

上投摩根货币市场基金
2013 年年度报告摘要
2013 年 12 月 31 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：二〇一四年三月二十八日

§ 1 重要提示

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 2014 年 3 月 27 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	35,468,968,294.54 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	193,891,858.99 份	35,275,076,435.55 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的决策。</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</p>

	<p>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。</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。</p> <p>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	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。

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	胥洪擎	田青
	联系电话	021-38794888	010-67595096
	电子邮箱	services@cifm.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-4888	010-67595096
传真		021-20628400	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cifm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2013 年		2012 年		2011 年	
	上投摩根货币 A	上投摩根货币 B	上投摩根货币 A	上投摩根货币 B	上投摩根货币 A	上投摩根货币 B
本期已实现	6,247,399.26	1,126,627,882.51	2,576,441.99	535,793,851.23	3,044,725.65	307,343,861.94

收益						
本期利润	6,247,399.26	1,126,627,882.51	2,576,441.99	535,793,851.23	3,044,725.65	307,343,861.94
本期基金份额净值收益率	3.2795%	3.5266%	2.7042%	2.9506%	2.5841%	2.8303%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末		2012 年末		2011 年末	
	上投摩根货币 A	上投摩根货币 B	上投摩根货币 A	上投摩根货币 B	上投摩根货币 A	上投摩根货币 B
期末基金资产净值	193,891,858.99	35,275,076,435.55	98,075,400.17	21,892,735,573.91	112,984,777.86	14,122,060,436.45
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

注：1.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。

2.本基金收益分配按月结转份额。

3.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
过去三个月	1.0104%	0.0018%	0.3403%	0.0000%	0.6701%	0.0018%
过去六个月	1.8478%	0.0018%	0.6805%	0.0000%	1.1673%	0.0018%
过去一年	3.2795%	0.0020%	1.3500%	0.0000%	1.9295%	0.0020%

过去三年	8.8131%	0.0018%	4.2275%	0.0002%	4.5856%	0.0016%
过去五年	10.9752%	0.0029%	6.9275%	0.0002%	4.0477%	0.0027%
自基金合同生效起至今	20.2592%	0.0038%	14.7004%	0.0016%	5.5588%	0.0022%

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
过去三个月	1.0716%	0.0018%	0.3403%	0.0000%	0.7313%	0.0018%
过去六个月	1.9709%	0.0018%	0.6805%	0.0000%	1.2904%	0.0018%
过去一年	3.5266%	0.0020%	1.3500%	0.0000%	2.1766%	0.0020%
过去三年	9.5974%	0.0018%	4.2275%	0.0002%	5.3699%	0.0016%
过去五年	12.3137%	0.0029%	6.9275%	0.0002%	5.3862%	0.0027%
自基金合同生效起至今	22.7988%	0.0038%	14.7004%	0.0016%	8.0984%	0.0022%

