

# 上投摩根天添盈货币市场基金招募说明书

# 更新摘要

## 3 基金投资组合平均剩余期限

### 3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	40
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	41
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

### 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的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	67.41	-
2	30天(含)—60天	12.46	-
3	60天(含)—90天	10.91	-
4	90天(含)—180天	9.37	-
5	180天(含)—2397天(含)	-	-
6	合计	100.15	-

### 4 报告期末投资组合品种的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,093,257.31	12.49
4	其中:政策性金融债	40,093,257.31	12.49
5	企业债券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	115,084,902.94	35.86
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

### 5 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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150403	15农发03	200,000.00	20,082,201.76	6.26
2	140230	14国开30	200,000.00	20,011,066.56	6.24
3	011561004	15工商银行SCP004	100,000.00	10,000,086.88	3.12
4	011584003	15工商银行SCP003	100,000.00	9,999,880.15	3.12
5	011592223	15鲁金债02	100,000.00	9,999,504.78	3.12
6	011544001	15招商银行SCP001	100,000.00	9,989,397.52	3.12
7	011525004	15工商银行SCP004	100,000.00	9,989,656.30	3.12
8	011599660	15大唐转债SCP002	100,000.00	9,997,897.70	3.12
9	011503003	15中石油SCP003	100,000.00	9,997,158.60	3.12
10	011569442	15招商银行SCP003	50,000.00	4,999,543.60	1.56

### 6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%—0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0795%
报告期内偏离度的最低值	-0.0434%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0500%

### 7 报告期末按投资组合公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

### 8 投资组合报告附注

### 8.1 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,在其剩余期限内按实际利率法摊销,每日计提收益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

8.2 报告期内本基金未存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

8.3 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。

### 8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,720,426.36
4	应收申购款	567,280.79
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,287,707.14

### 8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因持仓五人原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计数可能存在尾差。

基金份额持有人如欲了解本基金投资组合的其他相关信息,可致电本基金管理人获取。

### 六、基金的投资

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	净值比较基准收益率③	①-③	②-④
2014/11/25-2014/12/31	A 0.4366% B 0.4066% E 0.4520%	0.0056% 0.0066% 0.0066%	0.1388% 0.1388% 0.1388%	0.0000% 0.0000% 0.0000%	0.2888% 0.0000% 0.0066%
2015/1/1-2015/6/30	A 1.5269% B 1.6504% E 1.6053%	0.0019% 0.0019% 0.0019%	0.6955% 0.6955% 0.6955%	0.0000% 0.0000% 0.0000%	0.8574% 0.0019% 0.0019%
2015/1/1-2015/9/30	A 2.0615% B 2.2479% E 2.1794%	0.0022% 0.0022% 0.0022%	1.0097% 1.0097% 1.0097%	0.0000% 0.0000% 0.0000%	1.0518% 0.0022% 1.2382%
				0.0000%	1.1697%

### 七、基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 基金管理人的管理费;
- 基金托管人的托管费;

### 3、销售服务费

- 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
- 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
- 基金份额持有人大会费用;

### 7、基金的证券交易费用;

### 8、基金的银行汇划费用;

### 9、基金的开户费用、账户维护费用;

- 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H= E×0.33%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日该基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核一致的财务数据,自动在月初五个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需出具资金划拨指令,若遇法定节假日、休息日或不可抗力等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H= E×0.1%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日该基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核一致的财务数据,自动在月初五个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需出具资金划拨指令,若遇法定节假日、休息日或不可抗力等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

### 3、销售服务费

本基金A类基金份额的销售服务费年费率为0.25%,B类基金份额的销售服务费年费率为0.01%,C类基金份额的销售服务费年费率为0.1%。

各类基金份额的销售服务费的计算方法如下:

H= E×年销售服务费÷当年天数

H为每日该基金应计提的销售服务费

E为前一日该基金的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核一致的财务数据,自动在月初五个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需出具资金划拨指令,若遇法定节假日、休息日或不可抗力等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

