

信息披露

上投摩根货币市场基金

2014年度报告摘要

长动力混合型证券投资基金、上证180高贝塔交易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、上投摩根民生需求主题型证券投资基金、上投摩根优债信用债券型证券投资基金、上投摩根现金管理货币市场基金、上投摩根纯债季利债券型证券投资基金、上投摩根添添盈货币市场基金、上投摩根天添添货币市场基金和上投摩根德盛利源债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理助理)的简介

姓名	职务	任本基金基金经理(或管理)期限	证券从业年限	说明
王亚南	本基金基金经理	2008-11-29	-	12年
孟庆斌	本基金基金经理、固定收益部副总监	2009-09-17	-	20年
曹博	本基金基金经理助理	2014-12-2	-	9年
曹博	本基金基金经理助理	2012-08-29	-	7年

注:1.截至报告期末任(或任期)期间根据基金合同约定确定的聘任日期和聘任期限。
2.证券投资基金的基金经理由行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。
3.因工作需要,唐蔚自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,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合同》的规定,基金管理人对于本报告投资行为的合规性进行了投资决策委员会的授权控制,基金资产比例符合基金合同法律法规的要求。

4.3管理人对报告期内基金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
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《上投摩根货币市场基金公平交易制度》,规范了公司管理的所有投资组合的授权控制,确保投资组合的公平交易,并建立了投资管理制度,同时配备了授权、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、基金经理。基金经理在其授权范围内自主决策,投资决策委员会和投资总监不得干预基金经理范围内的投资活动。公司已建立完善的研究报告,严格执行内幕信息为公平交易制度,各投资组合享有公平的投资决策机会。公司在执行公平交易制度时,严格执行公平交易制度,对于交易所市场交易,实行集中交易,按照时间优先、比例分配的原则,严格执行投资合同公平分配交易机制;对于银行间市场交易,通过交易对手库和询价交易和室询价机制,严格执行交易对手库和询价交易价格公允;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,根据申购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了投资交易行为的监控分析,并执行异常交易的监控分析记录工作机制,确保公平交易可稽核。公司对于异常交易行为能够对公司管理的不同投资组合的收益差异及不同时间间隔下不同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交易方法,开展公平交易,通过对不同投资组合之间的收益差异分析,以及不同投资组合之间双向交易和反向交易的时间间隔和交易价差的分析,公司未发现异常公平交易行为出现异常的情况。

其中,在双向交易的监控分析方面,根据投资策略,公司对不同投资组合的同一时点附近交易的方向同向交易行为进行监控,通过对双向交易的方向同向交易行为,定性分析交易行为,对比不同投资组合的长期交易趋势,重点关注任何可能损害不公平交易的情况,对于异常的异常情况,由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理说明。同时,公司根据法规的要求,通过事后监控对连续两个季度内不同投资组合在不同时间间隔(日、3日、5日)内双向交易价差进行分析,采取概率统计方法,重点关注不同投资组合在不同时间间隔的均值和方差,以及双向交易的方向同向交易行为。

报告期内,通过对前述分析发现,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0.5%的情况,未发现异常交易行为。

4.4管理人对报告期内基金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业绩分析
回顾2014年度,宏观经济保持低位运行,下压力明显,全年GDP增长7.4%创出24年新低,全年通胀率2.0%,M2增速同比增长12.2%低于年初预期的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8808亿元。针对2014年中国GDP的下降,“新常态”下,央行货币政策也趋于有所调整,相比以往的稳健货币政策有所调整,更多考虑使用信贷、MLF、PSL等各种结构性货币政策工具,以及调整新的信贷工具,根据经济运行情况运用各种货币政策工具进行宏观调控。

报告期内,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9月下调公开市场利率,以及11月宣布降息,均导致市场利率下降,受此影响货币基金收益率一路下降,呈现市场走势,以一年期银行定期存款利率为例,全年最高收益率5.5%出现在1月初,最低收益率降至11月中的0.35%,年末收至0.35%的位置,十年期国债也从年初5.2%的最高位一路下移至年末4.0%的位置。

上投货币市场基金在2014年度一贯谨慎稳健的投资风格,始终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,前次较高短期收益率,年中抓住公开市场资金流,同时把握流动性管理,合理配置资产的到期日,年末在债券市场收益率下降中,抓住IPO开闸资金加大交易并适度增加交易,增加流动性资产配置比例,提高组合收益率,最终保持基金组合较高的流动性,增强组合抗风险能力,保持组合资产保值增值。

