

## 上投摩根货币市场基金

### 招募说明书（更新）摘要

基金合同生效日期：2005年4月13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

#### 重要提示：

1. 投资有风险，投资人申购基金时应当认真阅读招募说明书；
2. 基金的过往业绩并不预示其未来表现；
3. 基金投资者购买基金并不等于将资金作为存款存入银行或者存款类金融机构，基金管理人并不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。
4. 本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。
5. 为了更好地向投资人提供现金管理服务，投资人的相关信息将提供给为投资人提供前述服务的第三方机构。
6. 本招募说明书摘要根据中国证监会于2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定以及本基金的基金合同及托管协议的修订更新了相关章节，并更新了“基金管理人”章节中的相关内容，截止日为2020年3月31日；本招募说明书摘要所载其他内容截止日为2019年4月12日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2019年3月31日。

二零二零年四月

## 一、基金管理人

### (一)基金管理人概况

本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基本信息如下：

住所：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 楼

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

法定代表人：陈兵

总经理：王大智

成立日期：2004 年 5 月 12 日

实缴注册资本：2.5 亿元人民币

股东名称、股权结构及持股比例：

上海国际信托有限公司	51%
JPMorgan Asset Management (UK) Limited	49%

上投摩根基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[2004]56 号文批准，于 2004 年 5 月 12 日成立的合资基金管理公司。2005 年 8 月 12 日，基金管理人完成了股东之间的股权变更事项。公司注册资本保持不变，股东及出资比例分别由上海国际信托有限公司 67% 和摩根资产管理（英国）有限公司 33% 变更为目的的 51% 和 49%。

2006 年 6 月 6 日，基金管理人的名称由“上投摩根富林明基金管理有限公司”变更为“上投摩根基金管理有限公司”，该更名申请于 2006 年 4 月 29 日获得中国证监会的批准，并于 2006 年 6 月 2 日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

2009 年 3 月 31 日，基金管理人的注册资本金由一亿五千万人民币增加到二亿五千万人民币，公司股东的出资比例不变。该变更事项于 2009 年 3 月 31 日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

基金管理人无任何受处罚记录。

### (二)主要人员情况

#### 1. 董事会成员基本情况：

董事长：陈兵

博士研究生，高级经济师。

曾任上海浦东发展银行大连分行资金财务部总经理，上海浦东发展银行总行资金财务部总经理助理，上海浦东发展银行总行个人银行总部管理会计部、财富管理部总经理，上海国际信托有限公司副总经理兼董事会秘书，上海国际信托有限公司党委副书记、总经理。

现任上海国际信托有限公司党委书记、总经理；上投摩根基金管理有限公司董事长。

董事：Paul Bateman

大学本科学位。

曾任 Chase Fleming Asset Management Limited 全球总监、摩根资产管理全球投资管理业务行政总裁。

现任摩根资产管理全球主席、资产管理营运委员会成员及投资委员会成员。

董事：Daniel J. Watkins

学士学位。

曾任欧洲业务副首席执行官、摩根资产欧洲业务首席运营官、全球投资管理运营总监、欧洲运营总监、欧洲注册登记业务总监、卢森堡运营总监、欧洲注册登记业务及伦敦投资运营经理、富林明投资运营团队经理等职务。

现任摩根资产管理亚洲业务首席执行官、资产管理运营委员会成员、集团亚太管理团队成员。

董事：Richard Titherington

牛津大学政治、哲学和经济硕士学位。

曾任摩根资产管理环球新兴市场股票投资部总监。

现任摩根资产管理董事总经理、新兴市场及亚太股票组别投资总监。

董事：王大智

学士学位。

曾任摩根资产管理香港及中国基金业务总监、摩根投信董事长暨摩根资产管理集团台湾区负责人。

现任上投摩根基金管理有限公司总经理。

董事：陈海宁

研究生学历、经济师。

曾任上海浦东发展银行金融部总经理助理、公投总部贸易融资部总经理、武汉分行副行长、武汉分行党委书记、行长。

现任上海浦东发展银行总行资产负债管理部总经理。

董事：丁蔚

硕士研究生。

曾就职于中国建设银行上海分行个人银行业务部副总经理，上海浦东发展银行个人银行

总部银行卡部总经理，个人银行总部副总经理兼银行卡部总经理。

现任上海浦东发展银行总行零售业务部总经理。

董事：林仪桥

硕士研究生、会计师、经济师。

曾任浦发银行总行资金总部投资组合业务部总经理助理，浦发银行总行金融市场部总经理助理，海口分行行长助理(挂职)，浦发银行总行金融机构部总经理助理。

现任浦发银行总行金融机构部副总经理和金融市场部（深圳）副总经理。

独立董事：刘红忠

国际金融系经济学博士。

现任复旦大学经济学院教授，复旦大学金融研究中心副主任；同时兼任华泰证券股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、申银万国期货有限责任公司、东海期货有限责任公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事：汪棣

