰利债券 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2023-04-18	-	2023- 04-18	0.073	18,181.42	5,456.75	23,638.17	-
合计				0.073	18,181.42	5,456.75	23,638.17	-

摩根纯债丰利债券 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2023-04-18	-	2023- 04-18	0.070	1,976.79	431.99	2,408.78	-
合计				0.070	1,976.79	431.99	2,408.78	-

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型证券投资基金，属于中低风险品种。本基金投资范围主要为固定收益类金融工具。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金获取稳定的投资收益。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律，法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监查和风险评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管，并提出内控建议。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。



本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	10,202,128.77
合计	-	10,202,128.77

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年末
--------	-----	-----

	2023年6月30日	2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	3,862,844.79	196,112,140.25
合计	3,862,844.79	196,112,140.25

注：未评级的债券为国债及政策性金融债。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流

通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在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时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	68,797.62	-	-	-	68,797.62
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	207,422.63	3,449,325.91	206,096.25	-	3,862,844.79
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	511.00	511.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	276,220.25	3,449,325.91	206,096.25	511.00	3,932,153.41
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	9.89	9.89
应付管理人报酬	-	-	-	918.05	918.05
应付托管费	-	-	-	306.02	306.02
应付销售服务费	-	-	-	30.67	30.67
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	265,839.24	265,839.24

负债总计	-	-	-	267,103.87	267,103.87
利率敏感度缺口	276,220.25	3,449,325.91	206,096.25	-266,592.87	3,665,049.54
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,482,945.23	-	-	-	1,482,945.23
交易性金融资产	11,518,940.80	194,795,328.22	-	-	206,314,269.02
应收申购款	-	-	-	68,057.59	68,057.59
资产总计	13,001,886.03	194,795,328.22	-	68,057.59	207,865,271.84
负债					
卖出回购金融资产款	18,017,869.90	-	-	-	18,017,869.90
应付赎回款	-	-	-	933.28	933.28
应付管理人报酬	-	-	-	48,746.34	48,746.34
应付托管费	-	-	-	16,248.78	16,248.78
应付销售服务费	-	-	-	35.20	35.20
其他负债	-	-	-	194,902.99	194,902.99
负债总计	18,017,869.90	-	-	260,866.59	18,278,736.49
利率敏感度缺口	-5,015,983.87	194,795,328.22	-	-192,809.00	189,586,535.35

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	增加约 2	增加约 70
	2.市场利率上升 25 个基点	减少约 2	减少约 69

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	3,862,844.79	206,314,269.02
第三层次	-	-
合计	3,862,844.79	206,314,269.02

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 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	3,862,844.79	98.24
	其中：债券	3,862,844.79	98.24
	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	68,797.62	1.75
8	其他各项资产	511.00	0.01
9	合计	3,932,153.41	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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

本基金本报告期末买入卖出股票。

### 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	3,655,422.16	99.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	207,422.63	5.66
	其中：政策性金融债	207,422.63	5.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,862,844.79	105.40

### 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	019691	22 国债 26	19,000	1,927,583.31	52.59
2	019693	22 国债 28	15,000	1,521,742.60	41.52
3	018008	国开 1802	2,000	207,422.63	5.66
4	019547	16 国债 19	1,000	104,965.70	2.86
5	019690	22 国债 25	1,000	101,130.55	2.76

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 本基金投资股指期货的投资政策**

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**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.12 本报告期投资基金情况**

**7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细**

本基金本报告期末未持有基金投资。

**7.13 投资组合报告附注**

7.13.1 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。

7.13.2 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。

**7.13.3 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	511.00

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	511.00

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.13.5 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。

#### 7.13.6 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	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
摩根纯债丰利债券 A	243	13,397.25	-	0.00%	3,255,531.20	100.00%
摩根纯债丰利债券 C	506	672.36	-	0.00%	340,214.43	100.00%
合计	749	4,800.73	-	0.00%	3,595,745.63	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	摩根纯债丰利债券 A	19.43	0.0006%
	摩根纯债丰利债券 C	-	-
	合计	19.43	0.0005%

## 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	摩根纯债丰利债券 A	0
	摩根纯债丰利债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	摩根纯债丰利债券 A	0
	摩根纯债丰利债券 C	0
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	摩根纯债丰利债券 A	摩根纯债丰利债券 C
基金合同生效日（2014 年 11 月 18 日）基金份额总额	860,374,024.45	172,386,279.32
本报告期期初基金份额总额	185,455,733.54	388,443.76
本报告期基金总申购份额	571,828.84	494,455.11
减：本报告期基金总赎回份额	182,772,031.18	542,684.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,255,531.20	340,214.43

## 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：

2023 年 1 月，公司股东选举组成新的董事会：Daniel Watkins 先生、Paul Bateman 先生、Paul Quinsee 先生、王大智先生、汪棣先生、曾翀先生和 Matthew Bersani 先生；同时决定原董事会成员陈兵先生、陈海宁先生、林仪桥先生和周晔先生不再担任公司董事职务，刘红忠先生和王学杰先生不再担任公司独立董事职务。

2023 年 6 月，公司股东新增并选举王琼慧女士和杜猛先生出任公司董事职务。

基金管理人于 2023 年 4 月 1 日公告，自 2023 年 3 月 31 日起，刘鲁旦先生不再担任公司副总经理。

基金管理人于 2023 年 4 月 27 日公告,自 2023 年 4 月 25 日起,Daniel Watkins 先生担任公司董事长,王大智先生不再代为履行董事长职务。

基金管理人于 2023 年 6 月 30 日公告,自 2023 年 6 月 28 日起,王琼慧女士担任公司总经理、法定代表人,王大智先生不再担任公司总经理、法定代表人。

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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内,管理人未受稽查或处罚,亦未发现管理人的高级管理人员受稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内,托管人未受稽查或处罚,亦未发现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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
高华证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	1,027.66	100.00%	-

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

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. 本基金本期无新增席位、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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
高华证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	5,091,275.00	100.00%	415,000.00	100.00%	-	-

**10.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于上投摩根基金管理有限公司股东及实际控制人变更的公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2023-01-21
2	上投摩根基金管理有限公司关于董事变更的公告	同上	2023-02-01
3	关于上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金提高基金份额净值精度的公告	同上	2023-03-29
4	上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金基金经理变更公告	同上	2023-04-01
5	上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2023-04-01
6	关于公司法定名称变更的公告	同上	2023-04-12
7	摩根基金管理(中国)有限公司关于旗下基金更名事宜的公告	同上	2023-04-12
8	摩根纯债丰利债券型证券投资基金分红公告	同上	2023-04-14

9	摩根基金管理（中国）有限公司关于董事长变更的公告	同上	2023-04-27
10	摩根基金管理（中国）有限公司关于深圳分公司法定名称变更的公告	同上	2023-05-13
11	摩根基金管理（中国）有限公司关于北京分公司法定名称变更的公告	同上	2023-05-19
12	摩根基金管理（中国）有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2023-06-30

## 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					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	20230101-20230327	116,902,094.50	0.00	116,902,094.50	0.00	0.00%
	2	20230101-20230109	65,322,468.41	0.00	65,322,468.41	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。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金募集的文件
- 2、《摩根纯债丰利债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《摩根纯债丰利债券型证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 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、营业执照

7、《摩根基金管理（中国）有限公司开放式基金业务规则》

8、中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

## 12.3 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。

摩根基金管理（中国）有限公司

二〇二三年八月三十一日