

2018年9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:二〇一八年十月二十四日

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... 基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资风险,投资者在作出投资决策前

Table with 2 columns: 主要财务指标, 单位:人民币元. Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.期末基金资产净值, etc.

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 净值增长率③, 净值增长率④, 净值增长率⑤. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

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.上投摩根货币A:

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 净值增长率③, 净值增长率④, 净值增长率⑤. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

上投摩根货币市场基金

2018年第三季度报告

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》

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.固定收益类, 2.权益类, etc.

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 宏观经济方面,三季度固定资产投资增速较二季度末的6%下降至5.3%

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.固定收益类, 2.权益类, etc.

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 无。 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.固定收益类, 2.权益类, etc.

上投摩根分红添利债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

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

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.权益投资, 2.固定收益, etc.

5.1 报告期末基金资产组合情况 5.1.1 报告期末基金资产组合情况

上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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》

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.权益类, 2.固定收益, etc.

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 宏观经济方面,三季度固定资产投资增速较二季度末的6%下降至5.3%

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.权益类, 2.固定收益, etc.

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 无。 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.权益类, 2.固定收益, etc.

上投摩根货币市场基金

2018年第三季度报告

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》

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1.权益类, 2.固定收益, etc.

5.1 报告期末基金资产组合情况 5.1.1 报告期末基金资产组合情况

5.7 影子定价与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 2 columns: 报告期内偏离度的绝对值在0.25%以内的次数, 偏离度的绝对值在0.25%至0.5%之间的次数, etc.

5.9.1 基金计价方法说明 本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其存续期间按实际利率法摊销,每日计提收益

Table with 2 columns: 项目, 上投摩根货币A, 上投摩根货币B. Rows include 本报告期末基金份额总额, 本报告期末基金份额总额, etc.

8.1 备查文件目录 1.中国证监会批准上投摩根货币市场基金设立的文件; 2.上投摩根货币市场基金基金合同;

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.1.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 180207, 18国债07, etc.

5.1.2 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 180207, 18国债07, etc.

5.1.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.