

上投摩根天添盈货币市场基金
2017 年年度报告摘要
2017 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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十九日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 28 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 2017 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	390,806,073.76 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	2,958,639.24 份	200,221,012.87 份	187,626,421.65 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，本基金将通过分析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	李修滨
	联系电话	021-38794888	4006800000
	电子邮箱	services@cifm.com	lixibin@citicbank.com
客户服务电话		400-889-4888	95558
传真		021-20628400	010-85230024

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	2017 年			2016 年			2015 年		
	天添盈 货币 A	天添盈 货币 B	天添盈 货币 E	天添盈 货币 A	天添盈 货币 B	天添盈 货币 E	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	86,745.7 0	7,645,70 1.78	5,228,92 9.23	31,315.2 9	957,534. 45	3,198,33 2.63	105,573. 85	1,835,16 6.83	4,566,34 2.07
本期利润	86,745.7	7,645,70	5,228,92	31,315.2	957,534.	3,198,33	105,573.	1,835,16	4,566,34

	0	1.78	9.23	9	45	2.63	85	6.83	2.07
本期净值收 率	3.5553 %	3.8039 %	3.7107 %	2.0606 %	2.3095 %	2.2173 %	2.6247 %	2.8746 %	2.7823 %
3.1.2 期末数据和 指标	2017 年末			2016 年末			2015 年末		
	天添盈货 币 A	天添盈货 币 B	天添盈货 币 E	天添盈货 币 A	天添盈货 币 B	天添盈货 币 E	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	2,958,63 9.24	200,221, 012.87	187,626, 421.65	917,755. 26	358,728, 620.46	103,759, 296.57	1,278,50 8.41	19,983,9 10.53	191,640, 072.87
期末基金份额 净值	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	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.本基金收益分配按日结转份额。

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. 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
过去三个月	0.9402%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.5999%	0.0010%
过去六个月	1.8531%	0.0008%	0.6805%	0.0000%	1.1726%	0.0008%
过去一年	3.5553%	0.0013%	1.3500%	0.0000%	2.2053%	0.0013%
过去三年	8.4631%	0.0027%	4.0537%	0.0000%	4.4094%	0.0027%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生 效起至今	8.9356%	0.0029%	4.1905%	0.0000%	4.7451%	0.0029%

2. 天添盈货币 B:

阶段	份额净值收	份额净值收	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	益率①	益率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	1.0017%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.6614%	0.0010%
过去六个月	1.9765%	0.0008%	0.6805%	0.0000%	1.2960%	0.0008%
过去一年	3.8039%	0.0013%	1.3500%	0.0000%	2.4539%	0.0013%
过去三年	9.2541%	0.0027%	4.0537%	0.0000%	5.2004%	0.0027%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	9.7574%	0.0029%	4.1905%	0.0000%	5.5669%	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
过去三个月	0.9789%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.6386%	0.0010%
过去六个月	1.9304%	0.0008%	0.6805%	0.0000%	1.2499%	0.0008%
过去一年	3.7107%	0.0013%	1.3500%	0.0000%	2.3607%	0.0013%
过去三年	8.9598%	0.0027%	4.0537%	0.0000%	4.9061%	0.0027%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	9.4523%	0.0029%	4.1905%	0.0000%	5.2618%	0.0029%