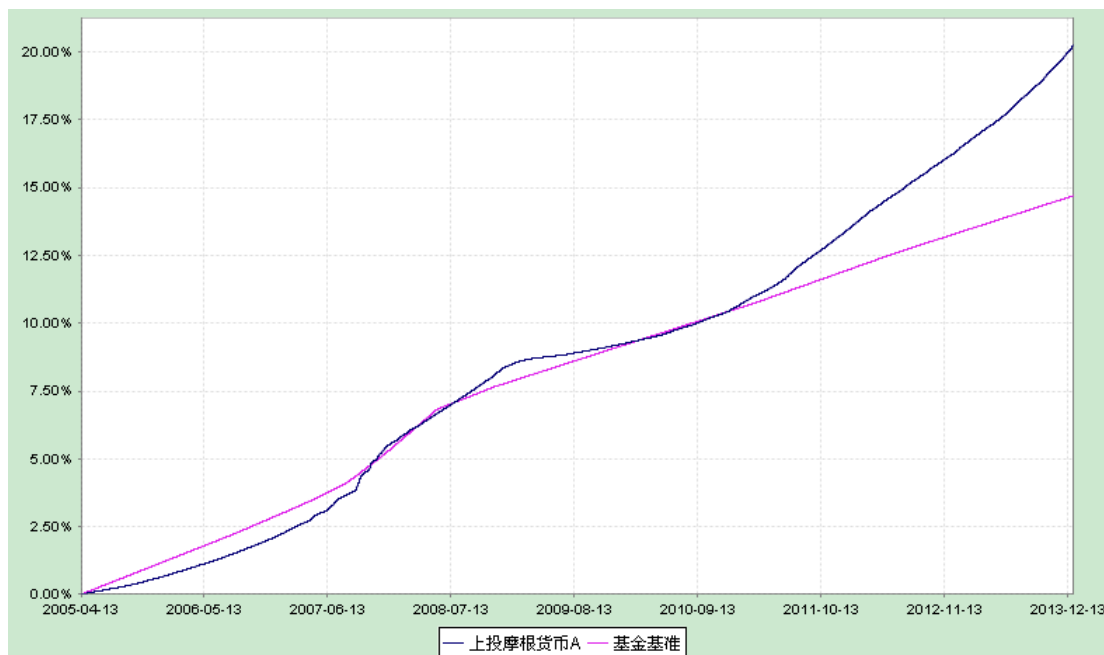
注：本基金合同生效日为 2005 年 4 月 13 日。

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
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2005 年 4 月 13 日至 2013 年 12 月 31 日)

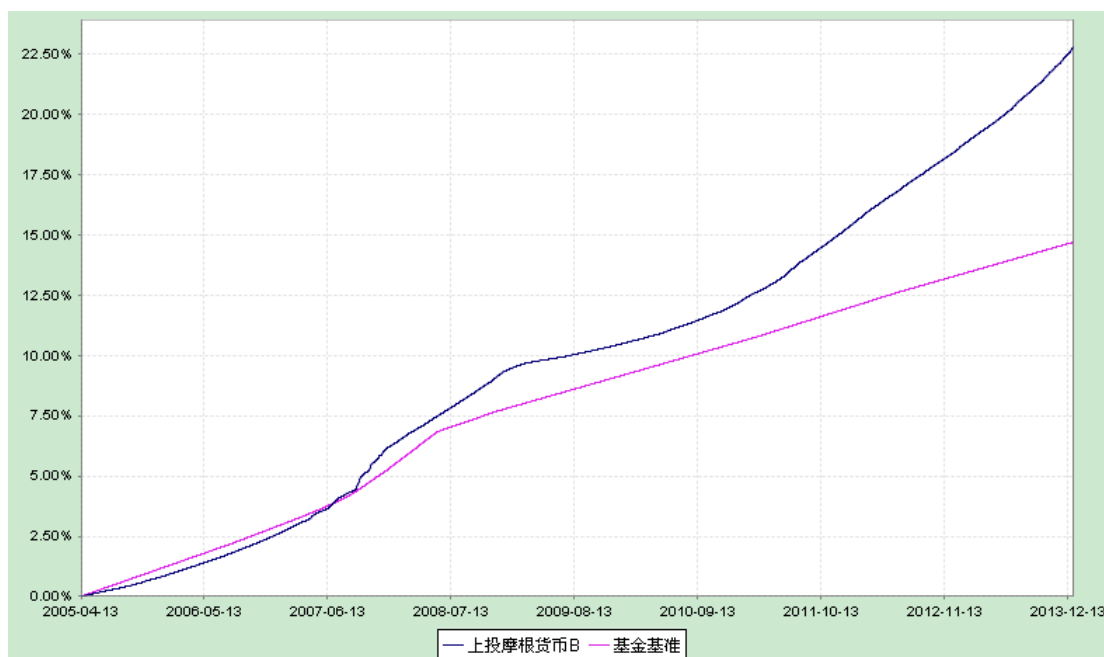
1、上投摩根货币 A

(2005 年 4 月 13 日至 2013 年 12 月 31 日)



2、上投摩根货币 B

(2005 年 4 月 13 日至 2013 年 12 月 31 日)



