

# 信息披露 Disclosure

## 上投摩根货币市场基金

### 2013 年度报告摘要

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	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
一、收入		1,274,754,282.43	620,943,187.54
1.利息收入		1,280,650,776.26	612,461,424.41
其中:存款利息收入	7.4.7.1	285,618,579.53	40,400,756.62
债券利息收入		271,356,762.57	253,052,777.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		723,075,434.15	318,027,889.83
2.投资收益		-	-
其中:股票投资收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.1.2	-15,266,493.82	8,461,786.13
其中:固定收益投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.1.3	-15,266,493.82	8,461,786.13
资产支持证券投资损益		-	-
基金投资收益合计	7.4.7.1.4	-	-
衍生工具收益	7.4.7.1.5	-	-
股利收益	7.4.7.1.6	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.1.6	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.1.7	-	-
减:二、费用		141,879,000.66	82,672,894.32
1.管理人报酬		105,717,213.12	61,411,062.39
2.托管费		32,035,530.95	16,609,412.87
3.销售服务费		3,664,256.52	2,992,510.79
4.交易费用	7.4.7.1.8	300.00	-
5.利息支出		-	-
其中:应付短期融资券支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.1.9	471,686.17	469,908.27
7.利息结转(净额以“-”号填列)		1,132,875,281.77	538,370,263.22
三、利润总额		1,132,875,281.77	538,370,263.22
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,132,875,281.77	538,370,263.22

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

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(本期净收益)	-	1,132,875,281.77	1,132,875,281.77
三、本期公允价值变动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	166,008,400,008.96	-	166,008,400,008.96
2.基金赎回款	-152,530,242,688.40	-	-152,530,242,688.40
四、本期公允价值变动产生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	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年1月1日至2011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)	14,235,046,214.51	-	14,235,046,214.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益)	-	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(本期申购、赎回)	7,755,765,759.77	-	7,755,765,759.77
四、本期基金申购款	90,026,064,739.97	-	90,026,064,739.97
五、本期基金赎回款	-83,170,288,979.20	-	-83,170,288,979.20
六、本期基金份额持有分配利润产生的基金净值变动(净值减少)(—/+ 号填列)	-	-538,370,293.22	-538,370,293.22

本报告期末所有者权益合计占基金资产净值的比例(%)

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	固定收益投资	3,915,411,159.48	10.31
2	其中:债券	3,915,411,159.48	10.31
3	资产支持证券	-	-
4	买入返售金融资产	21,262,200,000.00	59.67
5	其中:买入返售金融资产	21,262,200,000.00	59.67
6	银行存款和到期兑付资产	12,647,777,862.28	33.31
7	其他金融资产	154,023,883.72	0.41
8	合计	37,490,416,966.48	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

项目	占基金资产净值比例(%)
报告期末债券回购融资余额	20
报告期内债券回购融资余额最高值	20

8.3债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况  
在本报告期内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	70
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	20

8.5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。

8.6.2期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.3期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.4期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.5期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.6期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.7期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.8期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.9期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.10期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.11期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.12期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.13期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.14期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.15期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.16期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.17期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.18期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.19期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.20期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.21期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.22期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.23期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.24期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.25期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.26期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	100.62

8.6.27期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.04
2	30天以上-60天	5.64
3	60天以上-90天	11.42
4	90天以上-180天	4.67
5	180天以上-397天(含)	2.84
6	合计	