美国加州大学洛杉矶分校金融专业工商管理硕士学位，并先后获得美国加州注册会计师执照和中国注册会计师证书。

曾担任普华永道金融服务部合伙人及普华永道中国投资管理行业主管合伙人。

现担任招商证券股份有限公司、复星联合健康保险股份有限公司、亚太财产保险有限公司及 51 信用卡有限公司独立董事、中国台湾旭昶生物科技股份有限公司监事。

独立董事：曾翀

英国特许公认会计师公会资深会员。

曾任香港赛马会集团财务总监，香港证监会产品咨询委员会委员，协康会名誉司库和执行委员会和投资小组委员会成员，戴麟趾爵士康乐基金、警察子女教育信托基金和警察教育及福利信托基金投资咨询委员会主席，香港房屋协会资金管理特设委员会成员，以及另类投资管理协会（AIMA）全球投资者指导委员会成员。

现为独立顾问，宝积资本控股有限公司独立非执行董事以及安联环球投资香港有限公司兼职顾问。

## 2. 监事会成员基本情况：

监事会主席：赵峥嵘

硕士学位，高级经济师。

历任工商银行温州分行副行长、浦发银行温州分行副行长、行长及杭州分行行长等职务。

现任上海国际信托有限公司监事长、党委副书记。

监事：梁斌

学士学位。

曾在高伟绅律师事务所（香港）任职律师多年。

现任摩根大通集团中国法律总监。

监事：张军

曾任上投摩根基金管理有限公司交易部总监、基金经理、投资组合管理部总监、投资绩效评估总监、国际投资部总监、组合基金投资部总监。

现任上投摩根基金管理有限公司投资董事，管理上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金和上投摩根全球多元配置证券投资基金（QDII）。

监事：万隽宸

曾任上海国际集团有限公司高级法务经理，上投摩根基金管理有限公司首席风险官，尚腾资本管理有限公司董事。

现任尚腾资本管理有限公司总经理。

### 3. 总经理基本情况：

王大智先生，总经理

学士学位。

曾任摩根资产管理香港及中国基金业务总监、摩根投信董事长暨摩根资产管理集团台湾区负责人。

### 4. 其他高级管理人员情况：

杨红女士，副总经理

毕业于同济大学，获技术经济与管理博士

曾任招商银行上海分行稽核监督部业务副经理、营业部副经理兼工会主席、零售银行部副总经理、消费信贷中心总经理；曾任上海浦东发展银行上海分行个人信贷部总经理、个人银行发展管理部总经理、零售业务管理部总经理。

杜猛先生，副总经理

毕业于南京大学，获经济学硕士学位。

历任天同证券、中原证券、国信证券、中银国际研究员；上投摩根基金管理有限公司行业专家、基金经理助理、基金经理、总经理助理/国内权益投资一部总监兼资深基金经理。

孙芳女士，副总经理

毕业于华东师范大学，获世界经济学硕士学位。

历任华宝兴业基金研究员；上投摩根基金管理有限公司行业专家、基金经理助理、研究部副总监、基金经理、总经理助理/国内权益投资二部总监兼资深基金经理。

郭鹏先生，副总经理

毕业于上海财经大学，获企业管理硕士学位。

历任上投摩根基金管理有限公司市场经理、市场部副总监，产品及客户营销部总监、市场部总监兼互联网金融部总监、总经理助理。

刘鲁旦先生，副总经理。

博士研究生。

历任华夏基金管理有限公司固定收益总监、中国国际金融股份有限公司资产管理部固定收益总监/董事总经理。

邹树波先生，督察长。

获管理学学士学位。

曾任天健会计师事务所高级项目经理，上海证监局主任科员，上投摩根基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监。