4.4.2报告期内基金业绩表现
本报告期末本基金A类和B类净值收益率分别为3.836%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
报告期内,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、托管协议及其他相关法规,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。

6.2管理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、托管协议及其他有关规定,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,对本基金的运作进行了监督,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,本基金实际利率的净收益率为A类5.469,680.77元,B类1,929,702,342.23元。
6.3持有人对本年度投资中基金净值等内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人复核了本报告期内基金净值、净值计算、净值分配情况,财务会计报告、投资组合报告等内容,经复核认为不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

6.4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,注册会计师王灵堂出具了“无保留意见的审计报告”(编号:普华永道中天审字[2015]第020487号)。
投资者可通过登录于本基金管理人网站(www.siccfund.com)查看审计报告全文。

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

资产	附注号	2014年12月31日	2013年12月31日
货币存款	7.4.1	21,818,498.90	12,162,301,671.89
结算备付金	6	61,081,999.90	485,476,190.39
存出保证金	-	-	-
应收款项资产	7.4.2	10,960,482,829.79	3,915,411,159.48
买入返售金融资产	-	-	-
债券投资	-	-	-
资产支持证券投资	-	-	-
银行存款	7.4.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.3	35,070,400,000.00	21,252,200,000.00
应收利息	7.4.5	373,820,233.90	148,756,222.30
应收股利	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产总计	7.4.6	69,000,430,377.88	37,969,412,065.48
负债和所有者权益	附注号	2014年12月31日	2013年12月31日
负债合计	7.4.7.8	404,000.00	404,000.00
所有者权益	-	-	-
实收资本	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	-	69,000,430,377.88	37,969,412,065.48

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687,391,039,412.64份,其中A类基金份额209,186,468.29份,B类基金份额687,181,652,944.35份。

7.2利润表
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

资产	附注号	2014年12月31日	2013年12月31日
货币存款	7.4.1	21,818,498.90	12,162,301,671.89
结算备付金	6	61,081,999.90	485,476,190.39
存出保证金	-	-	-
应收款项资产	7.4.2	10,960,482,829.79	3,915,411,159.48
买入返售金融资产	-	-	-
债券投资	-	-	-
资产支持证券投资	-	-	-
银行存款	7.4.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.3	35,070,400,000.00	21,252,200,000.00
应收利息	7.4.5	373,820,233.90	148,756,222.30
应收股利	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产总计	7.4.6	69,000,430,377.88	37,969,412,065.48
负债和所有者权益	附注号	2014年12月31日	2013年12月31日
负债合计	7.4.7.8	404,000.00	404,000.00
所有者权益	-	-	-
实收资本	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	-	69,000,430,377.88	37,969,412,065.48

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687,391,039,412.64份,其中A类基金份额209,186,468.29份,B类基金份额687,181,652,944.35份。

7.3所有者权益变动表
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

资产	附注号	2014年12月31日	2013年12月31日
货币存款	7.4.1	21,818,498.90	12,162,301,671.89
结算备付金	6	61,081,999.90	485,476,190.39
存出保证金	-	-	-
应收款项资产	7.4.2	10,960,482,829.79	3,915,411,159.48
买入返售金融资产	-	-	-
债券投资	-	-	-
资产支持证券投资	-	-	-
银行存款	7.4.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.3	35,070,400,000.00	21,252,200,000.00
应收利息	7.4.5	373,820,233.90	148,756,222.30
应收股利	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产总计	7.4.6	69,000,430,377.88	37,969,412,065.48
负债和所有者权益	附注号	2014年12月31日	2013年12月31日
负债合计	7.4.7.8	404,000.00	404,000.00
所有者权益	-	-	-
实收资本	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	-	69,000,430,377.88	37,969,412,065.48

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687,391,039,412.64份,其中A类基金份额209,186,468.29份,B类基金份额687,181,652,944.35份。

