

上投摩根现金管理货币市场基金

2015 第二季度报告

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:二〇一五年七月二十日

重要提示
基金管理人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:二〇一五年七月二十日

重要提示
基金管理人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。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2015年4月1日至2015年6月30日). Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 本期基金份额净值, etc.

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。本期公允价值变动收益指本期公允价值变动收益扣除相关费用后的余额。

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比
阶段 净增长率① 净增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2015年4月1日至2015年6月30日). Rows include 本期已实现收益, 本期利润, etc.

注:本基金建仓期自2014年6月10日至2015年2月18日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同规定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

注: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。注2:王亚南女士为本公司前任基金经理,其任期自本期本基金合同生效之日起。

4.2 报告期内基金投资策略和运作分析
一季度,国内经济保持平稳增长态势,工业产出在一季度的基础上继续增长,增速处于低位;进出口增速有所回升,但进口增速下降更快,贸易顺差进一步扩大;消费增速也有所回升,但消费水平、消费结构、消费质量仍待提高。

4.3 公平交易专项说明
报告期内,本公司严格执行落实《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制度的各项要求,严格规范境内上市股票、债券的一级市场和二级市场交易等。

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
一季度,国内经济保持平稳增长态势,工业产出在一季度的基础上继续增长,增速处于低位;进出口增速有所回升,但进口增速下降更快,贸易顺差进一步扩大;消费增速也有所回升,但消费水平、消费结构、消费质量仍待提高。

4.4.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,通过对不同投资组合之间的收益交叉分析,未发现异常交易行为。

4.4.3 公平交易专项说明
报告期内,通过对不同投资组合之间的收益交叉分析,未发现异常交易行为。

4.4.4 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
一季度,国内经济保持平稳增长态势,工业产出在一季度的基础上继续增长,增速处于低位;进出口增速有所回升,但进口增速下降更快,贸易顺差进一步扩大;消费增速也有所回升,但消费水平、消费结构、消费质量仍待提高。

4.4.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,通过对不同投资组合之间的收益交叉分析,未发现异常交易行为。

4.4.3 公平交易专项说明
报告期内,通过对不同投资组合之间的收益交叉分析,未发现异常交易行为。

4.4.4 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
一季度,国内经济保持平稳增长态势,工业产出在一季度的基础上继续增长,增速处于低位;进出口增速有所回升,但进口增速下降更快,贸易顺差进一步扩大;消费增速也有所回升,但消费水平、消费结构、消费质量仍待提高。

4.4.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,通过对不同投资组合之间的收益交叉分析,未发现异常交易行为。

4.4.3 公平交易专项说明
报告期内,通过对不同投资组合之间的收益交叉分析,未发现异常交易行为。

4.4.4 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
一季度,国内经济保持平稳增长态势,工业产出在一季度的基础上继续增长,增速处于低位;进出口增速有所回升,但进口增速下降更快,贸易顺差进一步扩大;消费增速也有所回升,但消费水平、消费结构、消费质量仍待提高。

4.4.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,通过对不同投资组合之间的收益交叉分析,未发现异常交易行为。

4.4.3 公平交易专项说明
报告期内,通过对不同投资组合之间的收益交叉分析,未发现异常交易行为。

4.4.4 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
一季度,国内经济保持平稳增长态势,工业产出在一季度的基础上继续增长,增速处于低位;进出口增速有所回升,但进口增速下降更快,贸易顺差进一步扩大;消费增速也有所回升,但消费水平、消费结构、消费质量仍待提高。

4.4.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,通过对不同投资组合之间的收益交叉分析,未发现异常交易行为。

4.4.3 公平交易专项说明
报告期内,通过对不同投资组合之间的收益交叉分析,未发现异常交易行为。

4.4.4 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
一季度,国内经济保持平稳增长态势,工业产出在一季度的基础上继续增长,增速处于低位;进出口增速有所回升,但进口增速下降更快,贸易顺差进一步扩大;消费增速也有所回升,但消费水平、消费结构、消费质量仍待提高。

4.4.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,通过对不同投资组合之间的收益交叉分析,未发现异常交易行为。

4.4.3 公平交易专项说明
报告期内,通过对不同投资组合之间的收益交叉分析,未发现异常交易行为。

4.4.4 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
一季度,国内经济保持平稳增长态势,工业产出在一季度的基础上继续增长,增速处于低位;进出口增速有所回升,但进口增速下降更快,贸易顺差进一步扩大;消费增速也有所回升,但消费水平、消费结构、消费质量仍待提高。