## 5. 本基金基金经理情况

孟晨波女士，经济学学士，历任荷兰银行上海分行资金部高级交易员，星展银行上海分行资金部经理，比利时富通银行上海分行资金部联席董事，花旗银行（中国）有限公司金融市场部副总监。2009年5月加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任固定收益部总监，总经理助理/货币市场投资部总监兼资深基金经理，2009年9月起任上投摩根货币市场基金基金经理，2014年8月至2018年11月担任上投摩根现金管理货币市场基金基金经理，自2014年11月起担任上投摩根天添宝货币市场基金基金经理，2014年11月至2017年8月担任上投摩根天添盈货币市场基金基金经理。

王化鑫先生，上海财经大学金融工程学士，2007年7月起加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任客服助理、交易助理、交易员、资深交易员、固定收益首席交易员、基金经理助理，自2016年7月起担任上投摩根货币市场基金基金经理。

鞠婷女士，1997年7月至2001年5月在中国建设银行第一支行担任助理经济师，2006年3月至2014年10月在瑞穗银行总行担任总经理助理，自2014年10月起加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任我公司货币市场投资部基金经理助理、基金经理，2015年7月

至 2018 年 11 月担任上投摩根现金管理货币市场基金基金经理，自 2016 年 5 月起同时担任上投摩根天添盈货币市场基金和上投摩根天添宝货币市场基金基金经理，自 2020 年 3 月起同时担任上投摩根货币市场基金基金经理。

历任基金经理张英辉先生，任职时间为 2005 年 4 月 8 日至 2005 年 10 月 11 日；历任基金经理唐建先生，任职时间为 2005 年 10 月 12 日至 2006 年 2 月 14 日；历任基金经理李颖女士，任职时间为 2006 年 2 月 14 日至 2008 年 11 月 28 日；历任基金经理王亚南先生，任职时间为 2008 年 11 月 29 日至 2015 年 12 月 11 日。

#### 6. 基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

杜猛，副总经理兼投资总监；孙芳，副总经理兼投资副总监；刘鲁旦，副总经理兼债券投资总监；张军，投资董事、国际投资部总监、投资绩效评估总监兼高级基金经理；朱晓龙，研究部总监兼基金经理；陈圆明，绝对收益投资部总监兼基金经理；聂曙光，债券投资部总监兼资深基金经理；孟晨波，总经理助理/货币市场投资部总监兼资深基金经理；任翔，固收研究部总监兼基金经理；钟维伦，资深投资经理；刘凌云，组合基金投资部总监兼基金经理；张文峰，组合基金投资部副总监兼投资经理；孟鸣，基金经理兼资深投资组合经理；叶承焘，投资经理；陈晨，投资经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人概况

### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2018年6月末，本集团资产总额228,051.82亿元，较上年末增加6,807.99亿元，增幅3.08%。上半年，本集团盈利平稳增长，利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元，增幅5.42%；净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.65亿元，增幅6.08%。

2017 年，本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017 年中国最佳银行”，美国《环球金融》“2017 最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017 年中国最佳数字银行”、“2017 年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》“2017 最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017 全球银行 1000 强”中列第 2 位；在美国《财富》“2017 年世界 500 强排行榜”中列第 28 名。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工315余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富



的客户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2018 年二季度末，中国建设银行已托管 857 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## 三、相关服务机构

### （一）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) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

(2) 中国银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：陈四清

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

(3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

客户服务热线：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(4) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

客户服务热线：95528

网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

(5) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

客服电话：95561

网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

(6) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：李晓鹏

客服电话：95595

网址：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

(7) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

24 小时客户服务热线：95558

网址：[www.citicbank.com](http://www.citicbank.com)

(8) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

24 小时客户服务热线： 95568

网址： [www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(9) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁宁东路345号

法定代表人：陆华裕

客户服务统一咨询电话：95574

网址： [www.nbc.com.cn](http://www.nbc.com.cn)

(10) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人：谢永林

客户服务统一咨询电话：95511转3

网址： [bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

(11) 广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

客服电话：400-830-8003

网址： [www.cgbchina.com.cn](http://www.cgbchina.com.cn)

(12) 东莞农村商业银行股份有限公司

地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

法定代表人：王耀球

客服电话：961122

网址： [www.drcbank.com](http://www.drcbank.com)

(13) 上海农村商业银行股份有限公司

地址：中山东二路 70 号上海农商银行大厦

法定代表人：冀光恒

门户网站： [www.srcb.com](http://www.srcb.com)

