

上投摩根现金管理货币市场基金
2015 年年度报告摘要
2015 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：二〇一六年三月三十日

§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 2016 年 3 月 29 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 2015 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	上投摩根现金管理货币
基金主代码	000685
交易代码	000685
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 8 月 19 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	362,272,484.74 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金根据宏观经济运行状况、货币政策、信用状况、利率水平和市场预期、资金供求变化等的综合分析，并结合各类资产的估值水平、流动性特征、风险收益特征，决定各类资产的配置比例，并适时进行动态调整。</p> <p>2、久期管理策略</p> <p>本基金将深入分析国家货币政策、短期资金市场利率波动、资本市场资金面的情况和流动性的变化，形成对未来短期利率走势的研判，结合基金资产流动性的要求动态调整组合久期。</p> <p>3、类属配置策略</p> <p>本基金将通过对各类短期金融工具的市场规模、交易活跃程度、收益率水平、供求关系、流动性等因素的研究分析，决定各类资产的配置比例；再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。</p>

	<p>4、个券选择策略</p> <p>在具体的券种选择上，本基金将在考虑安全性因素的前提下，积极发掘价格被低估的且符合流动性要求的投资品种。</p> <p>5、流动性管理策略</p> <p>根据对市场资金面以及本基金申购赎回的动态预测，通过所投资债券品种的期限结构和债券回购的滚动操作，动态调整并有效分配本基金的现金流。</p>
业绩比较基准	活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

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	2015 年	2014 年 8 月 19 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月
---------------	--------	---------------------------------------

		31 日
本期已实现收益	10,624,415.13	5,150,231.52
本期利润	10,624,415.13	5,150,231.52
本期净值收益率	2.1761%	1.2764%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末基金资产净值	362,272,484.74	1,235,260,248.05
期末基金份额净值	1.000	1.000

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

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.4307%	0.0003%	0.0894%	0.0000%	0.3413%	0.0003%
过去六个月	0.8281%	0.0004%	0.1789%	0.0000%	0.6492%	0.0004%
过去一年	2.1761%	0.0021%	0.3549%	0.0000%	1.8212%	0.0021%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	3.4800%	0.0028%	0.4861%	0.0000%	2.9939%	0.0028%