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完成建仓且资产配置比例符合本基金基金合同规定。

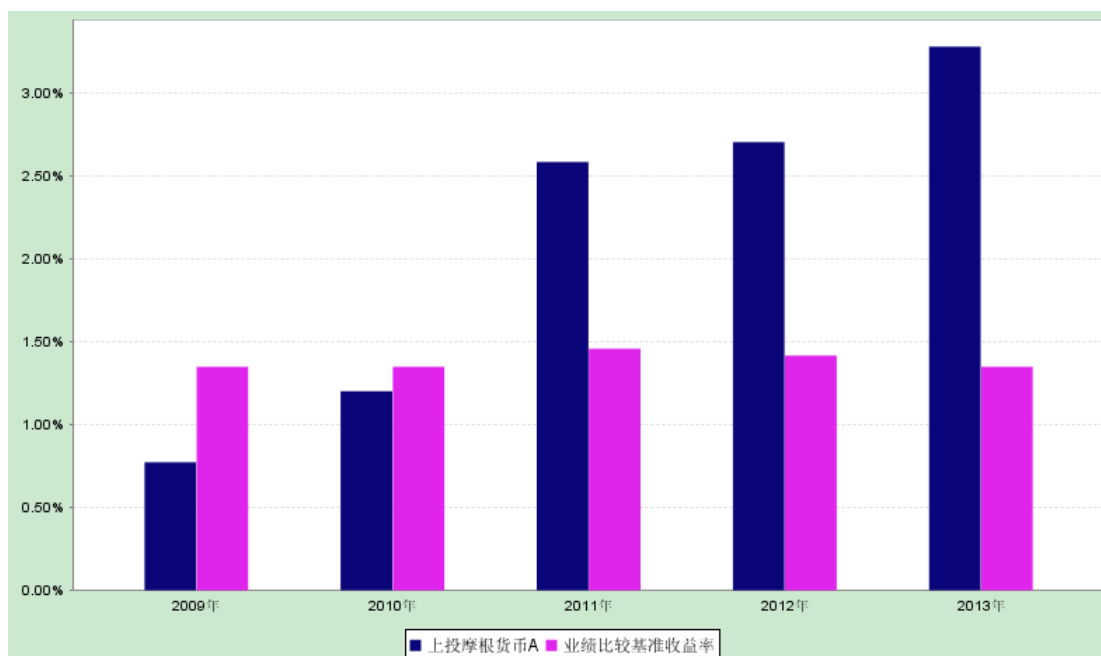
本基金合同生效日为 2005 年 04 月 13 日。图示时间段为 2005 年 04 月 13 日至 2013 年 12 月 31 日。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

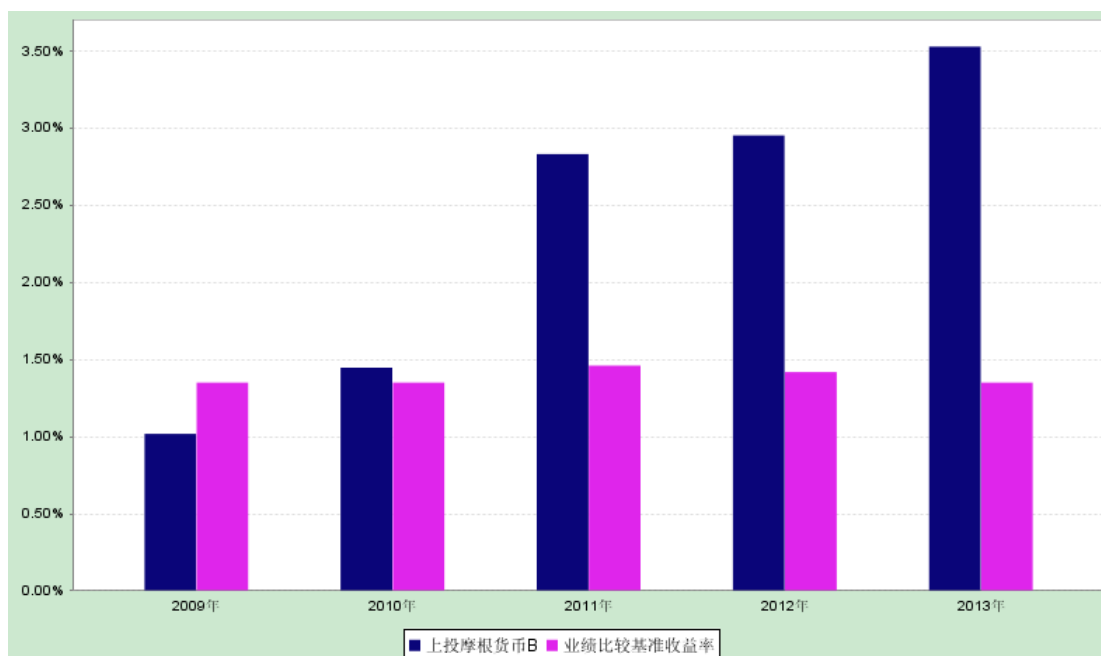
上投摩根货币市场基金

过去五年基金净值收益率与业绩比较基准收益率的对比图

1、上投摩根货币 A



2、上投摩根货币 B



注：本基金合同生效日为 2005 年 4 月 13 日。图示时间段为 2009 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、上投摩根货币 A

