上投摩根天添盈货币市场基金

2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十八日

1 重要提示及目录

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。本半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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
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 14
5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15
6 半年度财务会计报告（未经审计） 15
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 17
6.4 报表附注 18
7 投资组合报告 35
7.1 期末基金资产组合情况 35
7.2 债券回购融资情况 36
7.3 基金投资组合平均剩余期限 36
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 37
7.6 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 37
7.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 38
7.8 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 38
7.9 投资组合报告附注 38
8 基金份额持有人信息 39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 39
8.3 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的情况 39

9 开放式基金份额变动 40
10 重大事件揭示 40
10.1 基金份额持有人大会决议 40
10.2 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 40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 40
10.4 基金投资策略的改变 40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 40
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 41
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 42
10.9 其他重大事件 42
11 影响投资者决策的其他重要信息 42
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 43
11 备查文件目录 43
11.1 备查文件目录 43
11.2 存放地点 43
11.3 查阅方式 43

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根天添盈货币市场基金		
基金简称	上投摩根天添盈货币		
基金主代码	000855		
交易代码	000855		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 11 月 25 日		
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	327,969,383.74 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	天添盈货币 A	天添盈货币 B	天添盈货币 E
下属分级基金的交易代码	000855	000856	000857
报告期末下属分级基金的份额总额	1,807,211.43 份	203,669,014.61 份	122,493,157.70 份

2.2 基金产品说明

投资目标	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	本基金将综合考虑各类可投资品种的收益性、流动性及风险性特征，对各类资产进行合理的配置和选择。在保证基金资产的安全性和流动性基础上，力争为投资者创造稳定的投资收益。本基金以短期金融工具作为投资对象，基于对各细分市场的市场规模、交易情况、各交易品种的流动性、相对收益、信用风险以及投资组合平均剩余期限要求等重要指标的分析，确定（调整）投资组合的类别资产配置比例。利率变化是影响债券价格的最重要因素，本基金将通过对国内外宏观经济走势、货币政策和财政政策、市场结构变化和短期资金供给等因素的综合分析，形成对未来货币市场利率变动的预期，并依此确定和调整组合的平均剩余期限。在个券选择层面，本基金将综合考虑安全性、流动性和收益性等因素，通过分析各个金融产品的剩余期限与收益率的配比状况、信用等级、流动性指标等因素进行证券选择，选择风险收益配比最合理的证券作为投资对象。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（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。 本基金风险收益特征会定期评估并在公司网站发布，请投资者关注。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡迪	方韡
	联系电话	021-38794888	4006800000
	电子邮箱	services@cifm.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		400-889-4888	95558
传真		021-20628400	010-85230024
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼20楼	北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼20楼	北京市东城区朝阳门北大街9号
邮政编码		200120	100010
法定代表人		穆矢	李庆萍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》《中国证券报》《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cifm.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上投摩根基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

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	**报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）**		
	天添盈货币 A	天添盈货币 B	天添盈货币 E
本期已实现收益	23,262.41	3,629,448.86	1,969,682.90
本期利润	23,262.41	3,629,448.86	1,969,682.90
本期净值收益率	1.6713%	1.7919%	1.7465%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2017 年 6 月 30 日)**		
	天添盈货币 A	天添盈货币 B	天添盈货币 E
期末基金资产净值	1,807,211.43	203,669,014.61	122,493,157.70
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2017 年 6 月 30 日)**		

	天添盈货币 A	天添盈货币 B	天添盈货币 E
累计净值收益率	6.9537%	7.6300%	7.3794%

注：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。

本基金收益分配按日结转份额。

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．天添盈货币 A：

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
过去一个月	0.3115%	0.0024%	0.1110%	0.0000%	0.2005%	0.0024%
过去三个月	0.8852%	0.0020%	0.3366%	0.0000%	0.5486%	0.0020%
过去六个月	1.6713%	0.0016%	0.6695%	0.0000%	1.0018%	0.0016%
过去一年	2.7430%	0.0028%	1.3500%	0.0000%	1.3930%	0.0028%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.9537%	0.0029%	3.5100%	0.0000%	3.4437%	0.0029%

2．天添盈货币 B：

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
过去一个月	0.3312%	0.0024%	0.1110%	0.0000%	0.2202%	0.0024%
过去三个月	0.9455%	0.0020%	0.3366%	0.0000%	0.6089%	0.0020%
过去六个月	1.7919%	0.0016%	0.6695%	0.0000%	1.1224%	0.0016%
过去一年	2.9910%	0.0028%	1.3500%	0.0000%	1.6410%	0.0028%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	7.6300%	0.0029%	3.5100%	0.0000%	4.1200%	0.0029%