### 八、其他应披露事项

《上投摩根天添盈货币市场基金招募说明书》于2014年11月25日发布,于2015年1月24日运作满一年,现依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合基金管理人对本基金基金的投资经营情况,对2015年7月8日的《上投摩根天添盈货币市场基金招募说明书(更新)》进行内容补充和更新,主要更新的内容如下:

1.在重要提示中,更新内容截止日为2015年11月24日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2015年9月30日。

2.在“三、基金管理人”的“主要人员情况”中,对董事、监事、其他高级管理人员、基金经理及其他投资决策委员会等会议进行了更新。

3.在“四、基金托管人”中,对基金托管人的信息进行了更新。

4.在“五、相关服务机构”中,对代销机构的信息进行了更新。

5.在“九、基金的投资”的“基金的投资组合报告”中,根据本基金实际运作情况进行了最近一期投资组合报告的内容。

6.在“十、基金业绩”中,根据基金的实际运作情况,对本基金成立以来的业绩进行了说明。

7.在“二十三、其他应披露事项”中,对本披露期内的重大事项进行了披露。

## 基金合同生效日:2014年11月25日

## 基金管理人:上投摩根基金管理有限公司

## 基金托管人:中信银行股份有限公司

中最早成立的新兴商业银行之一,是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行,并以原创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展,中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大,于2005年8月,正式更名“中信银行”。2006年12月,以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东,正式成立中信银行股份有限公司。同年,成功引进战略投资者,与欧盛领先的西班牙对外银行(BBVA)建立了优势互补的合作关系等。2007年4月20日,中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2009年,中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司(简称:中国信金)70.32%股权。经过二十多年的发展,中信银行已成为中国资本实力最雄厚的商业银行之一,是一家快速增长并具备强大综合竞争力的全国性银行。

2004年,中信银行通过了美国SAS70内部控制审计并获得无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健全有效性全面认可。

(二)主要人员情况

李庆萍,行长,高级经济师。1984年8月至2007年1月,任中国农业银行总行国际业务部干部、副处长、处长、副总经理。2007年1月至2008年12月,任中国农业银行广西分行党委书记、行长。2009年1月至2009年5月,任中国农业银行零售业务总监兼个人业务部、个人信贷业务部总经理。2009年5月至2013年9月,任中国农业银行总行零售业务总监兼个人金融部总经理。2013年9月至2014年7月,任中国中信股份有限公司副总经理。2014年7月,任中国中信银行股份有限公司副总经理、中信银行行长。

杨晓生,中信银行副行长,分管托管业务。1962年12月生,2011年4月起担任中国建设银行江苏省分行行长,党委书记;2006年7月至2011年3月担任中国建设银行河北省分行行长,党委书记;1992年8月至2006年7月在中国建设银行河南省分行工作,历任计划财务处专员、副处长,信阳地区中心支行副行长,党组成员,计划处处长,中办处处长,郑州市铁路专业支行行长,党组书记,郑州分行行长,党委书记,金水支行行长,党委书记,河南省分行副行长。

邓陈云先生,现任中信银行股份有限公司资产托管部总经理,经济学博士。1996年8月进入本行工作,历任总行行政秘书科长、总行投资银行部处经理、总行资产保全部主管、总行国际业务部助理、副总经理、副总经理(主持工作)。

(三)基金托管业务经营情况

2004 年 8 月 18 日,中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准,取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则,切实履行托管人职责。

截至2015年6月30日,中信银行已托管63只开放式证券投资基金及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、ODII等其他托管资产,托管总规模突破4万亿元人民币。

### 三、相关服务机构

#### 1、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)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

(2)深圳众禄基金销售有限公司  
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼E、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E、J单元  
法定代表人:薛峰  
客服电话:4006-788-887  
公司网站:www.zlfund.cn www.jimw.com

(3)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9号1901室  
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:凌骥平  
客服电话:4008-773-772  
公司网站:www.5ifund.com