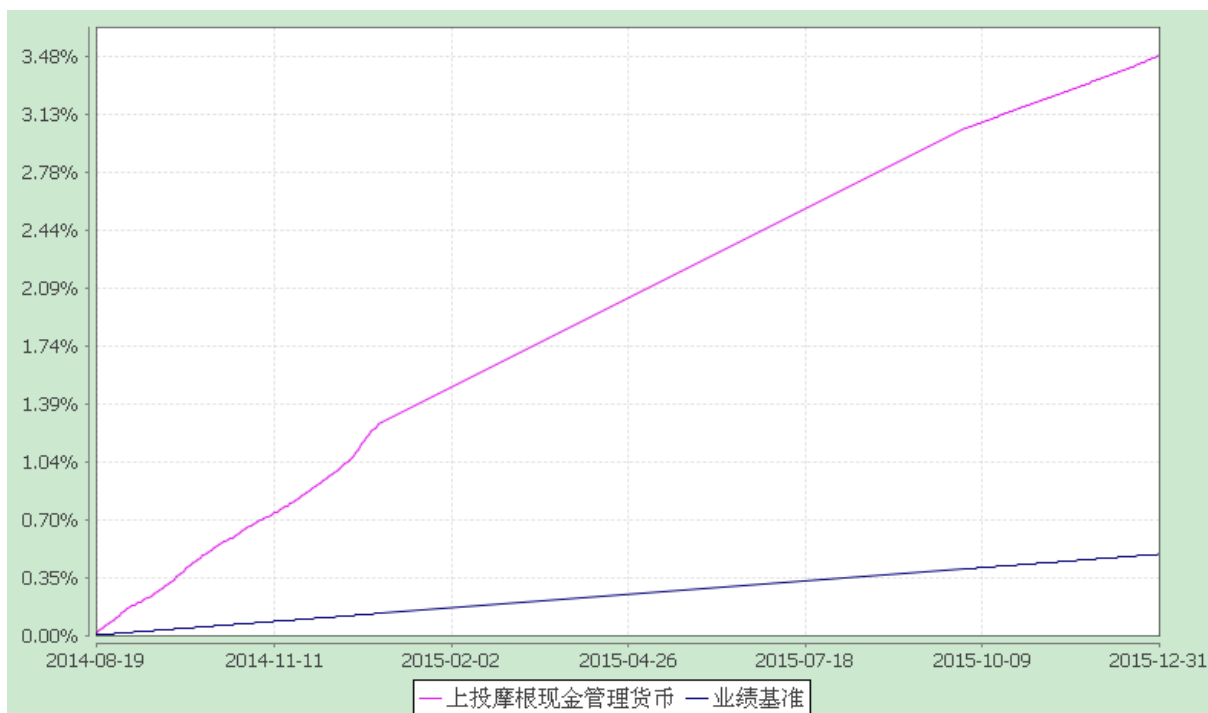
注：本基金合同生效日为 2014 年 8 月 19 日。

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

上投摩根现金管理货币市场基金

自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014 年 8 月 19 日至 2015 年 12 月 31 日)

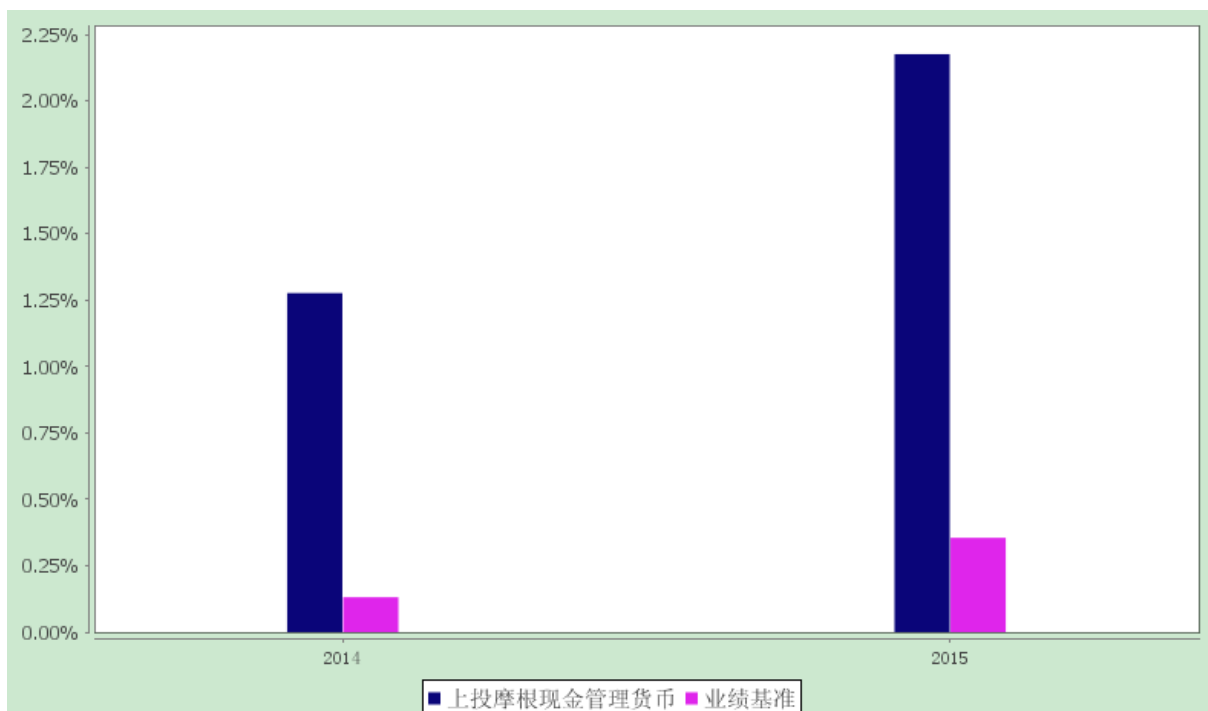


注：本基金建仓期自 2014 年 8 月 19 日至 2015 年 2 月 18 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。本基金合同生效日为 2014 年 8 月 19 日，图示时间段为 2014 年 8 月 19 日至 2015 年 12 月 31 日。