客户服务电话：021-962999

(14) 长沙银行股份有限公司

地址：长沙市岳麓区滨江路 53 号楷林商务中心 B 座

法定代表人：朱玉国

服务热线：0731-96511

网站：www.cscb.cn

(15) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层（邮编：200031）

法定代表人：李梅

客服电话：95523

网址：www.swhysc.com

(16) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室（邮编：830002）

法定代表人：李琦

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

(17) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

客户服务电话：021-962518

网址：www.shzq.com

(18) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：杨德红

客户服务咨询电话：95521

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(19) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：<http://www.gf.com.cn>

(20) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

客户服务电话：95565

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(21) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：周健男

客服热线：95525

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(22) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

客服电话：4008888888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(23) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务咨询电话：400-8888-108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(24) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：杨华辉

客户服务热线：95562

公司网站: [www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(25) 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市广东路 689 号

法定代表人: 周杰

客服电话: 95553

公司网址: [www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(26) 国都证券股份有限公司

注册地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人: 王少华

客户服务电话: 4008188118

网址: [www.guodu.com](http://www.guodu.com)

(27) 国信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人: 何如

客户服务电话: 95536

公司网址: [www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(28) 华泰证券股份有限公司

注册地址: 江苏省南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人: 周易

客户咨询电话: 95597

网址: [www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(29) 中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 (二期) 北座

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人: 张佑君

客户服务热线: 95548

公司网址: [www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(30) 东方证券股份有限公司

注册地址: 上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

客户服务热线：95503

东方证券网站：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

(31) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

法定代表人：蔡一兵

客服电话：95317

公司网址：[www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

(32) 湘财证券有限责任公司

地址：长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

客服电话：95351

公司网址：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

(33) 中信证券（山东）有限责任公司

注册和办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法定代表人：姜晓林

客户服务电话：95548

公司网址：[sd.citics.com](http://sd.citics.com)

(34) 中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：宁敏

客服电话：4006208888或各地营业网点咨询电话

网址：[www.bocichina.com](http://www.bocichina.com)

(35) 长城证券股份有限公司

住所、办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层

法定代表人：曹宏

客户服务热线：400 6666 888

网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

(36) 德邦证券股份有限公司

办公地址：上海浦东新区福山路 500 号城建国际中心 29 楼

法定代表人：武晓春

电话：021-68761616

客服电话：4008888128

网址：[www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

(37) 中国中投证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层  
01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

客户服务热线：95532

网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

(38) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

客户服务热线:0591-96326

公司网址:[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

(39) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

公司网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

电话：021-58881690

(40) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

客服电话：95517

公司网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

(41) 上海华信证券有限责任公司



注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 环球金融中心 9 楼

法定代表人：陈灿辉

客户服务电话：400-820-5999

公司网站：www.shhxzq.com

(42) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：李新华

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

长江证券客户服务网站：www.95579.com

(43) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

办公地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

法定代表人：何之江

客服电话：95511-8

网址：<http://stock.pingan.com>

(44) 中泰证券股份有限公司

住所：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

电话：95538

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

(45) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

公司网站：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(46) 上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

公司网站： [www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(47) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 11 号邮电新闻大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

客服电话：400-818-8000

公司网站： [www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(48) 上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

客户服务电话：400-817-5666

(49) 上海万得基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

客户服务电话：400-799-1888

网址： [www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(50) 嘉实财富管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

网站： [www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

(51) 星展银行（中国）有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号 1301、1801 单元

法定代表人：葛甘牛

咨询电话：400-820-8988

网站： [www.dbs.com.cn](http://www.dbs.com.cn)

(52) 花旗银行（中国）有限公司

注册地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦主楼 28 楼 01A 单元、02A 单元和 04 单元，29 楼 02 单元，30 楼 01 单元，32 楼 01 单元和 01B 单元，33 楼 01 单元和 03 单元，34 楼 01 单元及 35 楼

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦主楼 28 楼 01A 单元、02A 单元和 04 单元，29 楼 02 单元，30 楼 01 单元，32 楼 01 单元和 01B 单元，33 楼 01 单元和 03 单元，34 楼 01 单元及 35 楼

法定代表人：欧兆伦（AU SIU LUEN）

客户服务热线：个人客户服务中心电话：800 8301 880

公司网站：[www.citibank.com.cn](http://www.citibank.com.cn)

