

上投摩根货币市场基金

2020 年中期报告

2020 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

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 债券回购融资情况.....	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限	38
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 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.....	39
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	39
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	40
7.9 投资组合报告附注.....	40
8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	42

9 开放式基金份额变动	42
10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	44
10.9 其他重大事件.....	44
11 备查文件目录	45
11.1 备查文件目录.....	45
11.2 存放地点.....	45
11.3 查阅方式.....	45

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根货币市场基金	
基金简称	上投摩根货币	
基金主代码	370010	
交易代码	370010	
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	
报告期末基金份额总额	58,294,288,838.62 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	上投摩根货币 A	上投摩根货币 B
下属分级基金的交易代码	370010	370010
报告期末下属分级基金的份额总额	75,222,568.12 份	58,219,066,270.50 份

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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，</p>

	<p>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。</p> <p>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。</p>
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	<p>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。</p> <p>根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和相关销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

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
信息披露 负责人	姓名	邹树波	李申
	联系电话	021-38794888	021-60637102
	电子邮箱	services@cifm.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-4888	021-60637111
传真		021-20628400	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼25楼	北京市西城区金融大街25号
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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		陈兵	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.cifm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	上投摩根基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 震旦国际大楼 25 楼
--------	--------------	--------------------------------------

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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	报告期（2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日）	
	上投摩根货币 A	上投摩根货币 B
本期已实现收益	584,119.22	682,050,647.15
本期利润	584,119.22	682,050,647.15
本期净值收益率	0.8650%	0.9852%
3.1.2 期末 数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	上投摩根货币 A	上投摩根货币 B
期末基金资产净值	75,222,568.12	58,219,066,270.50
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计 期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	上投摩根货币 A	上投摩根货币 B
累计净值收益率	43.6347%	48.9688%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（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法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

本基金收益分配按月结转份额。

上述基金业绩指标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 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 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	0.1144%	0.0005%	0.1107%	0.0000%	0.0037%	0.0005%
过去三个月	0.3430%	0.0006%	0.3357%	0.0000%	0.0073%	0.0006%
过去六个月	0.8650%	0.0011%	0.6713%	0.0000%	0.1937%	0.0011%

过去一年	1.9596%	0.0010%	1.3519%	0.0000%	0.6077%	0.0010%
过去三年	8.1496%	0.0022%	4.0519%	0.0000%	4.0977%	0.0022%
自基金合同生效起至今	43.6347%	0.0034%	23.4717%	0.0013%	20.1630%	0.0021%

2. 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	0.1340%	0.0005%	0.1107%	0.0000%	0.0233%	0.0005%
过去三个月	0.4027%	0.0006%	0.3357%	0.0000%	0.0670%	0.0006%
过去六个月	0.9852%	0.0011%	0.6713%	0.0000%	0.3139%	0.0011%
过去一年	2.2046%	0.0010%	1.3519%	0.0000%	0.8527%	0.0010%
过去三年	8.9300%	0.0022%	4.0519%	0.0000%	4.8781%	0.0022%
自基金合同生效起至今	48.9688%	0.0034%	23.4717%	0.0013%	25.4971%	0.0021%