3.2.3 自基金合同生效以来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

上投摩根现金管理货币市场基金

自基金合同生效以来基金净值收益率与业绩比较基准收益率的对比图



注：1. 本基金合同生效日为 2014 年 8 月 19 日。

2. 合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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
2015 年	10,715,687.85	592,060.32	-683,333.04	10,624,415.13	-
2014 年	3,937,433.24	413,069.40	799,728.88	5,150,231.52	-
合计	14,653,121.09	1,005,129.72	116,395.84	15,774,646.65	-

§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 2015 年 12 月底，公司管理的基金共有四十七只，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、上投摩根轮动添利债券型证券投资基金、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、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和上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金。

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	2014-08-19	-	7 年（金融领域从业经验 21 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。
王亚南	本基金基金经理	2014-08-19	2015-12-11	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 月至 2015 年 12 月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 月至 2015 年 12 月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 月至 2015 年 12 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 月至 2015 年 12 月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	2015-07-09	-	2 年	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，担任我公司货币市场投资部基金经理助理一职，自 2015 年 7 月起担任上投摩根现金管理货币市场基金基金经理。
鞠婷	本基金基金经理助理	2014-12-2	2015-7-9	2 年	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，担任我公司货币市场投资部基金经理助理一职，自 2015 年 7 月起担任上投摩根现金管理货币市场基金基金经理。
王化鑫	本基金基金经理助理	2015-2-13	-	8 年	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
郭毅	本基金基金经理助理	2015-11-5	-	5 年	上海财经大学企业管理硕士，2008 年 7 月至 2010 年 2 月在德勤会计事务所担任审计员，2010 年 3 月至 2014 年 9 月先后在上海钢联电子商务有限公司和兴业证券股份有限公司担任行业研究员，2014 年 10 月加入上投摩根基金管理有限公司，任研究员。

- 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. 王亚南先生、孟晨波女士为本基金首任基金经理，其任职日期指本基金基金合同生效之日。
3. 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、《上投摩根现金管理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。

本报告期内中国证监会上海监管局对公司进行了常规全面现场检查，就公司内部控制提出了相应改进意见并采取责令改正的行政监管措施，公司已经按照要求完成了改进工作。

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：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% 的次数为两次，均发生在纯量化投资组合与主动管理投资组合之间。

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2015年，宏观经济延续疲弱态势，处于底部徘徊阶段。全年GDP增长6.9%创出25年新低，全年通胀水平1.4%。全年进出口总额24.58万亿元，比上年下降7.0%。12月末，广义货币（M2）余额139.23万亿元，比上年末增长13.3%。全年社会融资规模增量为15.41万亿元。

2015年，在国内经济增速下行压力不减以及国外美联储加息外汇占款外流影响下，央行不断通过降息、降准，下调7天回购利率等措施，释放出鼓励资金利率维持低位以降低实体经济融资利率的正面态度。同时提出了财政政策、房地产、投资等多方面措施来实现稳增长的宏观目标。受此影响债券收益率一路下探，呈现牛市态势。以一年期国开行政策性金融债为例，全年最高收益率3.98%出现在1月初，最低收益率探至12月末的2.4%。十年期国开债到期收益率也从年初4.08%的最高位一路

下行至年末3.13%的位置。

现金管理基金在 2015 年延续稳健谨慎的投资运作。由于基金本身 T+0 赎回的特点，在日常投资结构中结合客户结构情况调整现金比例。同时根据市场情况合理配置债券、协议存款以及逆回购等资产。力求在满足客户的流动性需求的前提下，保持一定的收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值收益率为和 2.1761%，同期业绩比较基准收益率为 0.3549%。

