

上投摩根货币市场基金 2010年半年度报告摘要

2010年6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
送出日期:二〇一〇年八月二十七日

1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中,对报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事同意,并由董事长签发。
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2010年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、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及基金合同。
本半年度报告所载数据源自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告中所列财务资料未经审计。
本报告自2010年1月1日起自6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根货币
基金代码	370101
交易代码	370101
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	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
基金募集机构名称	4,601,894,138.61份
基金合同存续期	不定期
下属分报基金的名称	上投摩根货币 A 上投摩根货币 B
下属分报基金的交易币种	370100 370101
报告期末下属分报基金的份额总额	181,038,221.40份 4,420,855,917.21份

2.2 基金产品说明

通过合理的资产选择,在有效控制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,进一步优化资金管理,并力求获得高于业绩比较基准的超额收益。

投资目标
本基金投资于中国证监会规定范围内具有高流动性的资产,通过分散投资,力争实现基金资产的保值增值,并力求获得高于业绩比较基准的超额收益。

投资策略
本基金采取自上而下的投资策略,在有效控制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,进一步优化资金管理,并力求获得高于业绩比较基准的超额收益。

2.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上投摩根基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
姓名	魏喆	李莉
联系电话	021-38784099	010-67595903
信息披露负责人	魏喆	魏喆
电子邮箱	publicaffairs@sitom.com	ynsl@ccb.com
客户服务电话	400-889-4888	010-67595996
传真	021-68881170	010-66275853

基金半年度报告备查地点:基金管理人、基金托管人的办公场所。

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		说明
		任职日期	离任日期	
王亚明	本基金基金经理	2008-11-29	-	复旦大学金融学工程专业硕士,2003年2007年,获新加坡南洋理工大学工商管理硕士学位;任固定收益研究员,2007年11月加入上投摩根基金管理有限公司,任固定收益基金经理助理。2008年6月加入上投摩根基金管理有限公司,自2009年6月起任上投摩根货币证券投资基金基金经理。
孟晓波	本基金基金经理	2009-9-17	-	经济学硕士,历任招商银行上海分行金融市场部副经理,兼理财中心副经理,2009年5月加入上投摩根基金管理有限公司,担任固定收益部副经理。

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

报告期间	报告日期 2010年1月1日至2010年6月30日	基金单位:人民币元
3.1.1 期间数据和指标	上投摩根货币A	上投摩根货币B
本期净实现收益	983,282.75	28,109,842.24
本期利润	983,282.75	28,109,842.24
本期基金份额净值增长率	0.4853%	0.6051%

3.1.2 期间数据和指标 (报告期末 2010年6月30日)

报告期末	上投摩根货币A	上投摩根货币B
期末基金资产净值	181,038,221.40	4,420,855,917.21
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率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	①-③	②-④
过去一个月	0.1159%	0.0460%	0.1110%	0.0000%	0.0049%	0.0460%
过去三个月	0.2779%	0.0367%	0.3366%	0.0000%	-0.0587%	0.0367%
过去六个月	0.4853%	0.0269%	0.6059%	0.0000%	-0.1242%	0.0269%
过去一年	0.8426%	0.0207%	1.3500%	0.0000%	-0.5074%	0.0207%
过去二年	6.2425%	0.1222%	5.9389%	0.0024%	0.3036%	0.1198%
自基金合同生效起至今	9.7354%	0.1008%	9.7924%	0.0019%	-0.0570%	0.0999%

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根货币A

阶段	份额净值收益率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	①-③	②-④
过去一个月	0.1348%	0.0544%	0.1110%	0.0000%	0.0238%	0.0544%
过去三个月	0.3739%	0.0436%	0.3366%	0.0000%	0.0033%	0.0436%
过去六个月	0.6051%	0.0321%	0.6059%	0.0000%	-0.0044%	0.0321%
过去一年	1.0855%	0.0239%	1.3500%	0.0000%	-0.2645%	0.0239%
过去二年	7.0100%	0.1228%	5.9389%	0.0024%	1.0711%	0.1204%
自基金合同生效起至今	11.1162%	0.1015%	9.7924%	0.0019%	1.3238%	0.0996%

3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根货币B

阶段	份额净值收益率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	①-③	②-④
过去一个月	0.1348%	0.0544%	0.1110%	0.0000%	0.0238%	0.0544%
过去三个月	0.3739%	0.0436%	0.3366%	0.0000%	0.0033%	0.0436%
过去六个月	0.6051%	0.0321%	0.6059%	0.0000%	-0.0044%	0.0321%
过去一年	1.0855%	0.0239%	1.3500%	0.0000%	-0.2645%	0.0239%
过去二年	7.0100%	0.1228%	5.9389%	0.0024%	1.0711%	0.1204%
自基金合同生效起至今	11.1162%	0.1015%	9.7924%	0.0019%	1.3238%	0.0996%

3.2.4 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根货币A

资产	2010年6月30日	2009年12月31日
货币资金	84,975,335.93	243,283,716.51
结算备付金	86,049,999.94	46,129,523.81
交易性金融资产	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
其中:股票投资	-	-
其中:债券投资	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,857,600,000.00	3,001,600,000.00
应收利息	35,948.89	-
应收股利	14,248,232.72	20,408,230.19
其他资产	-	-
资产总计	4,636,921,145.55	5,031,250,536.26