3．天添盈货币 E：

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

过去一个月	0.3238%	0.0024%	0.1110%	0.0000%	0.2128%	0.0024%
过去三个月	0.9229%	0.0020%	0.3366%	0.0000%	0.5863%	0.0020%
过去六个月	1.7465%	0.0016%	0.6695%	0.0000%	1.0770%	0.0016%
过去一年	2.8984%	0.0028%	1.3500%	0.0000%	1.5484%	0.0028%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	7.3794%	0.0029%	3.5100%	0.0000%	3.8694%	0.0029%

注：本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）。

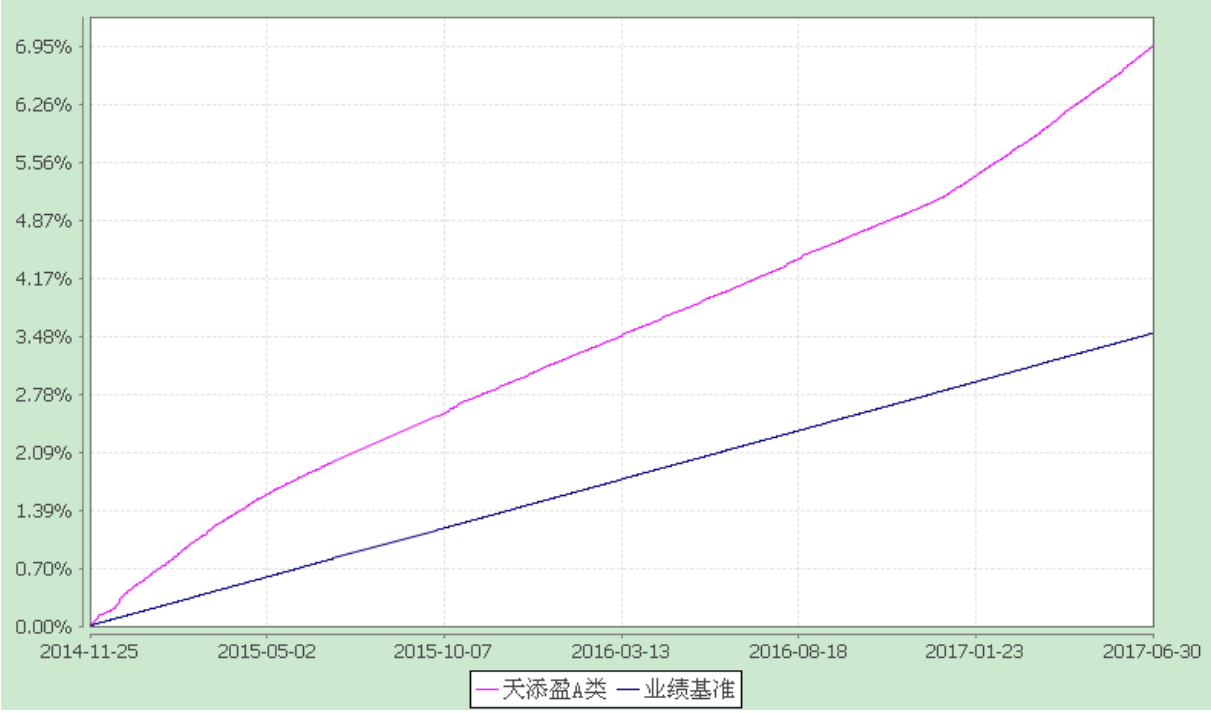
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根天添盈货币市场基金