(53) 东亚银行（中国）有限公司

办公地址：上海浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 29 楼

法定代表人：李国宝

客服电话：95382

网站：[www.hkbea.com.cn](http://www.hkbea.com.cn)

(54) 渣打银行（中国）有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 201 号渣打银行大厦 13 层 1 室，16 层（实际楼层 15 层）、17 层（实际楼层 16 层）、18 层 4 室（实际楼层 17 层 4 室）、19 层（实际楼层 18 层）、20 层 1 室（实际楼层 19 层 1 室）、21 层 1、3、4 室（实际楼层 20 层 1、3、4 室）、23 层（实际楼层 22 层）、25 层 2、4 室（实际楼层 23 层 2、4 室）、27 层 2 室（实际楼层 25 层 2 室）、28 层（实际楼层 26 层）

法定代表人：张晓蕾

客服电话：4008888083

网站：<http://www.sc.com.cn>

(55) 摩根大通银行（中国）有限公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号北京英蓝国际金融中心 19 层

法定代表人：李一

客户服务电话：021-52002353

公司网址：<http://www.jpmorganchina.com.cn>

(56) 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

(57) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、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 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

公司网站：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(58) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6 楼

法定代表人：祖国明

客服电话：400-0766-123

公司网站：www.fund123.cn

(59) 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一号元茂大厦 903

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：凌顺平

客服电话：4008-773-772

公司网站：www.5ifund.com

(60) 上海陆金所基金销售有限公司

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：胡学勤

客服电话：400-821-9031

网站：www.lufunds.com

(61) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：郑毓栋

客服电话：400-618-0707

网站：[www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

(62) 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](http://www.yingmi.cn)

(63) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

客服电话：010-62675369

网站：[www.xincai.com](http://www.xincai.com)

(64) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部

法定代表人：江卉

客服电话：4000988511/4000888816

网址：<http://fund.jd.com/>

(65) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

客服电话：4008-909-998

网址：[www.jnlc.com](http://www.jnlc.com)

(66) 奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

客服电话：400-684-0500

网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

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，并在基金管理人网站公示。

(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：方达律师事务所

注册地址：上海市南京西路1515号2202-2207室

办公地址：上海市南京西路1515号2202-2207室

负责人：黄伟民

联系电话：021-5298 5566

传真：021-5298 5577

联系人：黄伟民

经办律师：黄伟民、徐雪松

(四) 审计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(特殊普通合伙)

注册地址：中国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：中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：薛竞、沈兆杰

#### 四、基金概况

基金名称：上投摩根货币市场基金

基金类别：货币市场基金

运作方式：契约型开放式

#### 五、基金的投资

##### (一)投资目标

通过合理的资产选择，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，进一步优化现金管理，并力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。

##### (二)投资理念

本基金采取主动式投资管理策略，积极追求类属资产与个券品种的合理选择与配置。在严格控制风险的前提下，实现投资组合的高变现力与稳健收益，满足投资者对高流动性、低风险金融资产的需求。

##### (三)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：（1）现金；（2）期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；（3）剩余期限在397天以内（含397天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；（4）中国证监会、中国人民银行认可的其他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他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

##### (四)投资策略

本基金投资管理将充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法，对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略首先审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，在风险与收益的配比中，力求将各类风险降到最低，并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。

利率预期策略：市场利率因应景气循环、季节因素或货币政策变动而产生波动，本基金将首先根据对国内外经济形势的预测，分析市场投资环境的变化趋势，重点关注利率趋势变化；其次，在判断利率变动趋势时，我们将重点考虑货币供给的预期效应(Money-supply Expectations Effect)、通货膨胀与费雪效应(Fisher Effect)以及资金流量变化(Flow of Funds)等，

全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、债券市场政策趋势、物价水平变化趋势等因素，对利率走势形成合理预期，从而做出各类资产配置决策。

**估值策略：**建立不同品种的收益率曲线预测模型，并通过这些模型进行估值，确定价格中枢的变动趋势。根据收益率、流动性、风险匹配原则以及债券的估值原则构建投资组合，合理选择不同市场中有投资价值的券种，并根据投资环境的变化相机调整。

**久期管理：**久期作为衡量债券利率风险的指标，反映了债券价格对收益率变动的敏感度。本基金努力把握久期与债券价格波动之间的量化关系，根据未来利率变化预期，以久期和收益率变化评估为核心。通过久期管理，合理配置投资品种。在预期利率下降时适度加大久期，在预期利率上升时适度缩小久期。

