上投摩根货币市场基金

2014 年度 报告摘要

2014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:二〇一五年三月二十六日

§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2015年3月25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2014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	67,391,039,412.64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	209,186,468.29份	67,181,852,944.35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	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。 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。 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。 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,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。 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。
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	胡迪	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	2014年		2013年		2012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
本期已实现收益	5,469,680.77	1,928,702,342.23	6,247,399.26	1,126,627,882.51	2,576,441.99	535,793,851.23
本期利润	5,469,680.77	1,928,702,342.23	6,247,399.26	1,126,627,882.51	2,576,441.99	535,793,851.23
本期基金份额净值收益率	3.8365%	4.0853%	3.2795%	3.5266%	2.7042%	2.9506%
3.1.2期末数据和指标	2014年末		2013年末		2012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	209,186,468.29	67,181,852,944.35	193,891,858.99	35,275,076,435.55	98,075,400.17	21,892,735,573.91
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	0.9513%	0.0020%	0.3403%	0.0000%	0.6110%	0.0020%
过去六个月	1.8951%	0.0016%	0.6805%	0.0000%	1.2146%	0.0016%
过去一年	3.8365%	0.0019%	1.3500%	0.0000%	2.4865%	0.0019%
过去三年	10.1413%	0.0021%	4.1178%	0.0001%	6.0235%	0.0020%
过去五年	14.3464%	0.0028%	6.9275%	0.0002%	7.4189%	0.0026%
自基金成立起至今	24.8725%	0.0039%	16.0504%	0.0015%	8.8221%	0.0024%

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	1.0119%	0.0020%	0.3403%	0.0000%	0.6716%	0.0020%
过去六个月	2.0177%	0.0016%	0.6805%	0.0000%	1.3372%	0.0016%
过去一年	4.0853%	0.0019%	1.3500%	0.0000%	2.7353%	0.0019%
过去三年	10.9347%	0.0021%	4.1178%	0.0001%	6.8169%	0.0020%
过去五年	15.7241%	0.0028%	6.9275%	0.0002%	8.7966%	0.0026%
自基金成立起至今	27.8149%	0.0039%	16.0504%	0.0015%	11.7645%	0.0024%

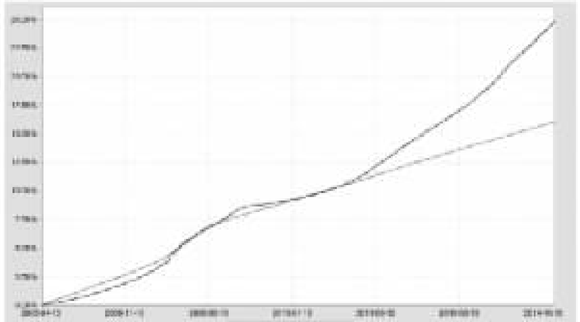
注:本基金合同生效日为2005年4月13日。

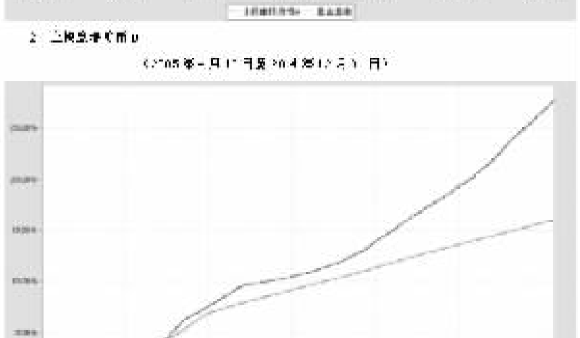
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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2014年12月31日)

1、上投摩根货币A

(2005年4月13日至2014年12月31日)