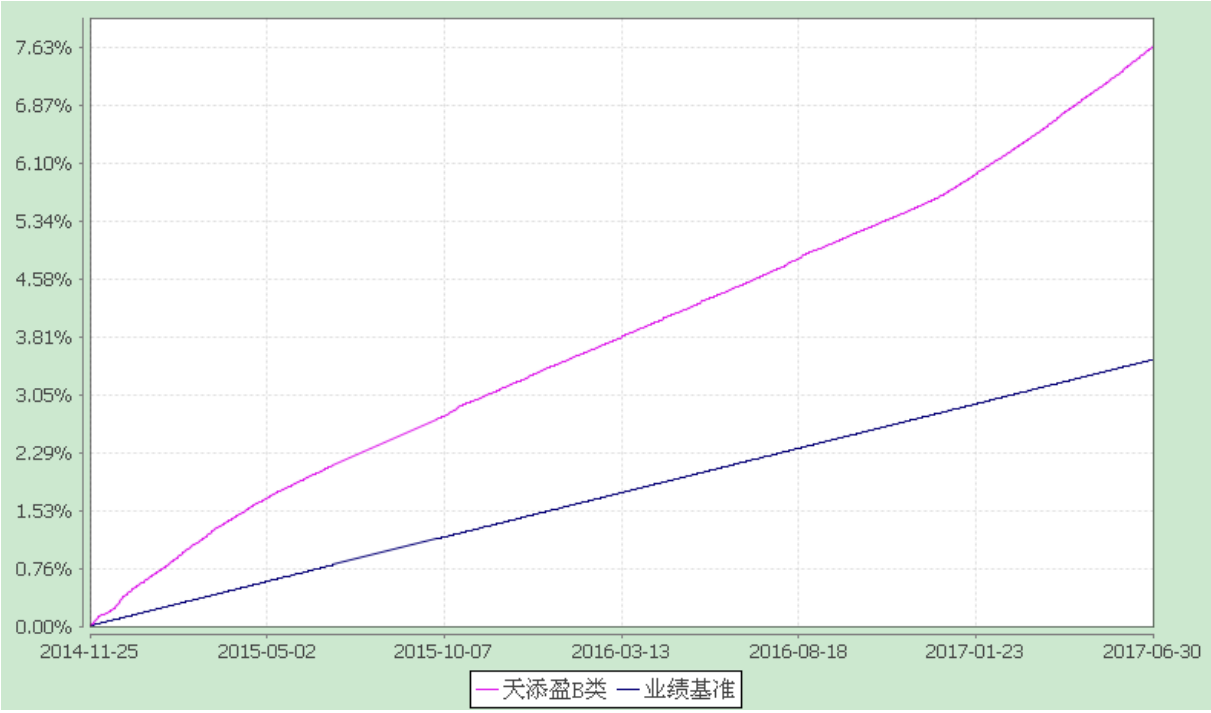
自基金合同生效以来份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014 年 11 月 25 日至 2017 年 6 月 30 日)

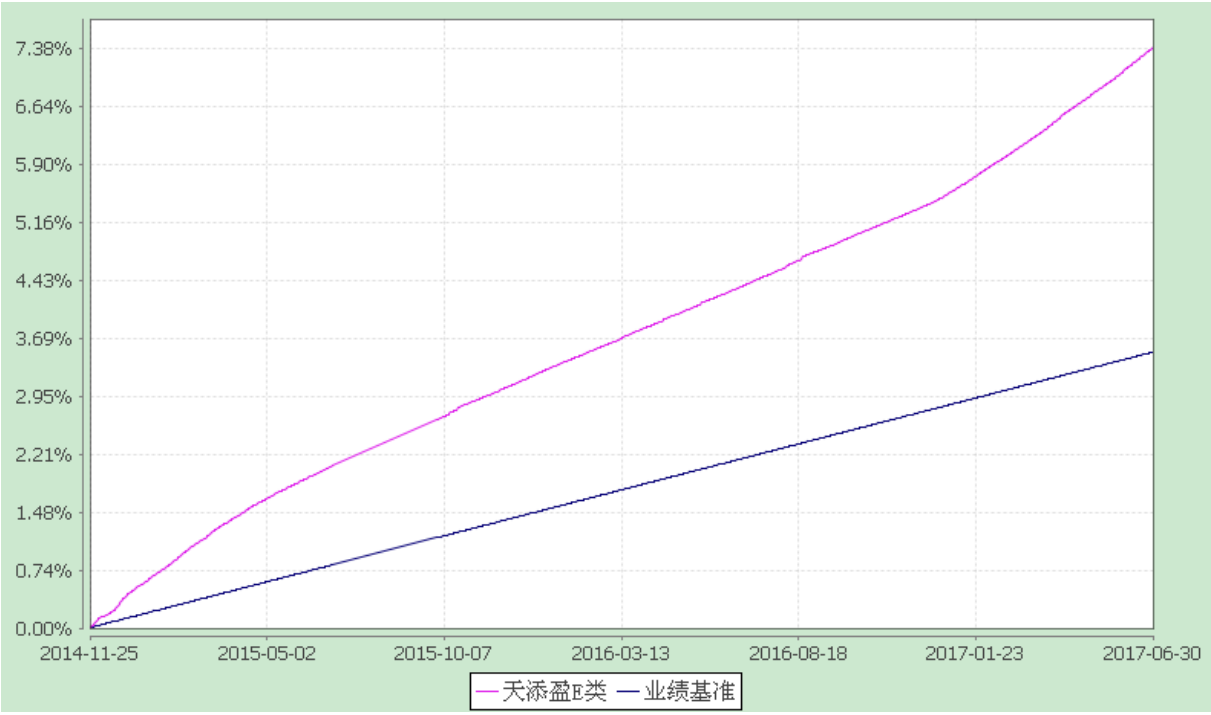
天添盈货币 A



天添盈货币 B



天添盈货币 E



注：1.本基金合同生效日为 2014 年 11 月 25 日，图示时间段为 2014 年 11 月 25 日至 2017 年 6 月 30 日。

2.本基金建仓期自 2014 年 11 月 25 日至 2015 年 5 月 24 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同的规定。

