

# 上投摩根货币市场基金招募说明书(更新)摘要

**重要提示:**  
1. 投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读招募说明书;  
2. 基金合同是约定基金当事人之间权利义务的法律文件,基金投资人自基金合同成立之日起即成为基金份额持有人,基金合同当事人包括基金管理人、基金托管人、基金销售人、基金投资人等。  
3. 基金投资人购买基金并等于基金货币市场基金作为存款存入银行或者存款类金融机构,基金管理人不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

4. 基金招募说明书是基金合同的必要组成部分,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,基金投资人自基金合同成立之日起即成为基金份额持有人,基金合同当事人包括基金管理人、基金托管人、基金销售人、基金投资人等。

5. 本招募说明书所载内容截止日为 2013 年 10 月 12 日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为 2013 年 9 月 30 日。

二零一三年十一月

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

基金合同生效日期:2005年4月13日

报告期天数

51

报告期剩余天数

68

报告期剩余期限

39

债券正回购的金额余额超过基金资产净值的 20%的说明

在本基金期内货币市场基金正回购的金额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. 货币投资组合平均剩余期限情况

项目 天数

报告期天数货币组合平均剩余期限 51

报告期剩余天数货币组合平均剩余期限最高值 68

报告期剩余天数货币组合平均剩余期限最低值 39

报告期剩余天数货币组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

根据基金合同约定,本基金投资组合的平均剩余期限不超过 120 天。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. 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(%)

1 30 天以内 66.50 0.39

其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 - -

2 31 天(含)-60 天 9.65 - -

其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 - -

3 60 天(含)-90 天 10.74 - -

其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 - -

4 90 天(含)-180 天 2.94 - -

其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 - -

5 180 天(含)-397 天 10.27 - -

其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 - -

合计 100.09 0.39

4. 报告期末债券投资组合

1. 债券品种分类的债券投资组合

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 行业票据 - -

3 金融债券 5,342,225,373.14 14.94

其中:政策性金融债 5,342,225,373.14 14.94

4 企业债券 - -

5 短期融资券 1,169,707,442.79 3.27

6 中期票据 - -

7 其他 - -

8 合计 6,511,932,815.93 18.21

2. 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 041356003 13国债 CP001 7,100,000 709,943,286.60 1.99

2 120245 12国债 45 6,300,000 629,942,814.24 1.76

3 130236 13国开 36 6,000,000 598,727,156.18 1.67

4 120318 12国开 18 5,200,000 520,003,868.62 1.45

5 04152014 13国债 CP001 4,600,000 459,764,156.19 1.29

6 130308 13国开 08 4,500,000 449,790,176.33 1.26

7 120409 12国债 09 4,400,000 436,788,609.31 1.22

8 130218 13国开 18 4,200,000 419,769,781.96 1.17

9 110206 11国债 06 4,000,000 400,135,373.66 1.12

10 130227 13国债 27 4,000,000 398,777,525.25 1.12

5. 前期定期报告中披露的基金资产净值的幅度

项目 前期定期报告中披露的基金资产净值的幅度

报告期前期内部度的绝对值在 0.25% 1.0% 间的次数 0/6

报告期前内外部度的绝对值 -0.0347%

报告期前内外部度的最低值 -0.1717%

报告期前内个工单外部度的绝对值的简单平均值 0.0608%

6. 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

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 041356003 13国债 CP001 7,100,000 709,943,286.60 1.99

2 120245 12国债 45 6,300,000 629,942,814.24 1.76

3 130236 13国开 36 6,000,000 598,727,156.18 1.67

4 120318 12国开 18 5,200,000 520,003,868.62 1.45

5 04152014 13国债 CP001 4,600,000 459,764,156.19 1.29

6 130308 13国开 08 4,500,000 449,790,176.33 1.26

7 120409 12国债 09 4,400,000 436,788,609.31 1.22

8 130218 13国开 18 4,200,000 419,769,781.96 1.17

9 110206 11国债 06 4,000,000 400,135,373.66 1.12

10 130227 13国债 27 4,000,000 398,777,525.25 1.12

7. 投资组合报告中未有货币资产的说明

8. 投资组合报告中未有资产支持证券的说明

9. 投资组合报告中未有股票的说明

10. 投资组合报告中未有债券的说明

11. 投资组合报告中未有基金的说明

12. 投资组合报告中未有权证及金融衍生品的说明

13. 投资组合报告中未有资产支持证券的说明

14. 投资组合报告中未有股票的说明

15. 投资组合报告中未有债券的说明

16. 投资组合报告中未有基金的说明

17. 投资组合报告中未有权证及金融衍生品的说明

18. 投资组合报告中未有资产支持证券的说明

19. 投资组合报告中未有股票的说明

20. 投资组合报告中未有债券的说明

21. 投资组合报告中未有基金的说明

22. 投资组合报告中未有权证及金融衍生品的说明

23. 投资组合报告中未有资产支持证券的说明

24. 投资组合报告中未有股票的说明

25. 投资组合报告中未有债券的说明

26. 投资组合报告中未有基金的说明

27. 投资组合报告中未有权证及金融衍生品的说明

28. 投资组合报告中未有资产支持证券的说明

29. 投资组合报告中未有股票的说明

30. 投资组合报告中未有债券的说明

31. 投资组合报告中未有基金的说明

32. 投资组合报告中未有权证及金融衍生品的说明

33. 投资组合报告中未有资产支持证券的说明

34. 投资组合报告中未有股票的说明

35. 投资组合报告中未有债券的说明

36. 投资组合报告中未有基金的说明

37. 投资组合报告中未有权证及金融衍生品的说明

38. 投资组合报告中未有资产支持证券的说明

39. 投资组合报告中未有股票的说明

40. 投资组合报告中未有债券的说明

41. 投资组合报告中未有基金的说明

42. 投资组合报告中未有权证及金融衍生品的说明

43. 投资组合报告中未有资产支持证券的说明

44. 投资组合报告中未有股票的说明

45. 投资组合报告中未有债券的说明

46. 投资组合报告中未有基金的说明

47. 投资组合报告中未有权证及金融衍生品的说明

48. 投资组合报告中未有资产支持证券的说明

49. 投资组合报告中未有股票的说明

50. 投资组合报告中未有债券的说明

51. 投资组合报告中未有基金的说明

52. 投资组合报告中未有权证及金融衍生品的说明

53. 投资组合报告中未有资产支持证券的说明

54. 投资组合报告中未有股票的说明

55. 投资组合报告中未有债券的说明

56. 投资组合报告中未有基金的说明

57. 投资组合报告中未有权证及金融衍生品的说明

58. 投资组合报告中未有资产支持证券的说明

59. 投资组合报告中未有股票的说明

60. 投资组合报告中未有债券的说明

61. 投资组合报告中未有基金的说明

62. 投资组合报告中未有权证及金融衍生品的说明

63. 投资组合报告中未有