注：本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

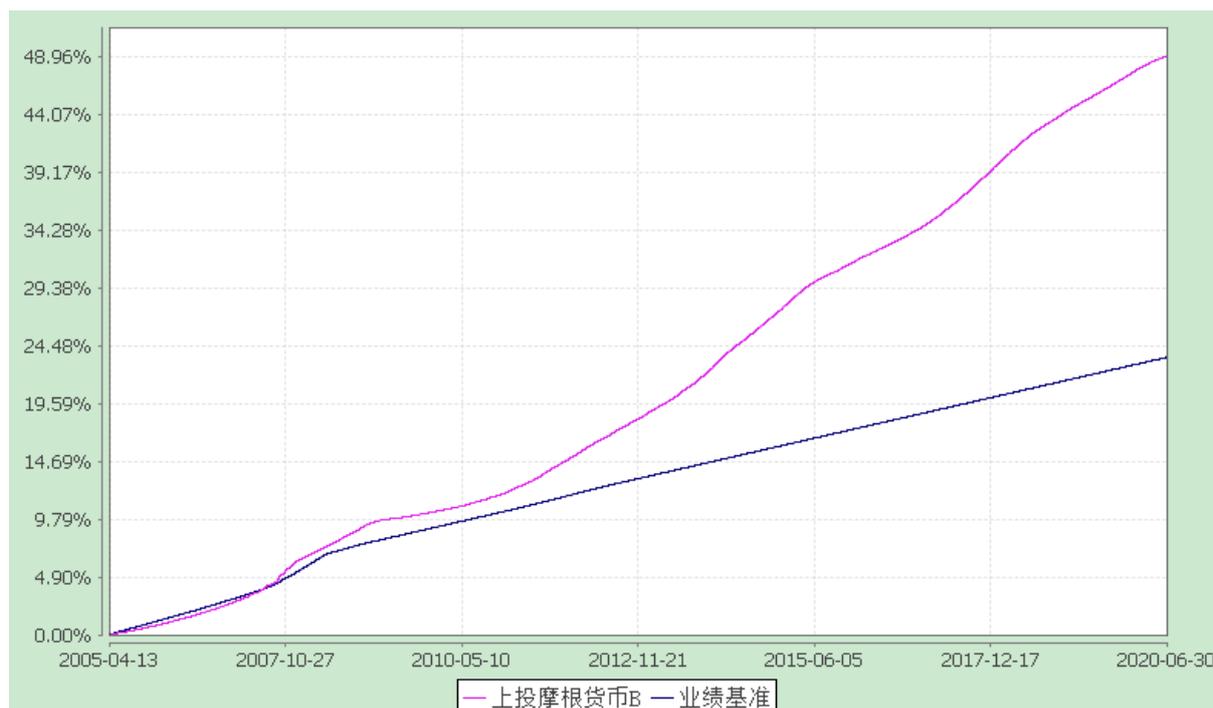
上投摩根货币市场基金

自基金合同生效以来累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2005年4月13日至2020年6月30日)

上投摩根货币 A



上投摩根货币 B



注：1.本基金合同生效日为 2005 年 4 月 13 日。图示时间段为 2005 年 4 月 13 日至 2020 年 6 月 30 日。

2.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 7 月 13 日，本基金已根据基金合同完成建仓且资产配置比例符合本基金基金合同规定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007 年 10 月 8 日更名为“上海国际信托有限公司”）与摩根资产管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。截止至 2020 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有七十四只，均为开放式基金，分别是：上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根阿尔法混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋混合型证券投资基金、上投摩根内需动力混合型证券投资基金、上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘混合型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力

混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质生活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、上投摩根分红添利债券型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选混合型证券投资基金、上投摩根智选 30 混合型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上投摩根红利回报混合型证券投资基金、上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根优信增利债券型证券投资基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添盈货币市场基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根纯债添利债券型证券投资基金、上投摩根稳进回报混合型证券投资基金、上投摩根安全战略股票型证券投资基金、上投摩根卓越制造股票型证券投资基金、上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置证券投资基金、上投摩根智慧互联股票型证券投资基金、上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根新兴服务股票型证券投资基金、上投摩根医疗健康股票型证券投资基金、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）、上投摩根策略精选灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金、上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、上投摩根全球多元配置证券投资基金(QDII)、上投摩根安丰回报混合型证券投资基金、上投摩根安通回报混合型证券投资基金、上投摩根优选多因子股票型证券投资基金、上投摩根丰瑞债券型证券投资基金、上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金、上投摩根安隆回报混合型证券投资基金、上投摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金（QDII）、上投摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、上投摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、上投摩根安裕回报混合型证券投资基金、上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金（QDII）、上投摩根核心精选股票型证券投资基金、上投摩根动力精选混合型证券投资基金、上投摩根领先优选混合型证券投资基金、上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）、上投摩根瑞利纯债债券型证券投资基金、上投摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、上投摩根瑞益纯债债券型证券投资基金、上投摩根慧选成长股票型证券投资基金、上投摩根瑞泰 38 个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根锦程稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、上投摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金以及上投摩根研究驱动股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
孟晨波	本基金基金经理、货币市场投资部总监、总经理助理	2009-09-17	-	15 年（金融领域从业经验 25 年）	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	本基金基金经理	2016-07-29	2020-06-29	13 年	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、基金经理，自 2016 年 7 月至 2020 年 6 月担任上投摩根货币市场基金基金经理。
鞠婷	本基金基金经理	2020-03-20	-	15 年	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。
忻佳华	本基金基金经理助理	2020-06-18	-	8 年	上海交通大学机械工程及自动化/国际经济与贸易学士。忻佳华先生自 2007 年 7 月至 2013 年 3 月在中国建设银行股份有限公司上海市分行担任个人客户经理；自 2013 年 3 月至 2020 年 6 月在上海农村商业银行股份有限公司担任投资交易岗；自 2020 年 6 月起加入上投摩根基金管理有限公司，历任货币市场投资部基金经理助理，自 2020 年 8 月起担任上投摩根货币市场基金基金经理。