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 2017 年 6 月底，公司管理的基金共有五十七只，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、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根策略精选灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金、上投摩根岁岁丰定期开放债券型证券投资基金、上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、上投摩根全球多元配置证券投资基金(QDII)、

上投摩根安丰回报混合型证券投资基金、上投摩根安泽回报混合型证券投资基金、上投摩根安瑞回报混合型证券投资基金、上投摩根岁岁金定期开放债券型证券投资基金、上投摩根安通回报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	2014-11-25	-	8 年（金融领域从业经验 22 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，先后担任固定收益部总监、货币市场投资部总监，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	2016-05-27	-	3 年（金融领域从业经验 12 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，自 2016 年 5 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。
郭毅	本基金基金经理助理	2015-11-5	-	6 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，担任研究员。
王之远	本基金基金经理助理	2016-7-1	-	1 年	同济大学产业经济学硕士，2007 年 4 月至 2016 年 6 月在交通银行上海分行任高级资金管理岗，2016 年 7 月起加入上投摩根基金管理有限公司，任基金经理助理。

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.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. 自 2017 年 8 月 11 日起，郭毅先生担任上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金基金经理，不再担任本基金基金经理助理。

5. 自 2017 年 8 月 18 日起，孟晨波女士不再担任本基金基金经理。

6. 自 2017 年 8 月 18 日起，王之远先生担任本基金基金经理，不再担任本基金基金经理助理。

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、《上投摩根天添盈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公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、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环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保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量；对于银行间市场投资活动，本公

司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、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。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2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，未发现存在异常交易行为。

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

上半年宏观经济取得良好开局并保持平稳运行。从已公布的数据看，工业生产和利润、投资、消费、进出口的同比增速均保持稳健，尤其是工业企业利润和进出口数据较 2016 年同期显著提高；官方制造业 PMI 持续站在 51 上方；PPI 上升至 2 月 7.8%的高点后开始回落，CPI 先从 1 月的 2.55%大幅降至 2 月的 0.8%，之后止跌回升；相比 2016 年末，人民币对美元升值明显；外储于 1 月暂时跌破 3 万亿美元后，2 月起止跌回升，并保持小幅增长。

货币政策继续保持稳健中性，央行一方面维护市场流动性整体平稳，一方面分别于春节前后和 3 月美联储加息次日，两次上调流动性工具利率合计 20 个基点，同时通过严格的宏观审慎评估体系（MPA）进一步落实金融“防风险、去杠杆”。二季度起，金融监管继续加强，银、证、保三会相继出台了相关文件，防范金融风险，整顿金融秩序。在此背景下，央行的货币政策总体较为温和，为监管政策的推进提供了较为稳定的流动性环境，显示出一行三会等监管部门的协同配合进一步加强。具体来看，货币投放利率上，央行 6 月未跟随美联储提高流动性工具利率；货币投放量上，4、5、6 月到期的中期借贷便利（MLF）都增量续作。得益于央行货币投放的及时，以及市场预期和准备的充分，6 月末并未出现资金面大幅波动的局面，市场平稳度过半年末。

回顾市场，银行间 7 天债券质押式回购的加权利率在 2.37%至 5%的区间内波动；3 个月 Shibor 保持逐步上行趋势至 6 月中，之后开始下行；国债收益率震荡上行，期限利差收窄，6 月中

旬 1 年期和 10 年期收益率一度出现倒挂；同业存单发行需求整体依然较强，净融资额除 5 月为负数外，其他月份均为净增加，发行利率也维持在较高水平。

运作中，本基金继续高配短期限的协议存款和逆回购,适度配置利率债和同业存单，充分把握跨季资金价格上涨的机会，在保证安全性和流动性的前提下，提高基金收益水平。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 类、B 类和 E 类的净值增长率分别为 1.6713%，1.7919%和 1.7465%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，在经济运行平稳、去杠杆去产能初见成效、人民币汇率企稳的背景下，预计货币政策仍将保持稳健中性，央行会延续当前“削峰填谷”的流动性调控思路，熨平资金面的过度波动，维持松紧适度的流动性环境。我们判断后续资金面总体保持不松不紧，市场利率大幅上行和下行的可能性均不大，但碎片化波动在所难免。本基金将继续把握资产配置节奏、合理配置仓位和久期、严格把控流动性风险、信用风险和久期风险，确保基金平稳运作。

