

上投摩根货币市场基金

2011 第一季度报告

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:二〇一一年四月二十日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告期内不存在虚假记载、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预示其未来表现,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。

本报告期自2011年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况
基金简称:上投摩根货币
基金代码:370010

投资目标
本基金投资于货币市场,在有效控制投资组合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稳定回报。

投资策略
本基金投资管理将充分运用收益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,投资流程首先考虑各类资产的收益性、流动性及风险特征,在风险收益匹配的前提下,力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。

风险收益特征
本基金属于证券投资基金中低风险、低风险品种,其预期风险和预期收益水平都低于股票基金、债券基金和混合基金。

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

主要财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年1月1日至2011年3月31日)

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年1月1日至2011年3月31日)

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

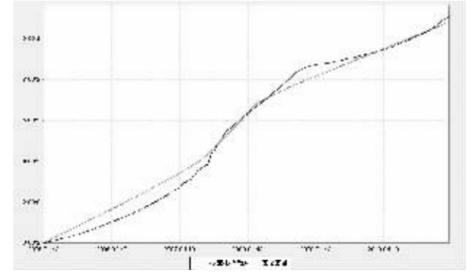
Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1. 上投摩根货币 A



注:按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效日起不超过三个月内完成建仓,截止2005年07月13日,本基金已根据基金合同约定完成建仓且资产配置比例符合本基金合同约定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金无异常交易行为。

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
2011年一季度,全球经济继续缓慢复苏,然而欧债担忧重现,利比亚、中东紧张局势导致石油价格持续高位,国际能源和大宗商品价格上涨引发结构性通胀的风险增加,我国面临的通胀压力仍然较大,货币信贷调控形势依然严峻,货币政策维持稳健偏紧,2月份CPI同比上涨7.2%,创2008年10月份以来新高,一、二月份CPI同比增长保持在4.9%的高位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2011年3月31日,本基金B类和A类的七日年化收益率分别为2.160%和1.921%。本季度基金B类和A类的净值收益率分别为0.5783%和0.5189%。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%)

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:二〇一一年四月二十日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告期内不存在虚假记载、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预示其未来表现,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。

本报告期自2011年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况
基金简称:上投摩根中国优势
基金代码:370010

投资目标
本基金投资于具有良好成长性的中国企业,通过精选证券和积极主动投资,为国内投资者提供国际水平的理财服务,谋求基金资产的长期稳定增值。

投资策略
本基金充分借鉴摩根资产管理全球行之有效的投资理念和方法,以国际视野审视中国宏观经济,将国内行业发展趋势与上市公司的价值判断纳入全球经济综合考量范围,通过定性定量分析有机结合,准确把握国家地区与上市公司投资价值,最终实现上市公司内在价值的合理评估,投资组合资产配置与风险管理的有效实施。本基金以跟踪投资为主体,追求超额收益的资产配置,在风险可控的前提下,通过精选个股和积极主动投资,为国内投资者提供国际水平的理财服务,谋求基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准
本基金股票投资部分的业绩比较基准是富时中国A600指数,债券投资部分的业绩比较基准是上证国债指数,基金整体业绩比较基准为70%富时中国A600指数收益率+25%上证国债指数收益率+5%现金类资产收益率。

风险收益特征
本基金为追求资产配置动态平衡,在风险预算前提下追求收益最大化,属于中等风险证券投资基金产品。

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

主要财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年1月1日至2011年3月31日)

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

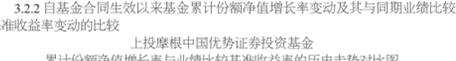
Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年1月1日至2011年3月31日)

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1. 上投摩根中国优势证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
0004年9月15日至2011年3月31日

上投摩根中国优势证券投资基金

2011 第一季度报告

披露内容的依据。
报告期内,根据公司内部和外部专业机构的评价结果,本基金管理人旗下无与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金无异常交易行为。

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
2011年一季度,全球经济预期上行与紧缩措施并存,国内通胀预期将继续加强,央行采取了加息与调整存款准备金率等多种紧缩手段来应对市场流动性,股票市场在震荡中不断走高,金融、地产、钢铁、石化等受到市场一定程度的追捧,这些板块股票不断上扬,并带动指数有所抬升,而消费、创业板等股票则有所下跌,市场结构分化明显。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2011年3月31日,上投摩根中国优势证券投资基金份额净值为2.4267元,累计基金份额净值为5.4967元。本报告期份额净值增长率为6.45%,同期业绩比较基准收益率为1.64%。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金