3.2.5 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根货币B

资产	2010年6月30日	2009年12月31日
货币资金	84,975,335.93	243,283,716.51
结算备付金	86,049,999.94	46,129,523.81
交易性金融资产	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
其中:股票投资	-	-
其中:债券投资	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,857,600,000.00	3,001,600,000.00
应收利息	35,948.89	-
应收股利	14,248,232.72	20,408,230.19
其他资产	-	-
资产总计	4,636,921,145.55	5,031,250,536.26

3.2.6 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根货币B

资产	2010年6月30日	2009年12月31日
货币资金	84,975,335.93	243,283,716.51
结算备付金	86,049,999.94	46,129,523.81
交易性金融资产	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
其中:股票投资	-	-
其中:债券投资	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,857,600,000.00	3,001,600,000.00
应收利息	35,948.89	-
应收股利	14,248,232.72	20,408,230.19
其他资产	-	-
资产总计	4,636,921,145.55	5,031,250,536.26

3.2.7 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根货币B

资产	2010年6月30日	2009年12月31日
货币资金	84,975,335.93	243,283,716.51
结算备付金	86,049,999.94	46,129,523.81
交易性金融资产	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
其中:股票投资	-	-
其中:债券投资	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,857,600,000.00	3,001,600,000.00
应收利息	35,948.89	-
应收股利	14,248,232.72	20,408,230.19
其他资产	-	-
资产总计	4,636,921,145.55	5,031,250,536.26

3.2.8 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根货币B

资产	2010年6月30日	2009年12月31日
货币资金	84,975,335.93	243,283,716.51
结算备付金	86,049,999.94	46,129,523.81
交易性金融资产	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
其中:股票投资	-	-
其中:债券投资	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,857,600,000.00	3,001,600,000.00
应收利息	35,948.89	-
应收股利	14,248,232.72	20,408,230.19
其他资产	-	-
资产总计	4,636,921,145.55	5,031,250,536.26

3.2.9 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根货币B

资产	2010年6月30日	2009年12月31日
货币资金	84,975,335.93	243,283,716.51
结算备付金	86,049,999.94	46,129,523.81
交易性金融资产	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
其中:股票投资	-	-
其中:债券投资	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,857,600,000.00	3,001,600,000.00
应收利息	35,948.89	-
应收股利	14,248,232.72	20,408,230.19
其他资产	-	-
资产总计	4,636,921,145.55	5,031,250,536.26

3.2.10 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根货币B

资产	2010年6月30日	2009年12月31日
货币资金	84,975,335.93	243,283,716.51
结算备付金	86,049,999.94	46,129,523.81
交易性金融资产	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
其中:股票投资	-	-
其中:债券投资	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,857,600,000.00	3,001,600,000.00
应收利息	35,948.89	-
应收股利	14,248,232.72	20,408,230.19
其他资产	-	-
资产总计	4,636,921,145.55	5,031,250,536.26

3.2.11 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根货币B

资产	2010年6月30日	2009年12月31日
货币资金	84,975,335.93	243,283,716.51
结算备付金	86,049,999.94	46,129,523.81
交易性金融资产	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
其中:股票投资	-	-
其中:债券投资	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,857,600,000.00	3,001,600,000.00
应收利息	35,948.89	-
应收股利	14,248,232.72	20,408,230.19
其他资产	-	-
资产总计	4,636,921,145.55	5,031,250,536.26

3.2.12 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根货币B

资产	2010年6月30日	2009年12月31日
货币资金	84,975,335.93	243,283,716.51
结算备付金	86,049,999.94	46,129,523.81
交易性金融资产	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
其中:股票投资	-	-
其中:债券投资	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,857,600,000.00	3,001,600,000.00
应收利息	35,948.89	-
应收股利	14,248,232.72	20,408,230.19
其他资产	-	-
资产总计	4,636,921,145.55	5,031,250,536.26

3.2.13 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根货币B

资产	2010年6月30日	2009年12月31日
货币资金	84,975,335.93	243,283,716.51
结算备付金	86,049,999.94	46,129,523.81
交易性金融资产	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
其中:股票投资	-	-
其中:债券投资	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,857,600,000.00	3,001,600,000.00
应收利息	35,948.89	-
应收股利	14,248,232.72	20,408,230.19
其他资产	-	-
资产总计	4,636,921,145.55	5,031,250,536.26

3.2.14 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根货币B

资产	2010年6月30日	2009年12月31日
货币资金	84,975,335.93	243,283,716.51
结算备付金	86,049,999.94	46,129,523.81
交易性金融资产	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
其中:股票投资	-	-
其中:债券投资	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,857,600,000.00	3,001,600,000.00
应收利息	35,948.89	-
应收股利	14,248,232.72	20,408,230.19
其他资产	-	-
资产总计	4,636,921,145.55	5,031,250,536.26

3.2.15 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根货币B

资产	2010年6月30日	2009年12月31日
货币资金	84,975,335.93	243,283,716.51
结算备付金	86,049,999.94	46,129,523.81
交易性金融资产	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
其中:股票投资	-	-
其中:债券投资	2,593,258,984.06	1,719,829,065.75
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,857,600,000.00	3,001,600,000.00
应收利息	3	