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

根据本基金合同约定，本基金采用“每日分配、按日支付”，即根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。

本报告期内应分配收益 5,622,394.17 元,实际分配收益 5,622,394.17 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

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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上投摩根天添盈货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	218,327,895.81	238,462,118.15
结算备付金		2,259,000.00	868,181.82
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	49,865,042.72	69,929,727.53
其中：股票投资		-	-

基金投资		-	-
债券投资		49,865,042.72	69,929,727.53
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	56,375,404.06	143,536,479.90
应收证券清算款		1,009,777.94	11,309.24
应收利息	6.4.7.5	1,383,682.38	1,080,225.88
应收股利		-	-
应收申购款		2,121,524.63	15,142,353.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		**331,342,327.54**	**469,030,396.14**
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2017 年 6 月 30 日**	**上年度末 2016 年 12 月 31 日**
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	4,998,356.16
应付赎回款		3,169,750.56	399,382.03
应付管理人报酬		89,217.38	48,677.58
应付托管费		27,035.53	14,750.78
应付销售服务费		12,222.22	9,775.22
应付交易费用	6.4.7.7	1,355.01	974.02
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		34,392.78	83,605.25
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	38,970.32	69,202.81
负债合计		3,372,943.80	5,624,723.85
所有者权益：		**-**	**-**
实收基金	6.4.7.9	327,969,383.74	463,405,672.29
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		327,969,383.74	463,405,672.29
负债和所有者权益总计		331,342,327.54	469,030,396.14

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，A 类、B 类和 E 类基金份额净值均为 1.0000 元，基金份额总额 327,969,383.74 份，其中 A 类基金份额 1,807,211.43 份，B 类基金份额 203,669,014.61 份, E 类基金份额 122,493,157.70 份。

6.2 利润表

会计主体：上投摩根天添盈货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		**6,439,428.38**	**2,755,712.85**
1.利息收入		6,439,428.38	2,755,712.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,922,783.16	1,265,841.82
债券利息收入		870,179.04	1,094,214.74
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		646,466.18	395,656.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
减：二、费用		**817,034.21**	**584,146.94**
1．管理人报酬		524,184.43	332,333.18
2．托管费		158,843.66	100,707.01
3．销售服务费		68,089.51	89,284.45
4．交易费用	6.4.7.18	-	-
5．利息支出		-	678.42
其中：卖出回购金融资产支出		-	678.42
6．其他费用	6.4.7.19	65,916.61	61,143.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**5,622,394.17**	**2,171,565.91**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**5,622,394.17**	**2,171,565.91**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根天添盈货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	463,405,672.29	-	463,405,672.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,622,394.17	5,622,394.17
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）	-135,436,288.55	-	-135,436,288.55
其中：1.基金申购款	231,949,834.59	-	231,949,834.59
2.基金赎回款	-367,386,123.14	-	-367,386,123.14
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）	-	-5,622,394.17	-5,622,394.17
五、期末所有者权益（基金净值）	327,969,383.74	-	327,969,383.74
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	212,902,491.81	-	212,902,491.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,171,565.91	2,171,565.91
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）	-16,175,456.72	-	-16,175,456.72
其中：1.基金申购款	336,839,129.70	-	336,839,129.70
2.基金赎回款	-353,014,586.42	-	-353,014,586.42
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）	-	-2,171,565.91	-2,171,565.91
五、期末所有者权益（基金净值）	196,727,035.09	-	196,727,035.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

投摩根天添盈货币市场基金(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”)证监许可[2014]第 1021 号《关于同意上投摩根天添盈货币市场基金募集的批复》核准，由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《上投摩根天添盈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 307,016,362.51 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 718 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根天添盈货币市场基金基金合同》于 2014 年 11 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 307,025,575.08 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,212.57 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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《上投摩根天添盈货币市场基金招募说明书》和《上投摩根天添盈货币市场基金基金份额发售公告》的有关规定，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 类和 E 类三类基金份额，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 类基金份额持有人，如 B 类基金份额持有人持有的基金份额余额少于 5,000,000 份，即降级为 A 类基金份额持有人。E 类基金份额仅限在基金管理人的网上直销系统办理认(申)购、赎回等业务，不得与其他基金份额类别相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根天添盈货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、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：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 2017 年 8 月 25 日批准报出。