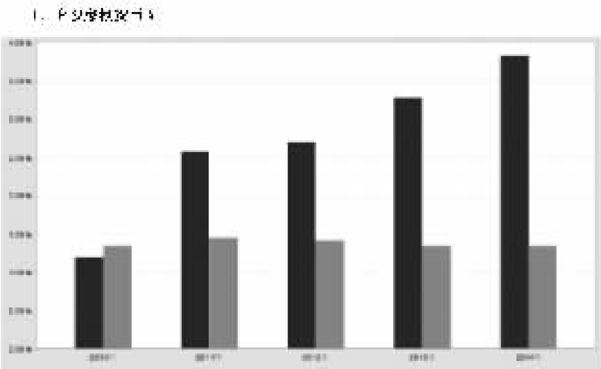
注:按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效日起不超过三个月内完成建仓。截止2005年07月13日,本基金已根据基金合同完成建仓且资产配置比例符合本基金基金合同规定。

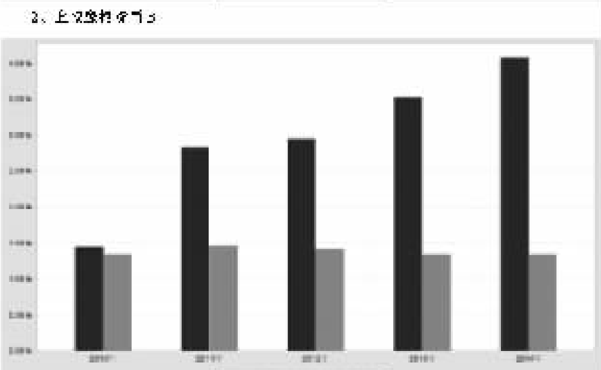
本基金合同生效日为2005年04月13日。图示时间段为2005年04月13日至2014年12月31日。

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





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2014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
2014年	4,841,360.72	726,872.63	-98,552.58	5,469,680.77	-
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	-
合计	12,281,250.31	1,898,505.37	113,766.34	14,293,522.02	-

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
2014年	1,853,459,678.90	58,565,971.24	16,676,692.09	1,928,702,342.23	-
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	-
合计	3,428,073,164.83	116,910,560.43	46,140,350.71	3,591,124,075.97	-

§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2014年12月底,公司管理的基金共有三十七只,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、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、上投摩根现金管理货币市场基金、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和上投摩根纯债添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	-	12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月至2014年9月任上投摩根纯债债券型证券投资基金基金经理,自2014年6月起任上投摩根优信增利债券型证券投资基金基金经理,自2014年8月起同时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。
孟晨波	本基金基金经理、固定收益部总监	2009-09-17	-	20年	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,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,自2014年8月起同时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。
鞠婷	本基金基金经理助理	2014-12-2		9年	墨尔本皇家理工大学硕士,1997年7月至2001年5月在中国建设银行上海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(中国)股份有限公司总行担任总经理助理,负责资金部资金管理;2014年10月加入上投摩根基金管理有限公司。
唐瑭	本基金基金经理助理	2012-08-29		7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。

3. 因工作需要,唐瑭自2015年1月16日起不再担任上投摩根货币市场基金的基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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进行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: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

回顾2014年,宏观经济增长低位运行,下滑压力明显,全年GDP增长7.4%创出24年新低,全年通胀水平2.0%。M2增速同比增长12.2%低于年初确定的13%的目标0.8个百分点。2014年社会融资规模为16.46万亿元,比上年减少8598亿元。针对2014年中国经济所处的转型"新常态",央行货币政策也随之有所调整,相比原来的降息降准等传统的宏观调控手段,更多地灵活使用SLO、MLF、PSL等各种货币政策工具,以及调整新的统计口径,根据经济运行情况运用多种货币政策工具进行预调微调。

纵观全年,央行采取多种货币政策保持市场流动性总量合理充裕,引导整个市场利率中枢下移,特别是7、9月下调正回购利率,以及11月宣布降息,均释放引导资金利率下降信号。受此影响债券收益率一路下探,呈现牛市态势。以一年国开行政策性金融债为例,全年最高收益率5.5%出现在1月初,最低收益率探至11月中的3.52%,年末收至3.95%位置。十年国开债也从年初5.92%的最高位一路下行至年末4.0%的位置。