**流动性管理：**由于货币市场基金要保持高流动性的特性，本基金会紧密关注申购/赎回现金流情况、季节性资金流动、日历效应等，建立组合流动性预警指标，实现对基金资产的结构化管理，并结合持续性投资的方法，将回购/债券到期日进行均衡等量配置，以确保基金资产的整体变现能力。

随着国内货币市场的进一步发展，以及今后相关法律法规允许本基金可投资的金融工具出现时，本基金将予以深入分析并加以审慎评估，在符合本基金投资目标的前提下适时调整本基金投资对象。

#### （五）投资决策程序

投资决策基本原则是依据基金合同所制定投资基本方针、投资范围及投资限制等，拟订基金投资策略及执行投资计划。严格控制风险及资产安全，并追求投资利得的合理增长，最大限度地保障基金持有人的利益。

##### 1. 投资决策机制

公司投资决策采用集体决策模式，并以投资决策会议的形式加以体现。

- 1) 为提高投资决策效率和专业性水平，公司在经营管理层下设投资决策委员会，作为公司投资管理的核心决策机构。
- 2) 投资决策委员会以投资管理部核心成员为主体组建，并由投资总监担任主席，其它成员包括部分资深基金经理和研究总监。投资决策委员会成员之间相互无亲属关系。
- 3) 投资决策委员会的主要职责是：定期或不定期召开投资决策会议，在依照有关法律法规与基金合同所确定的投资限制纲领的范围内，分析评价投资操作绩效，并在对现有资产配置进行总结的基础上，作出资产配置决议，确定证券评级模式，决定投资对象备选库，作为基金经理进行投资操作的依据。



- 4) 投资决策委员会对所议内容在成员间达成共识后形成决议，无法达成共识时，由投资决策委员会主席做最后裁定。
- 5) 投资决策委员会应就每次会议决议情况制作书面报告，向总经理提交，并为监察稽核提供查核依据。

## 2. 投资决策程序

- 1) 基金经理对宏观经济和市场状况进行研究，综合分析物价水平变化趋势、货币政策影响、市场环境的变化，重点关注贷款增长和货币供应增长趋势、利率政策动向，制定中短期的宏观经济展望和利率变化趋势。
- 2) 对预期市场收益率的变化趋势，调整资产配置比例和组合久期，达到提高基金回报表现。
- 3) 建立收益率曲线来进行估值，确定债券价格的变动趋势，以收益率和流动性作为个券选择基础。
- 4) 在组合构建的过程，严格监控、分析和控制风险，并持续进行。
- 5) 持续进行投资组合的敏感性分析，对组合的收益和流动性进行评估。

### (六) 业绩比较基准

业绩比较基准：同期七天通知存款利率（税后）。

### (七) 风险收益特征

本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险品种，其预期风险和预期收益率都低于股票基金、债券基金和混合基金。

本基金风险收益特征会定期评估并在公司网站发布，请投资者关注。

### (八) 基金的投资组合报告

#### 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(%)
1	固定收益投资	26,032,767,859.53	35.27
	其中：债券	26,032,767,859.53	35.27
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	22,518,975,000.00	30.51
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	24,906,890,588.59	33.74
4	其他资产	360,158,603.03	0.49
5	合计	73,818,792,051.15	100.00

## 2、 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	-	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

## 3、 基金投资组合平均剩余期限

### 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	43
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	47
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

在本报告期内本基金未出现投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

## 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	56.26	2.43
	其中：剩余存续期超过397天的浮 动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	18.84	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮 动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	16.27	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮 动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	4.74	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮 动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	5.90	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮 动利率债	-	-
合计		102.02	2.43

## 4、报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

在本报告期内本基金未出现投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

## 5、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(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,232,301,934.54	11.43

