

上投摩根货币市场基金

[2015] 第四季度报告

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:二〇一六年一月二十二日

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、完整性和及时性承担法律责任。
本基金托管人中国建设银行股份有限公司复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策、风险揭示、投资组合报告和投资意见等内容，确认不存在虚假记载、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。

报告书日期:2015年10月1日起至2015年12月31日止。

2. 基金产品概况

基金简称 上投摩根货币
基金代码 5370010
基金运作方式 灵活型开放式
基金合同生效日 2006年4月13日
报告期末基金份额总额 114,304,140.64319
投资目标 在有效控制投资风险和保持较低波动的前提下，为投资者提供资金的流动性，进一步优化资产配置，并力求获得高于同期存款基准收益的回报。

本基金将投资资产将充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法，对各类可投资品种进行深入研究，通过分析宏观经济形势、行业景气度、资金面、利率水平、流动性及风险特征，在风险与收益的配比中，力求将各类风险降到最低，并在控制基金净值波动率的前提下实现收益。

本基金将努力把握久期策略、资产配置策略、债券选择策略、利率预测策略、现金流策略、预期收益率策略以及PMI指数策略，但持续增长缺乏动力，整体经济仍将持续回暖，出口回暖将带来新的增长动能，国内外经济没有明显变化，从固定收益投资角度来看，四季的投资策略将有所调整，但总体来看，还是以持有为主，但没有超出下行区间。

基金管理人承諾以誠實信用、勤勉盡責的原則管理運營和運作基金資產，但不保證基金一定盈利。

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。

报告书日期:2015年10月1日起至2015年12月31日止。

3. 财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2015年10月1日至2015年12月31日

上投摩根货币 上投摩根货币

1.本期已实现收益 964,953.32 410,721,464.77

2.本期利润 964,953.32 410,721,464.77

3.期末现金类资产净值 114,274,879.96 114,274,743,785.23

注:本期已实现收益指收入(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,由于货币市场基金采用摊余成本核算,因此,公允价值变动收益=0。

注:本期基金份额交易费用不包括交易基金的各项费用(例如基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 净值表现

3.2.2 净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3 上投摩根货币A

3.2.4 净值收益率① 净值收益率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④

过去三个月 0.5394% 0.0006% 0.3403% 0.0000%

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2015年10月1日至2015年12月31日

上投摩根货币 上投摩根货币

1.本期已实现收益 964,953.32 410,721,464.77

2.本期利润 964,953.32 410,721,464.77

3.期末现金类资产净值 114,274,879.96 114,274,743,785.23

注:本期已实现收益指收入(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,由于货币市场基金采用摊余成本核算,因此,公允价值变动收益=0。

注:本期基金份额交易费用不包括交易基金的各项费用(例如基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.5 报告期按基金资产的分类

3.2.6 报告期按基金资产的类别

3.2.7 报告期按基金资产的类别

3.2.8 报告期按基金资产的类别

3.2.9 报告期按基金资产的类别

3.2.10 报告期按基金资产的类别

3.2.11 报告期按基金资产的类别

3.2.12 报告期按基金资产的类别

3.2.13 报告期按基金资产的类别

3.2.14 报告期按基金资产的类别

3.2.15 报告期按基金资产的类别

3.2.16 报告期按基金资产的类别

3.2.17 报告期按基金资产的类别

3.2.18 报告期按基金资产的类别

3.2.19 报告期按基金资产的类别

3.2.20 报告期按基金资产的类别

3.2.21 报告期按基金资产的类别

3.2.22 报告期按基金资产的类别

3.2.23 报告期按基金资产的类别

3.2.24 报告期按基金资产的类别

3.2.25 报告期按基金资产的类别

3.2.26 报告期按基金资产的类别

3.2.27 报告期按基金资产的类别

3.2.28 报告期按基金资产的类别

3.2.29 报告期按基金资产的类别

3.2.30 报告期按基金资产的类别

3.2.31 报告期按基金资产的类别

3.2.32 报告期按基金资产的类别

3.2.33 报告期按基金资产的类别

3.2.34 报告期按基金资产的类别

3.2.35 报告期按基金资产的类别

3.2.36 报告期按基金资产的类别

3.2.37 报告期按基金资产的类别

3.2.38 报告期按基金资产的类别

3.2.39 报告期按基金资产的类别

3.2.40 报告期按基金资产的类别

3.2.41 报告期按基金资产的类别

3.2.42 报告期按基金资产的类别

3.2.43 报告期按基金资产的类别

3.2.44 报告期按基金资产的类别

3.2.45 报告期按基金资产的类别

3.2.46 报告期按基金资产的类别

3.2.47 报告期按基金资产的类别

3.2.48 报告期按基金资产的类别

3.2.49 报告期按基金资产的类别

3.2.50 报告期按基金资产的类别

3.2.51 报告期按基金资产的类别

3.2.52 报告期按基金资产的类别

3.2.53 报告期按基金资产的类别

3.2.54 报告期按基金资产的类别

3.2.55 报告期按基金资产的类别

3.2.56 报告期按基金资产的类别

3.2.57 报告期按基金资产的类别

3.2.58 报告期按基金资产的类别

3.2.59 报告期按基金资产的类别

3.2.60 报告期按基金资产的类别

3.2.61 报告期按基金资产的类别

3.2.62 报告期按基金资产的类别

3.2.63 报告期按基金资产的类别

3.2.64 报告期按基金资产的类别

3.2.65 报告期按基金资产的类别

3.2.66 报告期按基金资产的类别

3.2.67 报告期按基金资产的类别

3.2.68 报告期按基金资产的类别

3.2.69 报告期按基金资产的类别

3.2.70 报告期按基金资产的类别

3.2.71 报告期按基金资产的类别

3.2.72 报告期按基金资产的类别

3.2.73 报告期按基金资产的类别

3.2.74 报告期按基金资产的类别

3.2.75 报告期按基金资产的类别

3.2.76 报告期按基金资产的类别

3.2.77 报告期按基金资产的类别

3.2.78 报告期按基金资产的类别

3.2.79 报告期按基金资产的类别

3.2.80 报告期按基金资产的类别

3.2.81 报告期按基金资产的类别

3.2.82 报告期按基金资产的类别

3.2.83 报告期按基金资产的类别

3.2.84 报告期按基金资产的类别

3.2.85 报告期按基金资产的类别

3.2.86 报告期按基金资产的类别

3.2.87 报告期按基金资产的类别

3.2.88 报告期按基金资产的类别

3.2.89 报告期按基金资产的类别

3.2.90 报告期按基金资产的类别

3.2.91 报告期按基金资产的类别

3.2.92 报告期按基金资产的类别

3.2.93 报告期按基金资产的类别

3.2.94 报告期按基金资产的类别

3.2.95 报告期按基金资产的类别

3.2.96 报告期按基金资产的类别

3.2.97 报告期按基金资产的类别

3.2.98 报告期按基金资产的类别

3.2.99 报告期按基金资产的类别

3.2.100 报告期按基金资产的类别

3.2.101 报告期按基金资产的类别

3.2.102 报告期按基金资产的类别

3.2.103 报告期按基金资产的类别

3.2.104 报告期按基金资产的类别

3.2.105 报告期按基金资产的类别

3.2.106 报告期按基金资产的类别

3.2.107 报告期按基金资产的类别

3.2.108 报告期按基金资产的类别

3.2.109 报告期按基金资产的类别

3.2.110 报告期按基金资产的类别

3.2.111 报告期按基金资产的类别

3.2.112 报告期按基金资产的类别

3.2.113 报告期按基金资产的类别