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 2016 年，去库存、去产能以及维持人民币汇率稳定将是宏观经济的主要目标。未来货币政策或重在配合中国经济结构调整，降准降息空间收窄，同时结合财政、财税等多方面政策实现改革的宏观目标。本基金在新的一年里将继续保持谨慎稳健的投资风格，时刻把资金安全和流动性管理放在首位。牢牢遵守货币基金的监管要求。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。

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。2015 年本基金收益分配金额为 10,624,415.13 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

报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金持有人数不足 200 人的情况，出现该情况的时间范围为 2015 年 7 月 20 日至 2015 年 10 月 9 日。

§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，本基金实施利润分配的金额为 10,624,415.13 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

上投摩根现金管理货币市场基金 2015 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所有限公司审计、注册会计师陈玲、曹阳签字出具了“无保留意见的审计报告”（编号：普华永道中天审字(2016)第 21357 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：上投摩根现金管理货币市场基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日

资产：		-	-
银行存款		182,621,124.65	580,501,738.43
结算备付金		1,462,857.14	3,060,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产		110,122,610.32	40,052,302.03
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		110,122,610.32	40,052,302.03
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		87,000,000.00	842,100,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		3,530,369.60	2,327,867.12
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		384,736,961.71	1,468,041,907.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		21,998,018.05	231,567,515.51
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		96,872.35	192,855.06
应付托管费		29,355.25	58,440.97

应付销售服务费		2,935.48	5,844.11
应付交易费用		1,900.00	2,775.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		116,395.84	799,728.88
递延所得税负债		-	-
其他负债		219,000.00	154,500.00
负债合计		22,464,476.97	232,781,659.53
所有者权益：		-	-
实收基金		362,272,484.74	1,235,260,248.05
未分配利润		-	-
所有者权益合计		362,272,484.74	1,235,260,248.05
负债和所有者权益总计		384,736,961.71	1,468,041,907.58

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值为 1.0000 元，基金份额总额 362,272,484.74 份。

7.2 利润表

会计主体：上投摩根现金管理货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 8 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		12,755,071.11	5,888,515.01
1.利息收入		12,758,559.79	5,824,699.43
其中：存款利息收入		5,202,657.88	572,420.59
债券利息收入		2,281,982.41	314,480.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,273,919.50	4,937,798.72

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,488.68	13,585.57
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-3,488.68	13,585.57
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	50,230.01
减：二、费用		2,130,655.98	738,283.49
1. 管理人报酬		1,412,884.61	435,164.70
2. 托管费		428,146.78	131,868.16
3. 销售服务费		42,814.78	13,186.82
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		246,809.81	158,063.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,624,415.13	5,150,231.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,624,415.13	5,150,231.52

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根现金管理货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	1,235,260,248.05	-	1,235,260,248.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,624,415.13	10,624,415.13
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）	-872,987,763.31	-	-872,987,763.31
其中：1.基金申购款	1,440,276,687.85	-	1,440,276,687.85
2.基金赎回款	-2,313,264,451.16	-	-2,313,264,451.16
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）	-	-10,624,415.13	-10,624,415.13
五、期末所有者权益（基金净值）	362,272,484.74	-	362,272,484.74
项目	上年度可比期间		
	2014 年 8 月 19 日（基金合同生效日）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）	627,875,161.59	-	627,875,161.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,150,231.52	5,150,231.52
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）	607,385,086.46	-	607,385,086.46
其中：1.基金申购款	1,309,298,433.24	-	1,309,298,433.24
2.基金赎回款	-701,913,346.78	-	-701,913,346.78

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）	-	-5,150,231.52	-5,150,231.52
五、期末所有者权益（基金净值）	1,235,260,248.05	-	1,235,260,248.05