注：本基金收益分配按日结转份额。

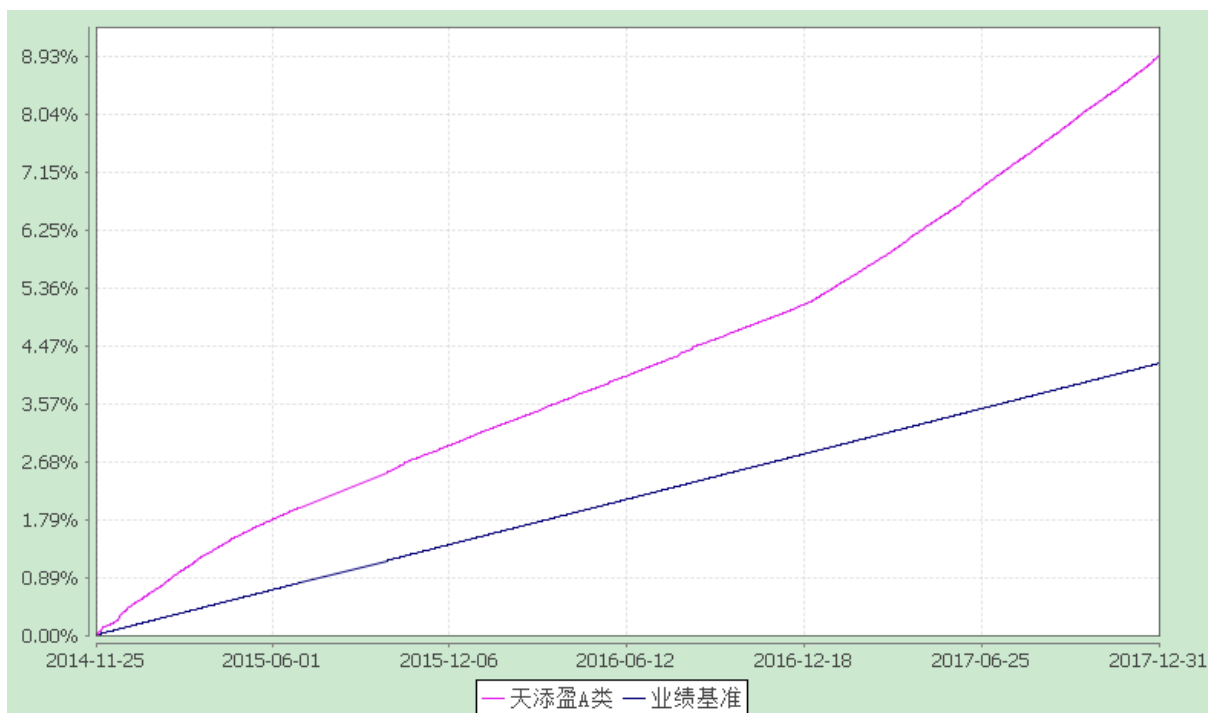
3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根天添盈货币市场基金

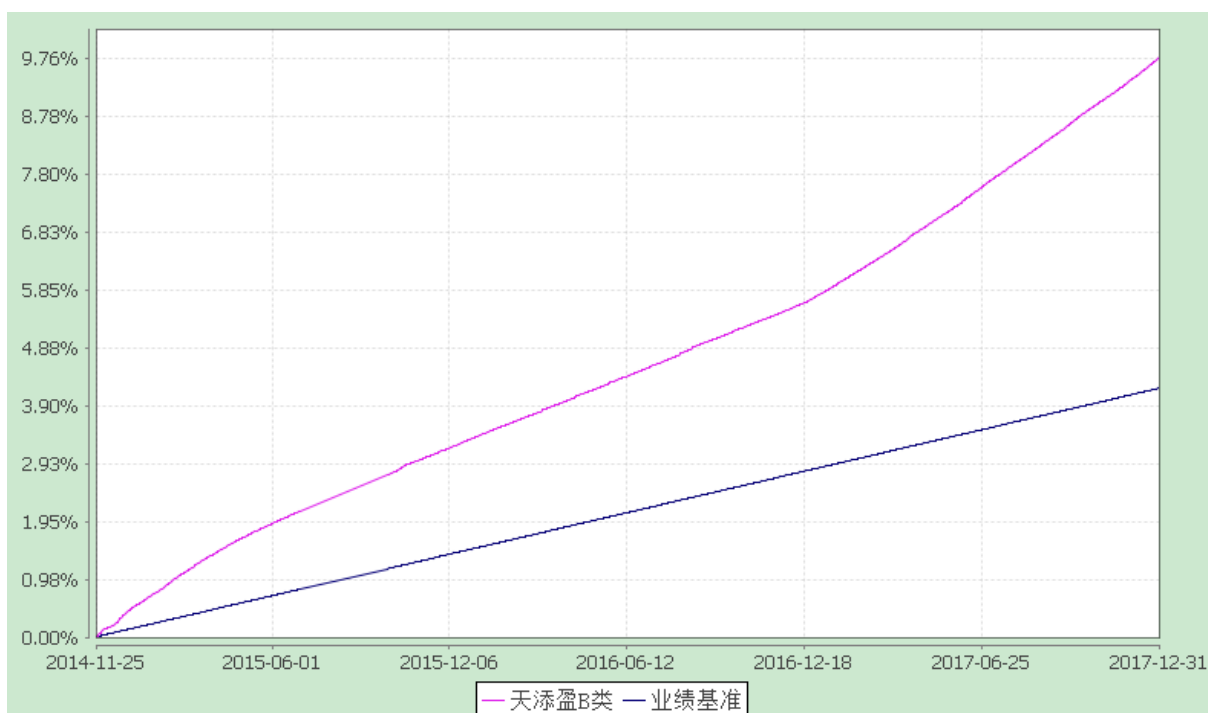
自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014 年 11 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日)