- 注：1. 任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
3. 忻佳华先生自 2020 年 8 月 7 日起担任本基金基金经理，不再担任本基金基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根货币市场基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，未发现存在异常交易行为。

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形：无。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年，新型冠状病毒疫情给国内经济带来了一定程度的冲击，在党中央、国务院的决策部署下，全国疫情得到了快速有效的控制。随着全社会加速复工复产，上半年我国经济先降后升，二季度经济增长由负转正。从 7 月 16 日国家统计局公布的 2020 年上半年国民经济运行情况来看，主要指标呈现恢复性增长，经济运行稳步复苏。上半年国内生产总值 456,614 亿元，按可比价格计算，同比下降 1.6%，其中二季度增长 3.2%；全国规模以上工业增加值同比下降 1.3%，降幅比一季度收窄 7.1 个百分点；社会消费品零售总额 172,256 亿元，同比下降 11.4%，降幅比一季度收窄 7.6 个百分点；全国居民消费价格（CPI）同比上涨 3.8%，涨幅比一季度回落 1.1 个百分点；全国城镇新增就业人员 564 万人，完成全年目标任务的 62.7%；货物进出口总额 142,397 亿元，同比下降 3.2%，降幅比一季度收窄 3.3 个百分点；全国固定资产投资（不含农户）281,603 亿元，同比下降 3.1%，降幅比一季度收窄 13.0 个百分点；房地产开发投资增长 1.9%，而一季度则下降 7.7%。

今年上半年，我国央行面对复杂的经济环境，推出了一系列货币政策工具。比如 2 月份出台了 3000 亿元专项再贷款，春节后开市前两天向市场投放了 1.7 万亿的流动性，之后又推出了 5000 亿元支持复工复产的再贷款再贴现政策。6 月 1 日又出台两个针对中小微企业的货币政策直达工具：延期还本付息和 4000 亿元再贷款专用额度，支持更多小微企业获得免抵押担保的信用贷款支持，切实做好“六稳”和“六保”工作。上半年货币政策不但在量上满足了市场的需求，同时在价上也做出了相应的调整，2 月份调降再贷款利率 25 个基点，引导公开市场 7 天逆回购操作中标利率、中期借贷便利操作中标利率、1 年期 LPR 利率下降 30 个基点，同时决定于 7 月 1 日调降再贷款再贴现利率 25 个基点，有效降低了企业的融资成本。另外，上半年央行共实施 3 次降准，合计释放长期资金约 1.75 万亿元，债券利率出现了一拨下行趋势。在二季度特别国债、地方债和政策性金融债供给同时放量的背景下，不同债券品种的利率又出现了不同程度的探底回升。综合来看，上半年 1 年期国债、1 年期国开债和 1 年期同业存单利率分别下行约 18BP、31BP 和 50BP 左右。