报表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

上投摩根现金管理货币市场基金(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[2014]第 366 号《关于同意上投摩根现金管理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《上投摩根现金管理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 627,836,510.60 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(2014)第 443 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根现金管理货币市场基金基金合同》于 2014 年 8 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 627,875,161.59 份基金份额，其中认购资金利息折合 38,650.99 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《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根现金管理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、通知存款、短期融资券、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的中期票据、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券以及中国证监会、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：活期存款利率(税后)。

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 2016 年 3 月 28 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(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》、《上投摩根现金管理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、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度的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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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。

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 2015年1月1日至2015年12月	上年度可比期间 2014年8月19日（基金合同生效

	31日	日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,412,884.61	435,164.70
其中：支付销售机构的客户维护费	115.26	-

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 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间 2014年8月19日（基金合同生效 日）至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	428,146.78	131,868.16

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 2015年1月1日至 2015年12月31日	上期 2014年8月19日(基金合 同生效日) 至2014年12月31日
上投摩根基金管理有限公司	42,791.49	13,186.82
合计	42,791.49	13,186.82

注：支付基金销售机构的销售服务费分别按前一日该类基金资产净值 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

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

7.4.8.4.2 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

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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年8月19日（基金合同生效日） 至2014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	72,621,124.65	770,000.22	367,501,738.43	130,948.61

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行约定利率计息。

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（2015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 2015 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 110,122,610.32 元，无属于第一或第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第二层次的余额为 40,052,302.03 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 2015 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。(2014 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。

(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	110,122,610.32	28.62
	其中：债券	110,122,610.32	28.62
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	87,000,000.00	22.61
	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	184,083,981.79	47.85
4	其他各项资产	3,530,369.60	0.92
5	合计	384,736,961.71	100.00

8.2 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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	39
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	50
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	3

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 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 75 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 75 天的情况。

8.3.2 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	69.31	6.07
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	16.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	8.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—180 天	5.53	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	180 天（含）—397 天（含）	5.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		105.23	6.07

8.4 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	110,122,610.32	30.40
	其中：政策性金融债	110,122,610.32	30.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-

8	其他	-	-
9	合计	110,122,610.32	30.40
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.5 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	150202	15 国开 02	200,000.00	20,017,951.53	5.53
2	150301	15 进出 01	200,000.00	20,014,699.61	5.52
3	140311	14 进出 11	100,000.00	10,034,192.00	2.77
4	140305	14 进出 05	100,000.00	10,032,971.63	2.77
5	150307	15 进出 07	100,000.00	10,027,027.23	2.77
6	150403	15 农发 03	100,000.00	10,016,301.41	2.76
7	150411	15 农发 11	100,000.00	10,014,325.00	2.76
8	150215	15 国开 15	100,000.00	9,990,882.02	2.76
9	150222	15 国开 22	100,000.00	9,974,259.89	2.75

8.6 “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	0.0750%
报告期内偏离度的最低值	-0.0062%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0198%

8.7 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。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 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。

8.8.3 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

8.8.4 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	3,530,369.60
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,530,369.60

8.8.5 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

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
197	1,838,946.62	362,067,132.40	99.94%	205,352.34	0.06%

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	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	140,419.91	0.0388%

9.3 期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	持有份额总数（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	0 至 10 万份（含）
本基金基金经理持有本开放式基金	0 至 10 万份（含）

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 8 月 19 日）基金份额总额	627,875,161.59
本报告期期初基金份额总额	1,235,260,248.05
本报告期基金总申购份额	1,440,276,687.85
减：本报告期基金总赎回份额	2,313,264,451.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	362,272,484.74

§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 2015 年 1 月 17 日发布公告：因个人原因，冯刚先生自 2015 年 1 月 15 日起不再担任本公司副总经理。

本公司于 2015 年 12 月 2 日发布公告：因个人原因，陈星德先生自 2015 年 11 月 30 日起不再担任本公司副总经理。

基金托管人：

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

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的报酬为 60,000 元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 2 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	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	-	-	6,904,200,000.00	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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,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. 2015 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	
	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	-	-	6,904,200,000.00	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

二〇一六年三月三十日