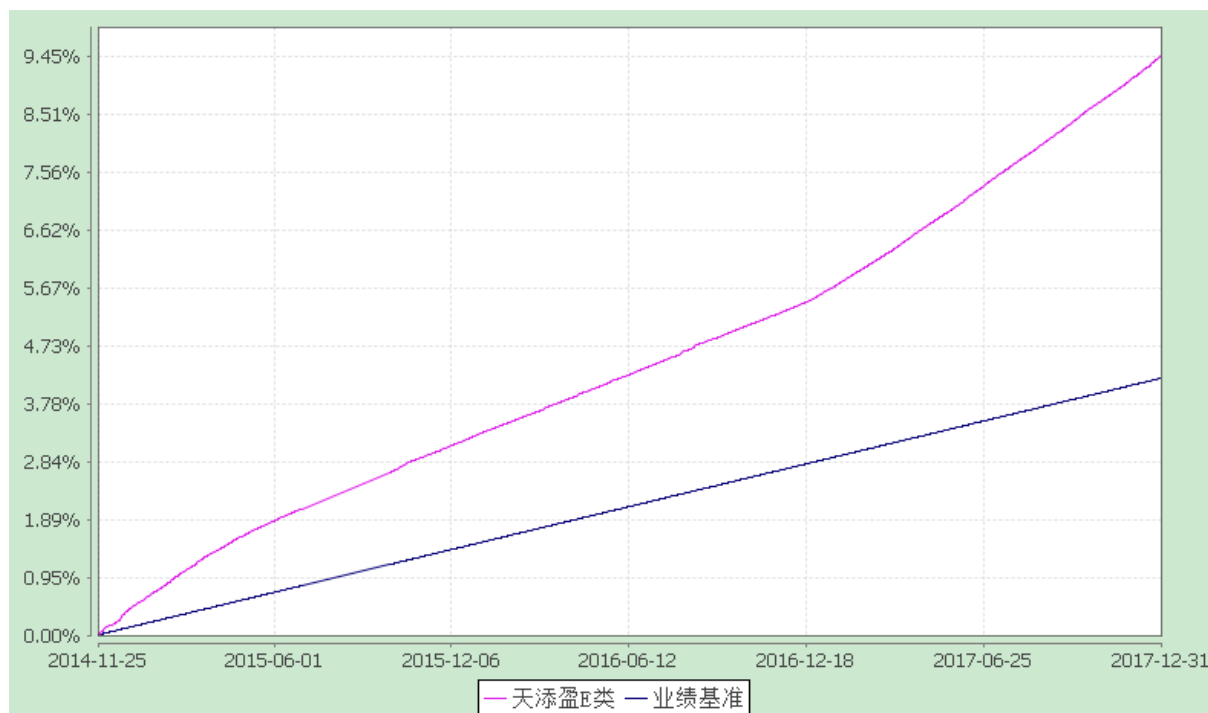
1、天添盈货币 A



2、天添盈货币 B



3、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 12 月 31 日。

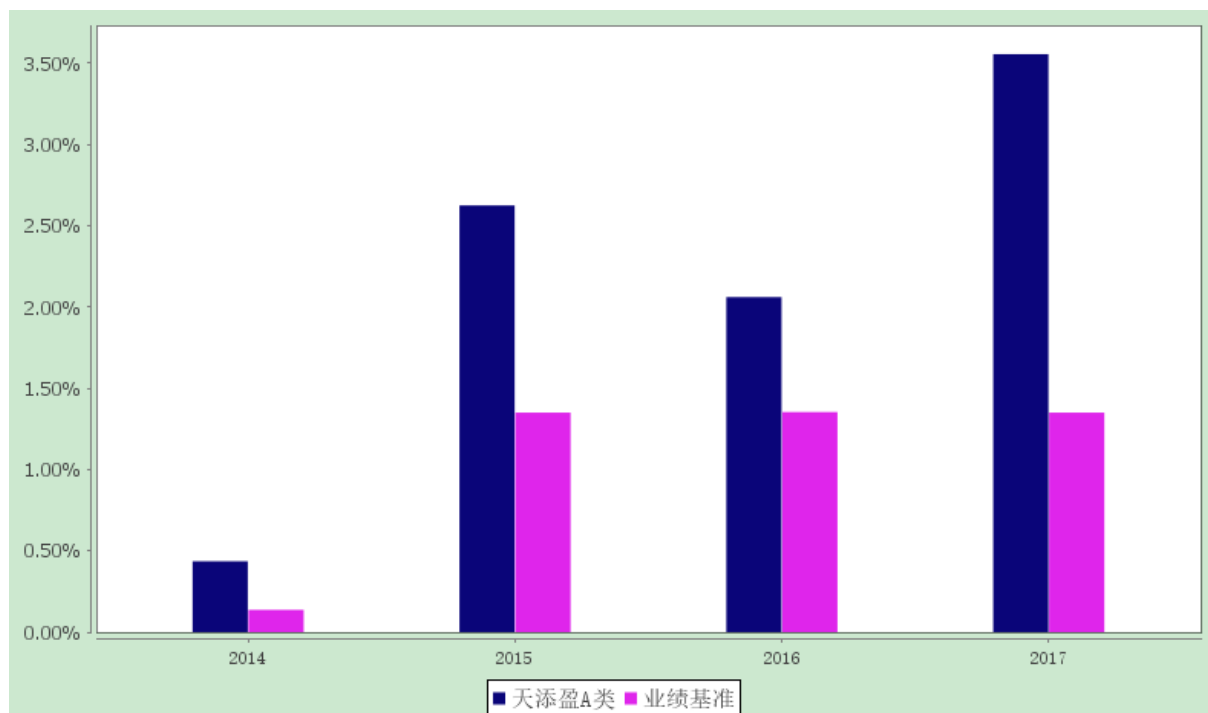
2.本基金建仓期自 2014 年 11 月 25 日至 2015 年 5 月 24 