7.4所有者权益变动表
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

资产	附注号	2014年12月31日	2013年12月31日
货币存款	7.4.1	21,818,498.90	12,162,301,671.89
结算备付金	6	61,081,999.90	485,476,190.39
存出保证金	-	-	-
应收款项资产	7.4.2	10,960,482,829.79	3,915,411,159.48
买入返售金融资产	-	-	-
债券投资	-	-	-
资产支持证券投资	-	-	-
银行存款	7.4.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.3	35,070,400,000.00	21,252,200,000.00
应收利息	7.4.5	373,820,233.90	148,756,222.30
应收股利	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产总计	7.4.6	69,000,430,377.88	37,969,412,065.48
负债和所有者权益	附注号	2014年12月31日	2013年12月31日
负债合计	7.4.7.8	404,000.00	404,000.00
所有者权益	-	-	-
实收资本	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	-	69,000,430,377.88	37,969,412,065.48

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687,391,039,412.64份,其中A类基金份额209,186,468.29份,B类基金份额687,181,652,944.35份。

7.5所有者权益变动表
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

资产	附注号	2014年12月31日	2013年12月31日
货币存款	7.4.1	21,818,498.90	12,162,301,671.89
结算备付金	6	61,081,999.90	485,476,190.39
存出保证金	-	-	-
应收款项资产	7.4.2	10,960,482,829.79	3,915,411,159.48
买入返售金融资产	-	-	-
债券投资	-	-	-
资产支持证券投资	-	-	-
银行存款	7.4.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.3	35,070,400,000.00	21,252,200,000.00
应收利息	7.4.5	373,820,233.90	148,756,222.30
应收股利	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产总计	7.4.6	69,000,430,377.88	37,969,412,065.48
负债和所有者权益	附注号	2014年12月31日	2013年12月31日
负债合计	7.4.7.8	404,000.00	404,000.00
所有者权益	-	-	-
实收资本	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	-	69,000,430,377.88	37,969,412,065.48

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687,391,039,412.64份,其中A类基金份额209,186,468.29份,B类基金份额687,181,652,944.35份。

7.6所有者权益变动表
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

资产	附注号	2014年12月31日	2013年12月31日
货币存款	7.4.1	21,818,498.90	12,162,301,671.89
结算备付金	6	61,081,999.90	485,476,190.39
存出保证金	-	-	-
应收款项资产	7.4.2	10,960,482,829.79	3,915,411,159.48
买入返售金融资产	-	-	-
债券投资	-	-	-
资产支持证券投资	-	-	-
银行存款	7.4.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.3	35,070,400,000.00	21,252,200,000.00
应收利息	7.4.5	373,820,233.90	148,756,222.30
应收股利	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产总计	7.4.6	69,000,430,377.88	37,969,412,065.48
负债和所有者权益	附注号	2014年12月31日	2013年12月31日
负债合计	7.4.7.8	404,000.00	404,000.00
所有者权益	-	-	-
实收资本	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	-	69,000,430,377.88	37,969,412,065.48

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687,391,039,412.64份,其中A类基金份额209,186,468.29份,B类基金份额687,181,652,944.35份。

7.7所有者权益变动表
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

资产	附注号	2014年12月31日	2013年12月31日
货币存款	7.4.1	21,818,498.90	12,162,301,671.89
结算备付金	6	61,081,999.90	485,476,190.39
存出保证金	-	-	-
应收款项资产	7.4.2	10,960,482,829.79	3,915,411,159.48
买入返售金融资产	-	-	-
债券投资	-	-	-
资产支持证券投资	-	-	-
银行存款	7.4.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.3	35,070,400,000.00	21,252,200,000.00
应收利息	7.4.5	373,820,233.90	148,756,222.30
应收股利	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产总计	7.4.6	69,000,430,377.88	37,969,412,065.48
负债和所有者权益	附注号	2014年12月31日	2013年12月31日
负债合计	7.4.7.8	404,000.00	404,000.00
所有者权益	-	-	-
实收资本	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	-	69,000,430,377.88	37,969,412,065.48

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687,391,039,412.64份,其中A类基金份额209,186,468.29份,B类基金份额687,181,652,944.35份。

7.8所有者权益变动表
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

资产	附注号	2014年12月31日	2013年12月31日
货币存款	7.4.1	21,818,498.90	12,162,301,671.89
结算备付金	6	61,081,999.90	485,476,190.39
存出保证金	-	-	-
应收款项资产	7.4.2	10,960,482,829.79	3,915,411,159.48
买入返售金融资产	-	-	-
债券投资	-	-	-
资产支持证券投资	-	-	-
银行存款	7.4.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.3	35,070,400,000.00	21,252,200,000.00
应收利息	7.4.5	373,820,233.90	148,756,222.30
应收股利	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产总计	7.4.6	69,000,430,377.88	37,969,412,065.48