上半年本基金继续在以安全性和流动性为主的前提下，积极把握利率的变动趋势，有效提升了组合整体收益率。在日常管理中，我们在逆回购、债券、同业存单和协议存款中进行均衡配置，合理安排组合流动性资产的到期分布。同时密切关注季末等关键时点客户申购赎回情况，全方位做好流动性管理，有效把控组合整体的流动性风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 类和 B 类的净值收益率分别为 0.8650% 和 0.9852%，同期业绩比较基准收益率为 0.6713%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着国内生产生活秩序逐步回归正常，内需或被进一步激发。今年中国政府工作报告中虽然没有设定 GDP 增速，但是确定了保居民就业、保基本民生、保市场主体等“六保”的目标任务，这和经济增长有着直接的关系。在 6 月 17 日的国常会上也提到“综合运用降准、再贷款等工具，保持市场流动性合理充裕，加大力度缓解融资难，缓解企业资金压力，全年人民币贷款新增和社会融资新增规模均超过上年”。预计未来央行将加大宏观政策调节力度，继续适度降低 MLF、TMLF 的利率以及定向降准以支持实体经济的可能性依然存在。在操作上，本基金将继续秉持现金管理工具的理念，密切关注海内外市场及政策变化，灵活调整资产组合配置，同时严格遵守各项监管制度和要求，严控客户集中度，继续稳健投资，力争为投资者带来更好的体验。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员，参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于成立后的每月 25 日进行收益分配（如遇 25 日为节假日则顺延至下一个工作日），收益分

配采用红利再投资方式,按月结转份额。报告期内,2020 年本基金 A 类收益分配金额为 584,119.22 元,B 类收益分配金额为 682,050,647.15 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,2020 年本基金 A 类收益分配金额为 584,119.22 元,B 类收益分配金额为 682,050,647.15 元。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上投摩根货币市场基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	10,560,942,784.40	31,597,034,597.35

结算备付金		988,037,983.37	1,050,461,957.18
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	27,003,223,498.17	22,951,403,441.29
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		27,003,223,498.17	22,951,403,441.29
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	20,666,000,000.00	24,158,565,000.00
应收证券清算款		-	1,173,417,188.29
应收利息	6.4.7.5	210,806,902.28	426,545,144.49
应收股利		-	-
应收申购款		251,826.35	689,952.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		59,429,262,994.57	81,358,117,281.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,105,918,709.36	3,418,915,322.36
应付赎回款		332,731.98	106,395.63
应付管理人报酬		16,330,094.16	23,224,490.03
应付托管费		4,948,513.40	7,037,724.25
应付销售服务费		508,582.84	718,475.58
应付交易费用	6.4.7.7	68,825.00	31,275.00
应交税费		432,707.03	476,246.70
应付利息		-	-
应付利润		6,289,238.38	34,034,699.72
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	144,753.80	282,000.00
负债合计		1,134,974,155.95	3,484,826,629.27
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	58,294,288,838.62	77,873,290,652.20
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		58,294,288,838.62	77,873,290,652.20
负债和所有者权益总计		59,429,262,994.57	81,358,117,281.47

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 58,294,288,838.62 份，其中 A 类基金份额 75,222,568.12 份，B 类基金份额 58,219,066,270.50 份。

6.2 利润表

会计主体：上投摩根货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		833,774,315.35	1,064,055,566.62
1.利息收入		832,043,752.95	1,062,809,631.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	313,232,537.23	328,347,717.64
债券利息收入		275,013,377.82	372,543,405.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		243,797,837.90	361,918,508.41
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,730,562.40	1,245,934.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,730,562.40	1,245,934.80
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
减：二、费用		151,139,548.98	167,283,676.53
1. 管理人报酬		112,924,717.03	125,038,691.60
2. 托管费		34,219,611.23	37,890,512.63
3. 销售服务费		3,503,137.38	3,882,493.58
4. 交易费用	6.4.7.18	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		304,852.89	259,582.29
7. 其他费用	6.4.7.19	187,230.45	212,396.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		682,634,766.37	896,771,890.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		682,634,766.37	896,771,890.09