	其中：政策性金融债	8,232,301,934.54	11.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	6,040,519,344.07	8.39
6	中期票据	-	-
7	同业存单	11,759,946,580.92	16.33
8	其他	-	-
9	合计	26,032,767,859.53	36.15
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 6、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	111904002	19 中国银行 CD002	15,000,000.00	1,492,739,168.26	2.07
2	111806114	18 交通银行 CD114	12,900,000.00	1,288,601,000.69	1.79
3	111906042	19 交通银行 CD042	12,000,000.00	1,196,118,142.66	1.66
4	180207	18 国开 07	10,200,000.00	1,020,081,859.17	1.42
5	111906048	19 交通银行 CD048	10,000,000.00	996,506,426.95	1.38
6	111906058	19 交通银行 CD058	10,000,000.00	996,057,206.95	1.38
7	160415	16 农发 15	8,900,000.00	889,822,291.10	1.24
8	140439	14 农发 39	7,000,000.00	703,817,165.50	0.98
9	180305	18 进出 05	7,000,000.00	700,071,015.30	0.97
10	011900094	19 中石油 SCP002	6,000,000.00	600,197,316.09	0.83

#### 7、“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(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0495%
报告期内偏离度的最低值	0.0214%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0384%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期末发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期末发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

#### 8、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。

#### 9、投资组合报告附注

##### 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。

2) 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。

##### 3) 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	359,813,944.17
4	应收申购款	344,658.86
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	360,158,603.03

#### 4) 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项之和与合计可能存在尾差。

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，可联系本基金管理人，在履行相关程序后获取。

## 六、基金的业绩

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		基金净值 收益率①	基金净值 增长率标 准差②	比较基准 收益率③	比较基准收 益率标准差 ④	①—③	②—④
2005/4/13 至 2005/12/31	A	0.6628%	0.0251%	1.1932%	0.0000%	-0.5304%	0.0251%
	B	0.8377%	0.0307%	1.1932%	0.0000%	-0.3555%	0.0307%
2006/1/1 至 2006/12/31	A	1.4773%	0.0274%	1.7093%	0.0002%	-0.2320%	0.0272%
	B	1.7199%	0.0313%	1.7093%	0.0002%	0.0106%	0.0311%
2007/1/1 至 2007/12/31	A	3.3267%	0.1387%	2.4441%	0.0017%	0.8826%	0.1370%
	B	3.5741%	0.1410%	2.4441%	0.0017%	1.1300%	0.1393%
2008/1/1 至 2008/12/31	A	2.6698%	0.0568%	2.4264%	0.0027%	0.2434%	0.0541%
	B	2.9159%	0.0608%	2.4264%	0.0027%	0.4895%	0.0581%
2009/1/1 至 2009/12/31	A	0.7748%	0.0302%	1.3500%	0.0000%	-0.5752%	0.0302%
	B	1.0174%	0.0321%	1.3500%	0.0000%	-0.3326%	0.0321%
2010/1/1 至 2010/12/31	A	1.2029%	0.0326%	1.3500%	0.0000%	-0.1471%	0.0326%
	B	1.4463%	0.0360%	1.3500%	0.0000%	0.0963%	0.0360%
2011/1/1 至 2011/12/31	A	2.5841%	0.0618%	1.4597%	0.0001%	1.1244%	0.0617%
	B	2.8303%	0.0657%	1.4597%	0.0001%	1.3706%	0.0656%
2012/1/1 至 2012/12/31	A	2.7042%	0.0011%	1.4178%	0.0002%	1.2864%	0.0009%
	B	2.9506%	0.0011%	1.4178%	0.0002%	1.5328%	0.0009%
2013/1/1 至 2013/12/31	A	3.2795%	0.0020%	1.3500%	0.0000%	1.9295%	0.0020%
	B	3.5266%	0.0020%	1.3500%	0.0000%	2.1766%	0.0020%
2014/1/1 至	A	3.8365%	0.0019%	1.3500%	0.0000%	2.4865%	0.0019%

2014/12/31	B	4.0853%	0.0019%	1.3500%	0.0000%	2.7353%	0.0019%
2015/1/1 至 2015/12/31	A	2.6756%	0.0023%	1.3500%	0.0000%	1.3256%	0.0023%
	B	2.9221%	0.0023%	1.3500%	0.0000%	1.5721%	0.0023%
2016/1/1 至 2016/12/31	A	2.0543%	0.0012%	1.3500%	0.0000%	0.7043%	0.0012%
	B	2.2993%	0.0012%	1.3500%	0.0000%	0.9493%	0.0012%
2017/1/1 至 2017/12/31	A	3.3685%	0.0016%	1.3500%	0.0000%	2.0185%	0.0016%
	B	3.6165%	0.0016%	1.3500%	0.0000%	2.2665%	0.0016%
2018/1/1 至 2018/6/30	A	1.7676%	0.0012%	0.6695%	0.0000%	1.0981%	0.0012%
	B	1.8885%	0.0012%	0.6695%	0.0000%	1.2190%	0.0012%
2018/1/1 至 2018/12/31	A	3.0643%	0.0018%	1.3500%	0.0000%	1.7143%	0.0018%
	B	3.3113%	0.0018%	1.3500%	0.0000%	1.9613%	0.0018%
2019/1/1 至 2019/3/31	A	0.5487%	0.0008%	0.3329%	0.0000%	0.2158%	0.0008%
	B	0.6085%	0.0008%	0.3329%	0.0000%	0.2756%	0.0008%