6.4.2 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》、《 上投摩根天添盈货币市场基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年上半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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4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。

6.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，应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。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	3,327,895.81
定期存款	-
其他存款	215,000,000.00
合计	218,327,895.81

注：其他存款均为有存款期限，但根据协议可提前支取且无利息损失的银行存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	49,865,042.72	49,871,000.00	5,957.28	0.0018
	合计	49,865,042.72	49,871,000.00	5,957.28	0.0018

注：1、偏离金额＝影子定价－摊余成本；

2、偏离度＝偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	27,000,000.00	-
银行间买入返售证券	29,375,404.06	-
合计	56,375,404.06	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	730.79
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1,016,558.91
应收结算备付金利息	1,016.60
应收债券利息	337,526.03
应收买入返售证券利息	27,850.05
应收申购款利息	-
其他	-
合计	1,383,682.38

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-

银行间市场应付交易费用	1,355.01
合计	1,355.01

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	217.54
预提费用	38,752.78
合计	38,970.32

6.4.7.9 实收基金

天添盈货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	917,755.26	917,755.26
本期申购	2,664,456.61	2,664,456.61
本期赎回（以“-”号填列）	-1,775,000.44	-1,775,000.44
本期末	1,807,211.43	1,807,211.43

天添盈货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	358,728,620.46	358,728,620.46
本期申购	3,695,696.53	3,695,696.53
本期赎回（以“-”号填列）	-158,755,302.38	-158,755,302.38
本期末	203,669,014.61	203,669,014.61

天添盈货币 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	103,759,296.57	103,759,296.57
本期申购	225,589,681.45	225,589,681.45
本期赎回（以“-”号填列）	-206,855,820.32	-206,855,820.32
本期末	122,493,157.70	122,493,157.70

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额。

6.4.7.10 未分配利润

天添盈货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	23,262.41	-	23,262.41
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-23,262.41	-	-23,262.41
本期末	-	-	-

天添盈货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	3,629,448.86	-	3,629,448.86
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,629,448.86	-	-3,629,448.86
本期末	-	-	-

天添盈货币 E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	1,969,682.90	-	1,969,682.90
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-

其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-1,969,682.90	-	-1,969,682.90
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	25,403.97
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,880,043.61
结算备付金利息收入	17,335.58
其他	-
合计	4,922,783.16

6.4.7.12 股票投资收益

无

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	91,543,356.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	90,000,000.00
减：应收利息总额	1,543,356.17
买卖债券差价收入	-

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

无。

6.4.7.16 公允价值变动收益

无。

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 交易费用

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	-
银行费用	17,763.83
账户维护费用	18,000.00
其他	400.00
合计	65,916.61

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，本基金的基金管理人接外方股东摩根资产管理（英国）有限公司的通知，其控制的公司 J.P. Morgan Investment Management Limited 已完成清算，因此该公司不再是我司及我司旗下投资组合的关联方。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中信银行股份有限公司("中信银行")	基金托管人、基金代销机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金管理人的股东

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2关联方报酬

6.4.10.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	524,184.43	332,333.18
其中：支付销售机构的客户维护费	978.42	501.34

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。

6.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	158,843.66	100,707.01

注：支付基金托管人中信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。

6.4.10.2.3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 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	天添盈货币 A	天添盈货币 B	天添盈货币 E	合计

上投摩根基金管理有限公司	93.43	10,181.42	56,182.29	66,457.14
中信银行	0.00	0.00	0.00	0.00
浦发银行	473.54	16.44	0.00	489.98
合计	566.97	10,197.86	56,182.29	66,947.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	天添盈货币A	天添盈货币B	天添盈货币E	合计
上投摩根基金管理有限公司	1,412.23	1,443.39	85,226.11	88,081.73
中信银行	-	-	-	-
合计	1,412.23	1,443.39	85,226.11	88,081.73

注：1. 基金销售服务费对 A 类基金份额，B 类基金份额和 E 类基金份额收取。

2. 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类基金份额资产净值 0.25%、B 类基金份额资产净值 0.01%和 E 类基金份额资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给上投摩根基金管理有限公司，再由上投摩根基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

A 类的日销售服务费＝前一日 A 类基金份额 X 0.25%/ 当年天数。

B 类的日销售服务费＝前一日 B 类基金份额 X 0.01%/ 当年天数。

E 类的日销售服务费＝前一日 E 类基金份额 X 0.10%/ 当年天数。

3. 上述支付浦发银行的销售服务费仅涵盖浦发银行作为关联方期间的相关费用。

6.4.10.3 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

本期 2017年1月1日至2017年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
浦发银行	10,241,986.85	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
-	-	-	-	-	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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