上投货币基金在2014年延续一贯谨慎稳健的投资风格,始终把流动性管理和资金安全放在首位,同时把握资金投资机会在年初适度增加债券资产配置,锁定较高到期收益率,年中结合客户现金流预判,提前布局流动性管理,合理错配存款的到期日,年末在债券市场收益率快速下降中,抓住IPO开启机会加大交易所逆回购交易量,增加协议存款配置比率,提高组合收益率,始终保持基金组合较高的流动性,增强组合的抗风险能力,择时择机优化组合资产配置。

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3.8365%和4.0853%,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2015年,在中国经济增速由高速转向中高速、外延扩张转向内涵增长的新常态背景下,央行的货币政策或将继续保持宏观层面的连续性和稳定性,银行间资金面或仍保持中性偏松水平。本基金将继续保持谨慎稳健的投资风格,规范运作,勤勉尽责,不辜负基金份额持有人的每一份投资和每一份信任。为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

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个工作日),收益分配采用红利再投资方式,按月结转份额。2014年本基金A类收益分配金额为5,469,680.77元,B类收益分配金额为1,928,702,342.23元。

4.8 基金持有人数或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5,469,680.77元,B类1,928,702,342.23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2014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(2015)第20487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:2014年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	21,818,488,498.90	12,162,301,671.89
结算备付金		618,081,999.90	485,476,190.39
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	10,960,402,802.79	3,915,411,159.48
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		10,960,402,802.79	3,915,411,159.48
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	35,070,400,000.00	21,252,200,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	373,968,233.90	148,756,222.30
应收股利		-	-
应收申购款		159,078,842.39	5,267,661.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		69,000,420,377.88	37,969,412,905.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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		1,525,949,242.11	2,443,970,778.02
应付赎回款		4,766,747.91	4,292,976.54
应付管理人报酬		18,009,488.25	10,575,254.61
应付托管费		5,457,420.66	3,204,622.58
应付销售服务费		582,216.32	358,440.36
应付交易费用	7.4.7.7	10,500.00	15,328.35
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		54,201,349.99	37,623,210.48
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		1,609,380,965.24	2,500,444,610.94
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	67,391,039,412.64	35,468,968,294.54
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		67,391,039,412.64	35,468,968,294.54
负债和所有者权益总计		69,000,420,377.88	37,969,412,905.48

注:报告截止日2014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67,391,039,412.64份,其中A类基金份额209,186,468.29份,B类基金份额67,181,852,944.35份。

7.2 利润表

会计主体:上投摩根货币市场基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入		2,148,193,446.92	1,274,754,282.43
1.利息收入		2,147,951,320.11	1,290,050,776.25
其中:存款利息收入	7.4.7.11	643,030,195.47	285,618,579.53
债券利息收入		335,444,303.50	271,356,762.57
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,169,476,821.14	733,075,434.15
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		242,126.81	-15,296,493.82
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	242,126.81	-15,296,493.82
资产支持证券投资收益		-	-
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		214,021,423.92	141,879,000.66
1.管理人报酬		159,898,903.64	105,717,213.12
2.托管费		48,454,213.32	32,035,519.05
3.销售服务费		5,189,497.37	3,654,282.32
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	478,809.59	471,686.17
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		1,934,172,023.00	1,132,875,281.77
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列		1,934,172,023.00	1,132,875,281.77

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:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	35,468,968,294.54	-	35,468,968,294.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,934,172,023.00	1,934,172,023.00
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)	31,922,071,118.10	-	31,922,071,118.10
其中:1.基金申购款	263,890,988,853.53	-	263,890,988,853.53
2.基金赎回款	-231,968,917,735.43	-	-231,968,917,735.43
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)	-	-1,934,172,023.00	-1,934,172,023.00
五、期末所有者权益(基金净值)	67,391,039,412.64	-	67,391,039,412.64
项目	上年度可比期间 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