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合 计	备注
2013 年	5,153,444.06	889,304.16	204,651.04	6,247,399.26	-
2012 年	2,286,445.53	282,328.58	7,667.88	2,576,441.99	-
2011 年	2,697,721.13	333,090.65	13,913.87	3,044,725.65	-
合计	10,137,610.72	1,504,723.39	226,232.79	11,868,566.90	-

2、上投摩根货币 B

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合 计	备注
2013 年	1,064,077,002.28	40,517,437.51	22,033,442.72	1,126,627,882.51	-
2012 年	510,536,483.65	17,827,151.68	7,430,215.90	535,793,851.23	-
2011 年	293,361,993.85	9,153,348.83	4,828,519.26	307,343,861.94	-
合计	1,867,975,479.78	67,497,938.02	34,292,177.88	1,969,765,595.68	-

§ 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。截至 2013 年 12 月底，公司管理的基金共有二十九只，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、上投摩根阿尔法股票型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋股票型证券投资基金、上投摩根内需动力股票型证券投资基金、上投摩根亚太优势股票型证券投资基金、上投摩根双核平衡

混合型证券投资基金、上投摩根中小盘股票型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、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股票型证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质股票型证券投资基金、上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金、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、上投摩根核心优选股票型证券投资基金、上投摩根轮动添利债券型证券投资基金、上投摩根智选 30 股票型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上证 180 高贝塔交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金、上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金、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和上投摩根双债增利债券型证券投资基金。

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		
王亚南	本基金基金经理	2008-11-29	-	11 年	复旦大学金融工程专业硕士。2003 年至 2007 年，就职于海通证券股份有限公司研究所，任固定收益研究员。2007 年 6 月加入国泰基金管理有限公司，任国泰金鹿保本基金经理助理。2008 年 6 月加入上投摩根基金管理有限公司，自 2008 年 11 月起任上投摩根货币市场基金基金经理，自 2009 年 6 月起同时任上投摩根纯债债券型证券投资基金基金经理。
孟晨波	本基金基金经理、固定	2009-09-17	-	19 年	经济学学士，历任荷兰银行上海分行资金部高

	收益部总监				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，担任固定收益部总监，2009年9月起任上投摩根货币市场基金基金经理。
唐璜	本基金基金经理助理	2012-08-29	-	5年	英国爱丁堡大学硕士，2008年2月至2010年4月任 JPMorgan(EMEA) 分析师，2010年6月-2011年3月，任交银施罗德基金管理有限公司分析师，2011年3月加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任分析师及基金经理助理。

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。

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 公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求，

制订了《上投摩根基金管理有限公司公平交易制度》，规范了公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动，同时涵盖了授权、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各个环节，以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

公司执行自上而下的三级授权体系，依次为投资决策委员会、投资总监、经理人，经理人在其授权范围内自主决策，投资决策委员会和投资总监均不得干预其授权范围内的投资活动。公司已建立客观的研究方法，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。对于交易所市场投资活动，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机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易室询价机制，严格防范交易对手风险并抽检价格公允性；对于一级市场申购投资行为，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。

公司制订了《异常交易监控与报告制度》，通过系统和人工相结合的方式对投资交易行为的监控分析，并执行异常交易行为监控分析记录工作机制，确保公平交易可稽核。公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行上述公平交易制度和控制方法，开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的收益率差异、以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易时机和交易价差等方面的监控分析，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

其中，在同向交易的监控和分析方面，根据法规要求，公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控，通过定期抽查前述的同向交易行为，定性分析交易时机、对比不同投资组合长期的交易趋势，重点关注任何可能导致不公平交易的情形。对于识别的异常情况，由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释。同时，公司根据法规的要求，通过系统模块定期对连续四个季度内不同投资组合在不同时间窗内（日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行分析，采用概率统计方法，主要关注不同投资组合之间同向交易价差均值为零的显著性检验，以及同向交易价格占优的交易次数占比分析。

报告期内，通过前述分析方法，未发现不同投资组合之间同向交易价差异异常的情况。

4.3.3 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，公司未发现存在异常

交易行为。

报告期内，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% 的情形共计发生 1 次，为指数基金在建仓期被动跟踪标的指数和其他投资组合发生的反向交易。