天添盈货币 B

份额单位：份

关联方名称	天添盈货币B本期末 2017年6月30日		天添盈货币B上年度末 2016年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
浦发银行	203,669,014.61	100.00%	200,068,777.90	43.17%

6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	3,327,895.81	25,403.97	6,727,773.31	29,843.97
浦发银行	10,000,000.00	597,561.10	10,000,000.00	106,805.55

注：1.本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。2. 本基金的部分定期银行存款存放于浦发银行，按银行约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

1、天添盈货币 A

单位：人民币元

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	本期利润分 配合计	备注
23,102.92	134.99	24.50	23,262.41	-

2、天添盈货币 B

单位：人民币元

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	本期利润分配合计	备注
3,673,012.69	0.00	-43,563.83	3,629,448.86	-

3、天添盈货币 E

单位：人民币元

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	本期利润分配合计	备注
1,971,513.37	3,842.67	-5,673.14	1,969,682.90	-

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略

和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范， 并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律，法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监查和风险控制的评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管，并提出内控建议。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行活期存款存放在本基金的托管行中信银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。银行定期存款存放在具有托管资格的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信

用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 6.08%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	39,863,096.84	69,929,727.53
合计	39,863,096.84	69,929,727.53

注：未评级的债券为政策性金融债、主体评级为 AAA 的超短融和大额存单。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	10,001,945.88	-
合计	10,001,945.88	-

注：未评级的债券为政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的 40%。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	3 个月以内	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	218,327,895.81	-	-	-	-	218,327,895.81
结算备付金	2,259,000.00	-	-	-	-	2,259,000.00
交易性金融资产	49,865,042.72	-	-	-	-	49,865,042.72

买入返售金融资产	56,375,404.06	-	-	-	-	56,375,404.06
应收证券清算款	-	-	-	-	1,009,777.94	1,009,777.94
应收利息	-	-	-	-	1,383,682.38	1,383,682.38
应收申购款	-	-	-	-	2,121,524.63	2,121,524.63
资产总计	326,827,342.59	-	-	-	4,514,984.95	331,342,327.54
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	3,169,750.56	3,169,750.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	89,217.38	89,217.38
应付托管费	-	-	-	-	27,035.53	27,035.53
应付销售服务费	-	-	-	-	12,222.22	12,222.22
应付交易费用	-	-	-	-	1,355.01	1,355.01
应付利润	-	-	-	-	34,392.78	34,392.78
其他负债	-	-	-	-	38,970.32	38,970.32
负债总计	-	-	-	-	3,372,943.80	3,372,943.80
利率敏感度缺口	326,827,342.59	-	-	-	1,142,041.15	327,969,383.74
上年度末 2016 年 12 月 31 日	**3 个月以内**	**3 个月至 1 年**	**1 至 5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产						
银行存款	238,462,118.15	-	-	-	-	238,462,118.15
结算备付金	868,181.82	-	-	-	-	868,181.82
交易性金融资产	39,957,776.63	29,971,950.90	-	-	-	69,929,727.53
买入返售金融资产	143,536,479.90	-	-	-	-	143,536,479.90
应收证券清算款	-	-	-	-	11,309.24	11,309.24
应收利息	-	-	-	-	1,080,225.88	1,080,225.88
应收申购款	-	-	-	-	15,142,353.62	15,142,353.62
资产总计	422,824,556.50	29,971,950.90	-	-	16,233,888.74	469,030,396.14
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	4,998,356.16	4,998,356.16
应付赎回款	-	-	-	-	399,382.03	399,382.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	48,677.58	48,677.58
应付托管费	-	-	-	-	14,750.78	14,750.78
应付销售服务费	-	-	-	-	9,775.22	9,775.22
应付交易费用	-	-	-	-	974.02	974.02
应付利润	-	-	-	-	83,605.25	83,605.25
其他负债	-	-	-	-	69,202.81	69,202.81

负债总计	-	-	-	-	5,624,723.85	5,624,723.85
利率敏感度缺口	422,824,556.50	29,971,950.90	-	-	10,609,164.89	463,405,672.29

表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	10,000	30,000.00
	2.市场利率上升 25 个基点	-10,000	-30,000.00

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融　房地产开发　教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2)　纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3)　资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计