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	77,873,290,652.20	-	77,873,290,652.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	682,634,766.37	682,634,766.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-19,579,001,813.58	-	-19,579,001,813.58
其中：1.基金申购款	158,729,524,067.53	-	158,729,524,067.53
2.基金赎回款	-178,308,525,881.11	-	-178,308,525,881.11
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-682,634,766.37	-682,634,766.37
五、期末所有者权益（基金净值）	58,294,288,838.62	-	58,294,288,838.62
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	74,211,322,768.98	-	74,211,322,768.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	896,771,890.09	896,771,890.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,827,813,770.09	-	-1,827,813,770.09
其中：1.基金申购款	201,259,528,148.87	-	201,259,528,148.87
2.基金赎回款	-203,087,341,918.96	-	-203,087,341,918.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-896,771,890.09	-896,771,890.09
五、期末所有者权益（基金净值）	72,383,508,998.89	-	72,383,508,998.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王大智，主管会计工作负责人：杨怡，会计机构负责人：张璐

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上投摩根货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]第 15 号《关于同意上投摩根货币市场基金募集的批复》核准，由上投摩根富林明基金管理有限公司(后更名为上投摩根基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 991,196,238.02 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第 38 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根货币市场基金基金合同》于 2005 年 4 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 991,360,522.73 份基金份额，其中认购资金利息折合 164,284.71 份基金份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《上投摩根货币市场基金招募说明书》的有关约定，本基金根据适用的销售服务费费率的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 B 类基金份额。在基金存续期内的任何一个开放日，如 A 类基金份额持有人持有的基金份额余额达到 5,000,000 份，即升级为 B 类基金份额持有人，如 B 类基金份额持有人持有的基金份额余额少于 500,000 份，即降级为 A 类基金份额持有人。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券；期限在一年以内(含一年)的债券回购；期限在一年以内(含一年)的中央银行票据以及中国证监会、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。本基金的业绩比较基准为：税后同期七天通知存款利率。

本财务报表由本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于 2020 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国

基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品

管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	1,110,942,784.40
定期存款	-
其他存款	9,450,000,000.00
合计	10,560,942,784.40

注：其他存款为有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	27,003,223,498.17	26,992,299,000.00	-10,924,498.17	-0.0187
	合计	27,003,223,498.17	26,992,299,000.00	-10,924,498.17	-0.0187
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	27,003,223,498.17	26,992,299,000.00	-10,924,498.17	-0.0187

注：1. 偏离金额=影子定价—摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	20,666,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	20,666,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	20,666,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	20,666,000,000.00	-

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日

应收活期存款利息	48,149.74
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	117,742,259.54
应收结算备付金利息	444,617.10
应收债券利息	90,612,117.19
应收买入返售证券利息	1,959,758.71
应收申购款利息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	210,806,902.28

注：其他存款均为有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	68,825.00
合计	68,825.00

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	144,753.80
合计	144,753.80

6.4.7.9 实收基金

上投摩根货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,859,912.13	70,859,912.13

本期申购	36,272,658,369.63	36,272,658,369.63
本期赎回（以“-”号填列）	-36,268,295,713.64	-36,268,295,713.64
本期末	75,222,568.12	75,222,568.12

上投摩根货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,802,430,740.07	77,802,430,740.07
本期申购	122,456,865,697.90	122,456,865,697.90
本期赎回（以“-”号填列）	-142,040,230,167.47	-142,040,230,167.47
本期末	58,219,066,270.50	58,219,066,270.50

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额。

6.4.7.10 未分配利润**上投摩根货币 A**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	584,119.22	-	584,119.22
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-584,119.22	-	-584,119.22
本期末	-	-	-

上投摩根货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	682,050,647.15	-	682,050,647.15
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-682,050,647.15	-	-682,050,647.15
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日

活期存款利息收入	2,864,735.05
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	302,002,298.81
结算备付金利息收入	8,365,503.37
其他	-
合计	313,232,537.23