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

回顾 2013 年，宏观经济保持平稳增长，GDP 全年增长 7.7%，与 2012 年持平；物价下半年有所回升，但全年通胀水平保持在 2.6% 的可控范围之内。在调结构和盘活存量资金的宏观调控基调下，货币供应总量增速有所放缓，M2 从年初 15.9% 回落至 13.6%，社会融资总量全年新增 17.3 万亿。2013 年银行表外理财和表内同业规模快速增长，央行货币政策操作以防范金融风险 and 降低银行杠杆为出发点，全年货币政策经历了从中性偏宽松到中性偏紧的调整，结合正逆回购、SLO、SLF、以及央票等货币调控工具，对银行间市场流动性进行了较为精细的调控操作。

具体表现在货币市场方面，全年货币市场利率前低后高。一季度受外汇占款增长较快影响，资金较为宽松；二季度末，受贷款增长较快、企业所得税集中清缴、外汇市场变化、补缴法定准备金等多种因素叠加影响，银行间流动性的紧张程度和波动在 6 月中旬开始异常加剧。下半年，央行短期流动性操作更加灵活，结合逆回购、SLO、SLF 和主动的市场预期管理，缓解了资金的波动程度，但“锁长放短”的操作，使得整体资金情况较上半年偏紧。其中，银行间 7 天质押式回购利率上半年最低 2.49%，最高 11.62%，振幅达到 9.13%，平均利率 3.87%。下半年振幅则缩小至 5.6%，均值提高至 4.36%。债券市场收益率受到资金波动和资金预期偏紧的影响，出现剧烈的调整，以 6 个月和 1 年期国债为例，从年初的 2.80% 和 2.92% 的水平，持续上行至年末的 4.17% 和 4.22%。

上投摩根货币市场基金延续一贯审慎严谨的投资风格，将组合久期限制在 75 天之内，远低于目前国内通行的 120 天组合久期限制。上投摩根货币市场基金也不进行正回购放大操作。在以市场利率为基准的浮动利率债券投资上，也仅投资实际存续期在 3 年以内的浮动利率债券。在对短期融资券的投资及逆回购交易对手方面也有非常严格的规定和限制。具体表现在，结合银行间资金面偏紧的情况，本基金在二季度中期及时调整配置结构，缩短久期，降低债券的风险敞口，提高资金品种投资比例，如提高逆回购占比和商业银行协议存款比例等，使得基金把握住了收益率快速上行时的再投资机会，降低了基金收益率的波动，稳步提

升了基金的收益回报。

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 3.2795% 和 3.5266%，同期业绩比较基准收益率为 1.35%。

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 2014 年，经济增长平稳放缓，通胀小幅抬头。控制、防范和化解债务风险仍将是监管的主线，预计央行将继续执行稳健审慎的货币政策，通过公开市场操作灵活管理市场流动性，平抑货币资金市场的大幅波动，优化资金结构。银行间资金面仍将保持中性平稳的特征。上投摩根货币基金会继续保持谨慎的投资风格，牢牢遵守货币基金现金管理工具的原则。关注银行间潜在的流动性冲击，在保持组合较高流动性，增强组合抗风险能力的前提下，优化组合资产配置，保持组合适度的久期，同时严控投资风险，力争为持有人提供长期稳健的回报。

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。2013 年本基金 A 类收益分配金额为 6,247,399.26 元，B 类收益分配金额为 1,126,627,882.51 元。

§ 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，本基金实施利润分配的金额为 A 类 6,247,399.26 元, B 类 1,126,627,882.51 元。

5.3 托管人对本年度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 审计报告

上投摩根货币市场基金 2013 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所审计、注册会计师汪棣、王灵签字出具了“无保留意见的审计报告”(编号：普华永道中天审字(2014)第 20696 号)。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：上投摩根货币市场基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	12,162,301,671.89	2,873,807,214.11
结算备付金		485,476,190.39	238,353,181.82
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	3,915,411,159.48	7,012,784,125.54
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,915,411,159.48	7,012,784,125.54
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	21,252,200,000.00	12,905,500,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	148,756,222.30	104,395,592.17
应收股利		-	-
应收申购款		5,267,661.42	4,403,797.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		37,969,412,905.48	23,139,243,911.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,443,970,778.02	1,123,171,315.52
应付赎回款		4,292,976.54	1,361,227.88
应付管理人报酬		10,575,254.61	6,043,294.06
应付托管费		3,204,622.58	1,831,301.20
应付销售服务费		358,440.36	203,056.85
应付交易费用	7.4.7.7	15,328.35	33,625.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		37,623,210.48	15,385,116.72
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	404,000.00	404,000.00
负债合计		2,500,444,610.94	1,148,432,937.23
所有者权益：			