税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(2) 除增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 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	49,865,042.72	15.05
	其中：债券	49,865,042.72	15.05
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	56,375,404.06	17.01
	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	220,586,895.81	66.57
4	其他各项资产	4,514,984.95	1.36
5	合计	331,342,327.54	100.00

7.2 债券回购融资情况

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	-	-

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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	32
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	59
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

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。

7.3.2 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	52.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	35.03	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	12.20	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.96	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

在本报告期内本基金未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

7.5 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	19,919,783.14	6.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,001,945.88	3.05
	其中：政策性金融债	10,001,945.88	3.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	19,943,313.70	6.08
8	其他	-	-
9	合计	49,865,042.72	15.20
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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	150417	15 农发 17	100,000.00	10,001,945.88	3.05
2	111715101	17 民生银行 CD101	100,000.00	9,986,898.27	3.05
3	179907	17 贴现国债 07	100,000.00	9,964,247.51	3.04
4	111707124	17 招商银行 CD124	100,000.00	9,956,415.43	3.04
5	179924	17 贴现国债 24	100,000.00	9,955,535.63	3.04

7.7“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	0.0190%
报告期内偏离度的最低值	-0.0076%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0089%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况.

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况.

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	1,009,777.94
3	应收利息	1,383,682.38
4	应收申购款	2,121,524.63
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,514,984.95

7.9.4 其他需说明的重要事项

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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
天添盈货币 A	22,566	80.09	3,058.97	0.17%	1,804,152.46	99.83%
天添盈货币 B	1	203,669,014.61	203,669,014.61	100.00%	-	0.00%
天添盈货币 E	11,979	10,225.66	430.72	0.00%	122,492,726.98	100.00%
合计	34,546	9,493.70	203,672,504.30	62.10%	124,296,879.44	37.90%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天添盈货币 A	401,611.85	22.2227%
	天添盈货币 B	-	-
	天添盈货币 E	1,560,683.47	1.2741%
	合计	1,962,295.32	0.5983%

8.3 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的情况

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	天添盈货币 A	0~10
	天添盈货币 B	-
	天添盈货币 E	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	天添盈货币 A	-
	天添盈货币 B	-
	天添盈货币 E	0~10
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	天添盈货币 A	天添盈货币 B	天添盈货币 E
基金合同生效日（2014 年 11 月 25 日）基金份额总额	107,020,826.96	170,004,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	917,755.26	358,728,620.46	103,759,296.57
本报告期基金总申购份额	2,664,456.61	3,695,696.53	225,589,681.45
减：本报告期基金总赎回份额	1,775,000.44	158,755,302.38	206,855,820.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,807,211.43	203,669,014.61	122,493,157.70

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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：

无。

基金托管人：

无。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 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的情况。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
中信证券	2	-	-	-	-	-

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。

4. 本报告期本基金无新增席位，无注销席位。

10.7.2 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
中信证券	-	-	2,654,200,000.00	100.00%	-	-

10.8 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。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1.	上投摩根天添盈货币市场基金春节假期前暂停申购及转换转入业务的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券时报》和《中国证券报》	2017 年 1 月 20 日
2.	上投摩根天添盈货币市场基金清明假期前暂停申购及转换转入业务的公告	同上	2017 年 3 月 27 日
3.	关于降低上投摩根天添盈货币市场基金（E 类份额）最低交易限额的公告	同上	2017 年 4 月 14 日
4.	上投摩根天添盈货币市场基金端午节假期	同上	2017 年 5 月 22 日

	前暂停申购及转换转入业务的公告		
5.	关于上投摩根天添盈货币市场基金修改基金合同和托管协议的公告	同上	2017 年 5 月 31 日
6.	关于降低上投摩根基金管理有限公司旗下部分人民币份额基金最低交易限额的公告	同上	2017 年 6 月 7 日
7.	关于降低电子直销平台现金宝快速取现份额限额的公告	同上	2017 年 6 月 23 日

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101~20170630	200,068,777.90	3,600,236.71	0.00	203,669,014.61	62.10%
机构	2	20170101~20170103	100,000,000.00	42,443.75	100,042,443.75	0.00	0.00
产品特有风险							
本基金的集中度风险主要体现在有单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%，如果投资者发生大额赎回，可能出现基金可变现资产无法满足投资者赎回需要以及因为资产变现成本过高导致投资者的利益受到损害的风险。							

注：红利再投资计入申购份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准上投摩根天添盈货币市场基金设立的文件；

2、《上投摩根天添盈货币市场基金基金合同》；

3、《上投摩根天添盈货币市场基金基金托管协议》；

4、《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

网址：www.cifm.com

上投摩根基金管理有限公司

二〇一七年八月二十八日