注：其他存款利息收入均为有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款产生的利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

无。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	24,519,435,634.25
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,213,852,211.10
减：应收利息总额	303,852,860.75
买卖债券差价收入	1,730,562.40

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

无。

6.4.7.16 公允价值变动收益

无。

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 交易费用

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	76,081.46
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	32,876.65
账户维护费用	18,000.00
其他	600.00
合计	187,230.45

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

2020 年度 分配日 分配收益所属期间

— 第 7 次收益支付 2020/07/27 2020/06/28-2020/07/26

— 第 8 次收益支付 2020/08/25 2020/07/27-2020/08/24

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上投摩根基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2关联方报酬**6.4.10.2.1基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	112,924,717.03	125,038,691.60
其中：支付销售机构的客户维护费	9,178,230.88	9,795,692.80

注：支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.33\% / \text{当年天数。}$$

6.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	34,219,611.23	37,890,512.63

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数。}$$

6.4.10.2.3销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	上投摩根货币 A	上投摩根货币 B	合计
上投摩根基金管理有限公司	33,365.95	2,496,216.11	2,529,582.06
中国建设银行	25,086.29	8,610.99	33,697.28
上海浦东发展银行股份有限公司	99.84	-	99.84

合计	58,552.08	2,504,827.10	2,563,379.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	上投摩根货币A	上投摩根货币B	合计
上投摩根基金管理有限公司	42,574.09	2,806,106.09	2,848,680.18
中国建设银行	25,292.78	32,389.68	57,682.46
合计	67,866.87	2,838,495.77	2,906,362.64

注：支付基金销售机构的 A 类基金份额和 B 类基金份额的销售服务费分别按前一日该类基金资产净值 0.25% 和 0.01% 的年费率计提。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

上投摩根货币 A

无。

上投摩根货币 B

份额单位：份

关联方名称	上投摩根货币B本期末 2020年6月30日		上投摩根货币B上年度末 2019年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
上海信托	905,280.41	0.00%	837,562.78	0.00%

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,110,942,784.40	2,864,735.05	323,333,201.10	3,080,586.06

注：本基金的活期银行存款和部分定期存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

无。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

6.4.11 利润分配情况

1、上投摩根货币 A

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
517,803.88	67,293.33	-977.99	584,119.22	-

2、上投摩根货币 B

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
682,722,856.10	27,072,274.40	-27,744,483.35	682,050,647. 15	-

6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监查和风险控制的评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管，并提出内控建议。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行活期存款存放在本基金的托管行 中国建设银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。银行定期存款存放在具有托管资格的交通银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 37.59% (2019 年 12 月 31 日：19.97%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	699,705,044.08	1,058,912,019.29
A-1 以下	-	-
未评级	9,357,448,070.60	6,917,273,403.72
合计	10,057,153,114.68	7,976,185,423.01

注：未评级的债券为国债

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	15,014,481,534.97	10,364,162,071.34
合计	15,014,481,534.97	10,364,162,071.34

注：未评级的债券为主体评级为 AAA 的同业存单

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	1,931,588,848.52	4,611,055,946.94
合计	1,931,588,848.52	4,611,055,946.94

注：注：未评级的债券为政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产

方式借入短期资金应对流动性需求，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的 40%。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券),并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天,平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天,且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天,平均剩余存续期不得超过 180 天;投资组合中现金、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不得低于 20%;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天,平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天;投资组合中现金、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不得低于 30%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产(流动性受限资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条)的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-------------------	-------	-------	-------	-----	----