实收基金	7.4.7.9	35,468,968,294.54	21,990,810,974.08
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		35,468,968,294.54	21,990,810,974.08
负债和所有者权益总计		37,969,412,905.48	23,139,243,911.31

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，A 类和 B 类基金份额净值均为 1.0000 元，基金份额总额 35,468,968,294.54 份，其中 A 类基金份额 193,891,858.99 份，B 类基金份额 35,275,076,435.55 份。

7.2 利润表

会计主体：上投摩根货币市场基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		1,274,754,282.43	620,943,187.54
1. 利息收入		1,290,050,776.25	612,481,422.41
其中：存款利息收入	7.4.7.11	285,618,579.53	40,600,755.62
债券利息收入		271,356,762.57	253,852,777.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		733,075,434.15	318,027,888.83
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-15,296,493.82	8,461,765.13
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-15,296,493.82	8,461,765.13
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
减：二、费用		141,879,000.66	82,572,894.32
1. 管理人报酬		105,717,213.12	61,411,062.39
2. 托管费		32,035,519.05	18,609,412.87

3. 销售服务费		3,654,282.32	2,092,510.79
4. 交易费用	7.4.7.18	300.00	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	471,686.17	459,908.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,132,875,281.77	538,370,293.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,132,875,281.77	538,370,293.22

7.3 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31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）	21,990,810,974.08	-	21,990,810,974.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,132,875,281.77	1,132,875,281.77
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）	13,478,157,320.46	-	13,478,157,320.46
其中：1. 基金申购款	166,008,400,008.95	-	166,008,400,008.95
2. 基金赎回款	-152,530,242,688.49	-	-152,530,242,688.49
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）	-	-1,132,875,281.77	-1,132,875,281.77
五、期末所有者权益（基金净值）	35,468,968,294.54	-	35,468,968,294.54
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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）	14,235,045,214.31	-	14,235,045,214.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	538,370,293.22	538,370,293.22
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）	7,755,765,759.77	-	7,755,765,759.77
其中：1. 基金申购款	90,926,054,738.97	-	90,926,054,738.97

2. 基金赎回款	-83,170,288,979.20	-	-83,170,288,979.20
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)	-	-538,370,293.22	-538,370,293.22
五、期末所有者权益(基金净值)	21,990,810,974.08	-	21,990,810,974.08

报告附注为财务报表的组成部分

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署；

基金管理公司负责人：章硕麟，主管会计工作负责人：胡志强，会计机构负责人：张璐

7.4 报表附注

7.4.1 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、B 类两类份额，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 类份额持有人。

根据《货币市场基金管理暂行规定》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；一年以内的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天以内的债券；期限在一年以内的债券回购；期限在一年以内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 2014 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 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 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(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, 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。

7.4.7 关联方关系

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
上海国际信托有限公司(“上海信托”)	基金管理人的股东
摩根资产管理(英国)有限公司	基金管理人的股东
上信资产管理有限公司	基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司
上海国利货币经纪有限公司	基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司
J.P. Morgan Investment Management Limited	基金管理人的股东摩根资产管理(英国)有限公司控制的公司
J.P. Morgan 8CS Investments (GP) Limited	基金管理人的股东摩根资产管理(英国)有限公司控制的公司

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31 日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	105,717,213.12	61,411,062.39
其中：支付销售机构的客户维护费	112,789.87	27,070.14

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：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31 日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31 日
----	---------------------------------	--------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	32,035,519.05	18,609,412.87
----------------	---------------	---------------

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：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

7.4.8.2.3 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 2013年1月1日至2013年12月31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	291,103.24	3,170,403.15	3,461,506.39
中国建设银行	97,491.22	378.37	97,869.59
合计	388,594.46	3,170,781.52	3,559,375.98
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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	142,675.43	1,849,635.76	1,992,311.19
中国建设银行	47,490.10	257.53	47,747.63
合计	190,165.53	1,849,893.29	2,040,058.82