## 七、费用概览

### (一) 与基金运作有关的费用

#### 1、 基金费用的种类：

- 1) 基金管理人的管理费；
- 2) 基金托管人的托管费；
- 3) 基金的销售服务费；
- 4) 基金合同生效后的信息披露费，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 5) 基金份额持有人大会费用；
- 6) 与基金相关的会计师费和律师费；
- 7) 基金证券交易费用；
- 8) 按照国家有关规定和基金合同规定可以列入的其它费用。

#### 2、基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式：

##### 1) 基金管理人的基金管理费：

在通常情况下，基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提。基金管理人的管理费计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

## 2) 基金托管人的基金托管费：

在通常情况下，基金的托管费按前 1 日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前 1 日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

## 3) 基金销售服务费

基金销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年基金销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的某类基金份额的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额所代表的基金资产净值

A. 对于 A 类基金份额持有人，年基金销售服务费率应为 0.25%。对于由 B 类降级为 A 类的持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率。

B. 对于 B 类基金份额持有人，年基金销售服务费率为 0.01%。对于由 A 类升级为 B 类的持有人，年基金销售服务费率应自其达到 B 类条件的开放日后的下一个工作日起享受 B 类基金份额持有人的费率。

基金销售服务费每日计算，每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付，由基金管理人代收，基金管理人收到后支付给基金销售机构，专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

4) 若本基金发售失败，发售费用由基金管理人承担。基金合同生效后的各项费用按有关法规列支。

本条第 1 款第 4 至第 7 项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。



### 3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

### 4、基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

1) 基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金的基金管理费、基金托管费和销售服务费，无须召开基金份额持有人大会。

2) 本基金可在中国证监会允许的条件下按国家的有关规定增加其他种类的基金费用。

如本基金仅对新发售的基金份额适用新的基金费用种类，不涉及现有基金份额持有人利益的，无须召开基金份额持有人大会。

### 5、税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### (二) 与基金销售有关的费用

#### 1、申购费与赎回费

本基金的每基金份额申购价格和每基金份额赎回价格均为人民币 1.00 元。

本基金在通常情况下的申购和赎回费率为 0%。

但在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5% 且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，本基金对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额 1% 以上的赎回申请征收 1% 的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。

#### (1)、申购份额的计算公式：

本基金申购份额的计算方法如下：

申购份额=申购金额 / 每基金份额申购价格

有效申购份额单位为 0.01 份，计算结果保留到小数点后 2 位，第 3 位四舍五入。由此误差产生的损失由基金资产承担，产生的收益归基金资产所有。

#### (2)、赎回金额的计算公式：

本基金赎回金额的计算方法如下：

在投资人部分赎回份额的情况下：

赎回金额=赎回份额×每基金份额赎回价格；

在投资人全部赎回份额的情况下：

赎回金额=赎回份额×每基金份额赎回价格+累积收益

赎回金额单位为元，计算结果保留到小数点后两位，第三位四舍五入。由此误差产生的损失由基金资产承担，产生的收益归基金资产所有。

## 2、基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关业务规则、具体费率及计算公式由基金管理人根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 八、招募说明书更新部分说明

上投摩根货币市场基金于 2005 年 4 月 13 日成立。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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集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实施的投资经营活动，对 2020 年 3 月 25 日公告的《上投摩根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、 本基金招募说明书根据中国证监会于 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定以及本基金的基金合同及托管协议的修订更新了相关章节；
- 2、 在重要提示中，对招募说明书所载内容的截止日进行了更新；
- 3、 在“三、基金管理人”中，对基金管理人的相关信息进行了更新。

上投摩根基金管理有限公司

2020 年 4 月