30 日					
资产					
银行存款	10,560,942,784.40	-	-	-	-10,560,942,784.40
结算备付金	988,037,983.37	-	-	-	988,037,983.37
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	27,003,223,498.17	-	-	-	-27,003,223,498.17
买入返售金融资产	20,666,000,000.00	-	-	-	-20,666,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	210,806,902.28	210,806,902.28
应收申购款	-	-	-	251,826.35	251,826.35
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	59,218,204,265.94	-	-	211,058,728.63	59,429,262,994.57
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,105,918,709.36	1,105,918,709.36
应付赎回款	-	-	-	332,731.98	332,731.98
应付管理人报酬	-	-	-	16,330,094.16	16,330,094.16
应付托管费	-	-	-	4,948,513.40	4,948,513.40
应付销售服务费	-	-	-	508,582.84	508,582.84
应付交易费用	-	-	-	68,825.00	68,825.00
应付税费	-	-	-	432,707.03	432,707.03
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	6,289,238.38	6,289,238.38
其他负债	-	-	-	144,753.80	144,753.80
负债总计	-	-	-	1,134,974,155.95	1,134,974,155.95
利率敏感度缺口	59,218,204,265.94	-	-	-923,915,427.32	58,294,288,838.62
上年度末 2019 年 12 月	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

31 日					
资产					
银行存款	31,597,034,597.35	-	-	-	31,597,034,597.35
结算备付金	1,050,461,957.18	-	-	-	1,050,461,957.18
交易性金融资产	22,951,403,441.29	-	-	-	22,951,403,441.29
买入返售金融资产	24,158,565,000.00	-	-	-	24,158,565,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,173,417,188.29	1,173,417,188.29
应收利息	-	-	-	426,545,144.49	426,545,144.49
应收申购款	-	-	-	689,952.87	689,952.87
资产总计	79,757,464,995.82	-	-	1,600,652,285.65	81,358,117,281.47
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,418,915,322.36	3,418,915,322.36
应付赎回款	-	-	-	106,395.63	106,395.63
应付管理人报酬	-	-	-	23,224,490.03	23,224,490.03
应付托管费	-	-	-	7,037,724.25	7,037,724.25
应付销售服务费	-	-	-	718,475.58	718,475.58
应付交易费用	-	-	-	31,275.00	31,275.00
应交税费	-	-	-	476,246.70	476,246.70
应付利润	-	-	-	34,034,699.72	34,034,699.72
其他负债	-	-	-	282,000.00	282,000.00
负债总计	-	-	-	3,484,826,629.27	3,484,826,629.27
利率敏感度缺口	79,757,464,995.82	-	-	-1,884,174,343.62	77,873,290,652.20

表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的
----	-----------	----------------

		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
1.市场利率下降25个基点		增加约 1,355	增加约 1,284
2.市场利率上升25个基点		减少约 1,352	减少约 1,281

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	27,003,223,498.17	45.44
	其中：债券	27,003,223,498.17	45.44
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	20,666,000,000.00	34.77
	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	11,548,980,767.77	19.43
4	其他各项资产	211,058,728.63	0.36
5	合计	59,429,262,994.57	100.00

7.2 债券回购融资情况

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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	63
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	72
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

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。

7.3.2 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 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	50.88	1.90
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	16.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	6.31	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	8.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	19.18	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	101.58	1.90

7.4 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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	399,314,538.34	0.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,693,078,595.48	8.05
	其中：政策性金融债	4,693,078,595.48	8.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	6,896,348,829.38	11.83
6	中期票据	-	-
7	同业存单	15,014,481,534.97	25.76
8	其他	-	-
9	合计	27,003,223,498.17	46.32
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111903099	19 农业银行 CD099	10,500,000.00	1,047,941,436.89	1.80
2	111903112	19 农业银行 CD112	9,200,000.00	918,360,778.43	1.58
3	111903125	19 农业银行 CD125	9,000,000.00	898,112,644.39	1.54
4	200304	20 进出 04	8,800,000.00	879,151,849.97	1.51
5	111903094	19 农业银行 CD094	8,700,000.00	868,773,099.28	1.49
6	200201	20 国开 01	7,800,000.00	782,375,164.59	1.34
7	111904052	19 中国银行 CD052	7,700,000.00	769,019,840.78	1.32
8	111903086	19 农业银行 CD086	6,000,000.00	599,357,862.87	1.03
9	111904065	19 中国银行 CD065	6,000,000.00	598,998,603.45	1.03
10	012001259	20 中油股 SCP006	5,000,000.00	500,025,914.35	0.86