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：日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 约定年费率 / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	404,493,638.91	748,564,831.30	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	512,875,784.69	-	495,000,000.00	606,699.14	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

无。

7.4.8.5 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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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	2,562,301,671.89	3,951,944.19	1,273,807,214.11	3,357,867.99

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可
分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级
中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可
观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资
产中属于第二层级的余额为 3,915,411,159.48 元，无属于第一或第三层级的余额(2012 年 12

月 31 日：第二层级 7,012,784,125.54 元，无属于第一或第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	3,915,411,159.48	10.31
	其中：债券	3,915,411,159.48	10.31
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	21,252,200,000.00	55.97
	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	12,647,777,862.28	33.31
4	其他各项资产	154,023,883.72	0.41
	合计	37,969,412,905.48	100.00

注：截至 2013 年 12 月 31 日，上投摩根货币市场基金资产净值为 35,468,968,294.54，A 类和 B 类基金份额净值均为 1.0000 元。

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-

其中：买断式回购融资	-	-
------------	---	---

8.3 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%。

8.4 基金投资组合平均剩余期限

8.4.1 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	29
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	70
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26

报告期内投资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。

8.4.2 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	82.04	6.89
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	5.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	11.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	4.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	2.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	106.62	6.89

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,025,533,852.87	8.53
	其中：政策性金融债	3,025,533,852.87	8.53
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	889,877,306.61	2.51
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,915,411,159.48	11.04
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 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	041356003	13 铁道 CP001	5,100,000	509,982,473.63	1.44
2	120409	12 农发 09	4,400,000	438,035,257.40	1.23
3	110206	11 国开 06	4,000,000	400,041,252.10	1.13
4	041352014	13 电网 CP001	3,800,000	379,894,832.98	1.07
5	130311	13 进出 11	3,800,000	379,064,487.83	1.07
6	130236	13 国开 36	3,000,000	299,537,272.70	0.84
7	130227	13 国开 27	2,500,000	249,475,518.81	0.70
8	110215	11 国开 15	1,900,000	190,021,303.67	0.54
9	130218	13 国开 18	1,800,000	179,764,578.38	0.51
10	110203	11 国开 03	1,500,000	149,964,257.19	0.42

8.7 “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	0.0456%
报告期内偏离度的最低值	-0.2086%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0456%

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 报告期内本基金未存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况。

8.9.3 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。

8.9.4 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	148,756,222.30
4	应收申购款	5,267,661.42
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	154,023,883.72

8.9.5 其他需说明的重要事项标题

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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	7,343	26,404.99	12,685,070.85	6.54%	181,206,788.14	93.46%

摩根货币 A						
上投摩根货币 B	209	168,780,270.03	35,211,232,260.70	99.82%	63,844,174.85	0.18%
合计	7,552	4,696,632.45	35,223,917,331.55	99.31%	245,050,962.99	0.69%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	上投摩根货币 A	838,596.02	0.4325%
	上投摩根货币 B	-	-
	合计	838,596.02	0.0024%

注：期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0，该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

§ 10 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	98,075,400.17	21,892,735,573.91
本报告期基金总申购份额	31,001,314,290.48	135,007,085,718.47
减：本报告期基金总赎回份额	30,905,497,831.66	121,624,744,856.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	193,891,858.99	35,275,076,435.55

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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：

2013 年 2 月 8 日基金管理人发布《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》，经上投摩根基金管理有限公司董事会审议通过，决定聘任陈星德先生为公司副总经理且陈星德先生不再担任公司督察长一职、聘任刘万方先生为公司督察长。

2013 年 4 月 19 日基金管理人发布《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》，经上投摩根基金管理有限公司董事会审议通过，决定聘任张军先生为公司副总经理。

基金托管人：

本基金托管人 2013 年 12 月 5 日发布任免通知,聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 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情况。报告年度应支付给聘任普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 155,000 元，目前的审计机构已提供审计服务的连续年限为 9 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
申银万国	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准：

- 1) 资本雄厚,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。
- 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。

2. 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。
- 3.2013 年度本基金新增一个席位、无注销席位。

11.7.2 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
申银万国	-	-	945,304,100,000.00	99.95%	-	-
招商证券	-	-	452,970,000.00	0.05%	-	-

11.8 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。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一四年三月二十八日