(4)杭州数米基金销售有限公司  
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼  
法定代表人:陈柏青  
客服电话:400-0766-123  
公司网站:www.fund123.cn

(5)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层9楼  
法定代表人:其实  
客服电话:400-1818-188  
网站:www.1234567.com.cn

(6)和讯信息科技有限公司  
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层  
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层  
法定代表人:王莉  
客服电话:4009200222,021-20635588  
网站:licaikehexun.com

(7)一路财富(北京)信息科技有限公司  
注册地址:北京市西城区车庄大街甲9号五栋大楼C座702  
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208  
法定代表人:吴雪勇  
客服电话:400-001-1566  
网站:www.yilucaifu.com

(8)上海利得基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区临川路1475号1033室  
办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼  
法定代表人:沈坚伟  
客服电话:4000676266  
网站:www.leadbank.com.cn

(9)上海汇付金融服务有限公司  
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室  
办公地址:上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼  
法定代表人:冯鹤俊  
客服电话:400-820-2819  
网站:fundbundtrade.com

(10)上海基金证券资产管理有限公司  
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:董晓  
客服电话:400-821-9031  
网站:www.lufunds.com

(11)北京恒天明泽基金销售有限公司  
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层6122室  
办公地址:北京市朝阳区东三环中路口乐成中心A座202层  
法定代表人:梁璇  
客服电话:400-898-0618  
网站:www.chtfund.com

(12)北京众源源泰投资有限公司  
注册地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603  
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号望泰中心A座16层  
法定代表人:董浩  
客服电话:400-068-1176  
网站:www.jimufund.com

(13)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

(14)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司  
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#  
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富都大厦16层  
法定代表人:杨晓  
客服电话:400-166-1188  
网站:http://8339069.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:上海潮新律师事务所  
注册地址:上海市浦东新区256号华夏银行大厦14楼  
负责人:廖海  
联系电话:021-5115 0298  
传真:021-5115 0398  
经办律师:廖海、刘佳

四、审计本基金财产的会计师事务所  
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司  
注册地址: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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼  
法定代表人:吴港平  
联系电话:0861-22123327  
联系人:江隽  
经办注册会计师:江隽、王玥

#### 四、基金概况

基金名称:上投摩根天添盈货币市场基金

基金类型:契约型开放式

#### 五、基金的投资

一、投资目标  
在有效控制投资风险和保持较高流动性的前提下,为投资者提供资金的流动性储备,并进一步优化资金管理,力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。

二、投资范围  
本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金、通知存款、短期融资券、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、剩余期限在397 天以内(含397 天)的债券、剩余期限在397 天以内(含397 天)的中期票据、剩余期限在397 天以内(含397 天)的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其它品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

#### 三、投资策略

本基金将综合考虑各类可投资品种的收益性、流动性及风险性特征,对各类资产进行合理的配置和选择,在保证基金资产的安全性和流动性基础上,力争为投资者创造稳定的投资收益。

#### 1、类属资产配置策略

本基金以短期金融工具作为投资对象,基于对各细分市场的市场规模、交易情况、各交易品种的流动性、相对收益、信用风险以及投资组合平均剩余期限要求等重要指标的分析,确定、调整投资组合的类别资产配置比例。

#### 2、收益率曲线策略

收益率曲线策略通过考察市场收益率曲线的动态变化及预期变化,结合对当期和远期资金面的分析,寻求在一段时期内获取收益率曲线形状变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益。本基金将根据收益率曲线形状变化的预期,确定合理的套期结构,包括采用牛熊策略、哑铃策略和梯形策略等,在不同期限资产间进行动态调整。

#### 3、利率预期策略

利率变化是影响债券价格的最重要因素,本基金将通过对国内外宏观经济走势、货币政策和财政政策、市场利率变化和短期资金供给等因素的综合分析,形成对未来市场利率变动的预期,并以此确定和调整组合的平均剩余期限。当市场利率看涨时,适度缩短投资组合平均剩余期限,即减持剩余期限较长投资品种增持剩余期限较短品种,降低组合整体净值