7.7 “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
报告期内偏离度的最高值	0.1033%

报告期内偏离度的最低值	-0.0383%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0551%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期未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

本报告期未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	210,806,902.28
4	应收申购款	251,826.35
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	211,058,728.63

7.9.4 其他需说明的重要事项

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，可致电本基金管理人获取。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
上投摩根货币 A	2,732	27,533.88	26,914,603.92	35.78%	48,307,964.20	64.22%
上投摩根货币 B	248	234,754,299.48	58,218,486,879.00	100.00%	579,391.50	0.00%
合计	2,980	19,561,841.89	58,245,401,482.92	99.92%	48,887,355.70	0.08%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	机构	2,907,783,242.54	4.99%
2	机构	2,866,527,136.52	4.92%
3	机构	2,599,290,635.20	4.46%
4	机构	2,584,037,001.23	4.43%
5	机构	2,380,699,334.86	4.08%
6	机构	1,830,371,606.25	3.14%
7	机构	1,527,406,510.25	2.62%
8	机构	1,410,000,000.00	2.42%
9	机构	1,242,240,271.56	2.13%
10	机构	1,240,000,000.00	2.13%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员	上投摩根货币 A	2,759.80	0.0037%

员持有本基金	上投摩根货币 B	-	-
	合计	2,759.80	0.0000%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	上投摩根货币 A	0~10
	上投摩根货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	上投摩根货币 A	0
	上投摩根货币 B	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	上投摩根货币 A	上投摩根货币 B
基金合同生效日（2005 年 4 月 13 日）基金份额总额	577,965,478.90	413,395,043.83
本报告期期初基金份额总额	70,859,912.13	77,802,430,740.07
本报告期基金总申购份额	36,272,658,369.63	122,456,865,697.90
减：本报告期基金总赎回份额	36,268,295,713.64	142,040,230,167.47
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	75,222,568.12	58,219,066,270.50

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

- 1、基金管理人于 2020 年 1 月 18 日公告，自 2020 年 1 月 17 日起，张军先生不再担任公司副总经理。
- 2、基金管理人于 2020 年 1 月 23 日公告，自 2020 年 1 月 22 日起，刘鲁旦先生开始担任公司副总经理。
- 3、基金管理人于 2020 年 6 月 20 日公告，自 2020 年 6 月 19 日起，卢蓉女士开始担任公司首席信息官。

基金托管人：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人、托管人未受稽查或处罚，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 交易单元的选择标准：

- 1) 资本金雄厚,信誉良好。
- 2) 财务状况良好,经营行为规范。
- 3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

5) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 交易单元的选择程序：

1) 本基金管理人定期召开会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进行评估，确定选用交易单元的券商。

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

4. 本基金本期无新增席位、注销席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	-	-	1,036,302,000,000.00	92.18%	-	-
招商证券	-	-	87,855,236,000.00	7.82%	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2020-01-18
2	上投摩根货币市场基金春节假期前暂停申购及转换转入业务的公告	同上	2020-01-20
3	上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2020-01-23
4	上投摩根货币市场基金增聘基金经理公告	同上	2020-03-21
5	上投摩根基金管理有限公司关于修改公司旗下 65 只公开募集证券投资基金基金合同的公告	同上	2020-04-15
6	上投摩根货币市场基金劳动节假期前暂停申购及转换转入业务的公告	同上	2020-04-24
7	上投摩根基金管理有限公司关于风险等级评定和风险收益特征可能存在差异的公告	同上	2020-06-10
8	上投摩根基金管理有限公司关于增聘高级管理人员的公告	同上	2020-06-20
9	上投摩根货币市场基金基金经理变更公告	同上	2020-06-30

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准上投摩根货币市场基金设立的文件；
- 2.《上投摩根货币市场基金基金合同》；
- 3.《上投摩根货币市场基金基金托管协议》；
- 4.《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司

二〇二〇年八月三十一日