4.4.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,通过对不同投资组合之间的收益交叉分析,未发现异常交易行为。

贷款基准利率和存款准备金率。目前1年期存款基准利率已经与2002年的历史低位相差无几,未来如果继续下调将创历史新低。

在报告本报告期内货币政策放松的推动下,特别是4月20号降低存款准备金率1个百分点后,二季度债券市场收益整体快速下行,短端下降幅度较大,1年期国债下降150bp,1年期金融债也有120bp的降幅,信用债收益率变化不大,小幅下降约5bp,信用债收益率有明显提高,高等、高等1年期短期融资券下降约130bp。

二季度,本基金适当增加了现金的配置比例,小幅降低了同业配置比例,协议存款占比基本保持稳定。总体上,本基金在现金、存款和回购中保持均衡配置。同时,为了更好的满足流动性需求,基金保留了较高的现金头寸。

展望三季度,我们认为货币政策仍将保持宽松态势,虽然存款利率已经接近历史低位,但考虑到实际利率仍然处于较高水平,未来货币政策调整的空间仍然存在,货币市场利率也还处处于较低水平,如由于事件冲击导致利率波动,可考虑适当增加同业比例。同时,回购市场仍是不错的投资选择,基金将在回购市场、存款和现券中做出合理配置,在保持流动性的前提下,力争为持有人获取更高的回报。

4.2 报告期内基金的投资表现
本报告期本基金份额净值增长率为5.307%,同期业绩比较基准收益率为0.088%。4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警提示

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(%)

Table with 2 columns: 序号, 项目. Rows include 1. 固定收益投资, 2. 买入返售金融资产, etc.

5.2 报告期末债券回购融资情况
序号 项目 金额(元) 占基金资产净值的比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 项目. Rows include 1. 报告期末债券回购融资余额, 2. 报告期末债券回购融资余额中, 其中:质押式回购融资余额

5.3 基金投资组合平均剩余期限
5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况
报告期末投资组合平均剩余期限 38

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例
序号 平均剩余期限 各期限资产占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 平均剩余期限. Rows include 1. 30天以内, 2. 30天(含)—60天, etc.

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(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种. Rows include 1. 国家债券, 2. 央行票据, etc.

5.5 报告期末按成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 持仓成本(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券代码. Rows include 1. 140203, 2. 150202, etc.

5.6 影子定价与摊余成本法计量的偏离度的报告期内偏离度的绝对值

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十名资产支持证券投资明细
序号 资产支持证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 资产支持证券名称. Rows include 1. 华安证券, 2. 华安证券, etc.

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.8.2 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.8.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.8.4 其他各项资产说明
序号 名称 金额(元)

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

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分
因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分之和与合计可能尾差。

5.9 基金管理人及基金托管人
5.9.1 基金管理人
名称 基金管理人或基金托管人 金额(元)

Table with 2 columns: 名称, 基金管理人或基金托管人. Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.2 基金托管人
名称 基金管理人或基金托管人 金额(元)

Table with 2 columns: 名称, 基金管理人或基金托管人. Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.3 会计师事务所
名称 基金管理人或基金托管人 金额(元)

Table with 2 columns: 名称, 基金管理人或基金托管人. Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.4 其他
名称 基金管理人或基金托管人 金额(元)

Table with 2 columns: 名称, 基金管理人或基金托管人. Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.5 其他
名称 基金管理人或基金托管人 金额(元)

Table with 2 columns: 名称, 基金管理人或基金托管人. Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.6 其他
名称 基金管理人或基金托管人 金额(元)

Table with 2 columns: 名称, 基金管理人或基金托管人. Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.7 其他
名称 基金管理人或基金托管人 金额(元)

Table with 2 columns: 名称, 基金管理人或基金托管人. Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.8 其他
名称 基金管理人或基金托管人 金额(元)

Table with 2 columns: 名称, 基金管理人或基金托管人. Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.9 其他
名称 基金管理人或基金托管人 金额(元)

Table with 2 columns: 名称, 基金管理人或基金托管人. Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.10 其他
名称 基金管理人或基金托管人 金额(元)

Table with 2 columns: 名称, 基金管理人或基金托管人. Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.9.11 其他
名称 基金管理人或基金托管人 金额(元)

上投摩根新兴动力股票型证券投资基金

2015 第二季度报告

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十日

重要提示
基金管理人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。

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十日

重要提示
基金管理人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。