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署;

基金管理人负责人: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2015年3月25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2014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2014年12月31日的财务状况以及2014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

7.4.4.1 本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期内,财政部颁布了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》等准则,并要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。本基金根据要求执行上述企业会计准则,执行上述准则对基金财务报表无影响。

7.4.4.2 本报告期所采用的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

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	159,898,903.64	105,717,213.12
其中:支付销售机构的客户维护费	227,340.08	112,789.87

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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	48,454,213.32	32,035,519.05

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 2014年1月1日至2014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	212,346.93	4,799,115.21	5,011,462.14
中国建设银行	86,625.69	2,520.18	89,145.87
合计	298,972.62	4,801,635.39	5,100,608.01
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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 2014年1月1日至2014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	263,273,018.77	200,490,912.33	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 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	-	-	-	-

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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	4,018,488,498.90	33,912,148.96	2,562,301,671.89	3,951,944.19

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(2014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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2014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次的余额为10,960,402,802.79元,无属于第一或第三层次的余额(2013年12月31日:第二层次3,915,411,159.48元,无属于第一或第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日:同)。

(d) 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。

§8(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。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	10,960,402,802.79	15.88
	其中:债券	10,960,402,802.79	15.88
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	35,070,400,000.00	50.83
	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	22,436,570,498.80	32.52
4	其他各项资产	533,047,076.29	0.77
	合计	69,000,420,377.88	100.00

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	43
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	61
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

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	65.67	2.26
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	5.98	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	18.10	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	7.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	4.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	101.60	2.26

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	9,410,940,658.03	13.96
	其中:政策性金融债	9,410,940,658.03	13.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,549,462,144.76	2.30
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	10,960,402,802.79	16.26
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	140204	14国开04	10,000,000	1,000,037,230.46	1.48
2	140218	14国开18	7,500,000	749,482,068.39	1.11
3	140213	14国开13	7,000,000	699,894,500.78	1.04
4	140436	14农发36	6,600,000	659,823,171.63	0.98
5	140410	14农发10	6,500,000	650,098,858.15	0.96
6	140437	14农发37	6,500,000	649,777,547.77	0.96
7	041452012	14铁道CP001	6,000,000	599,875,036.64	0.89
8	140320	14进出20	5,500,000	550,377,371.53	0.82
9	140444	14农发44	5,300,000	531,225,632.38	0.79
10	140207	14国开07	5,200,000	519,932,105.72	0.77

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	0.0823%
报告期内偏离度的最低值	-0.0397%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0317%

8.8 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

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	373,968,233.90
4	应收申购款	159,078,842.39
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	533,047,076.29

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
上投摩根货币A	6,258	33,427.05	14,564,341.72	6.96%	194,622,126.57	93.04%
上投摩根货币B	270	248,821,677.57	67,048,523,863.28	99.80%	133,329,081.07	0.20%
合计	6,528	10,323,382.26	67,063,088,205.00	99.51%	327,951,207.64	0.49%

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	585,597.77	0.2799%
	上投摩根货币B	-	-
	合计	585,597.77	0.0009%

9.3 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
	上投摩根货币B	0
	合计	0
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

§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	193,891,858.99	35,275,076,435.55
本报告期基金总申购份额	37,418,422,605.95	226,472,566,247.58
减:本报告期基金总赎回份额	37,403,127,996.65	194,565,789,738.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	209,186,468.29	67,181,852,944.35

§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:

本公司于2014年4月9日发布公告:因工作需要,胡志强先生自2014年4月3日起不再担任本公司副总经理。

基金托管人:

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人2014年11月03日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

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153,000.00元,目前的审计机构已提供审计服务的连续年限为10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。

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。

3.2014年度本基金无新增席位、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		其它交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
申银万国	-	-	1,430,708,100,000.00	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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
二〇一五年三月二十六日