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同的规定。

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

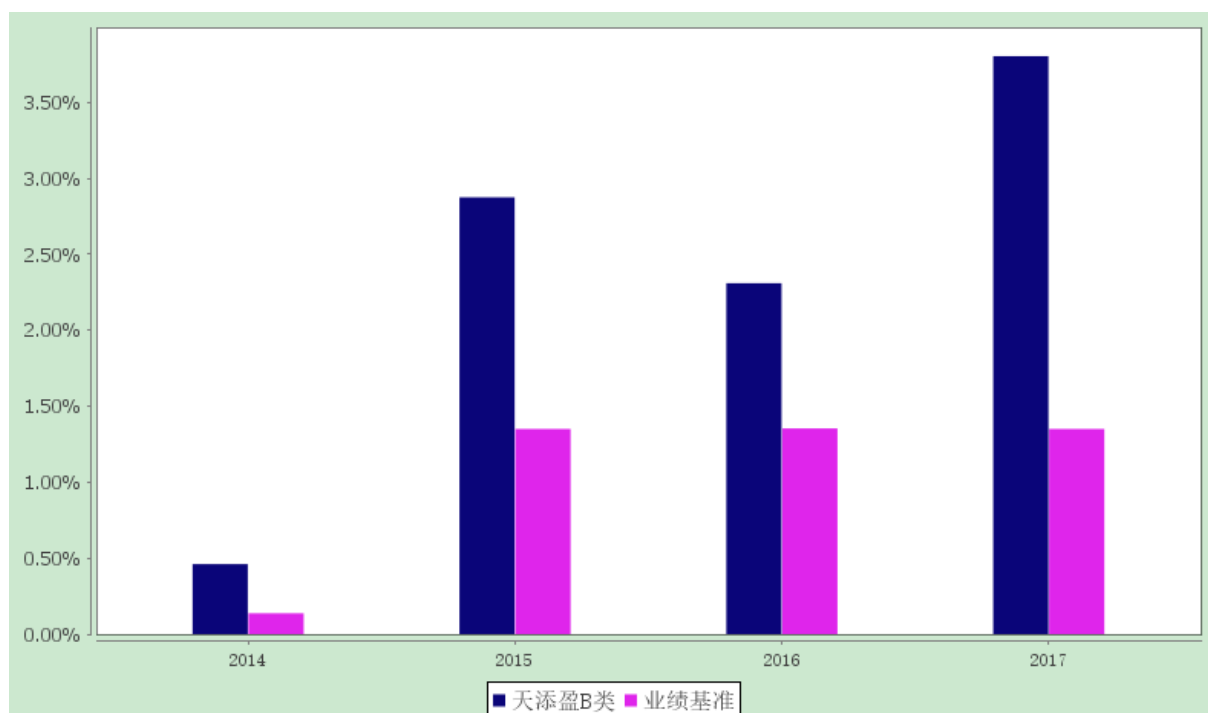
上投摩根天添盈货币市场基金

自基金合同生效以来基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

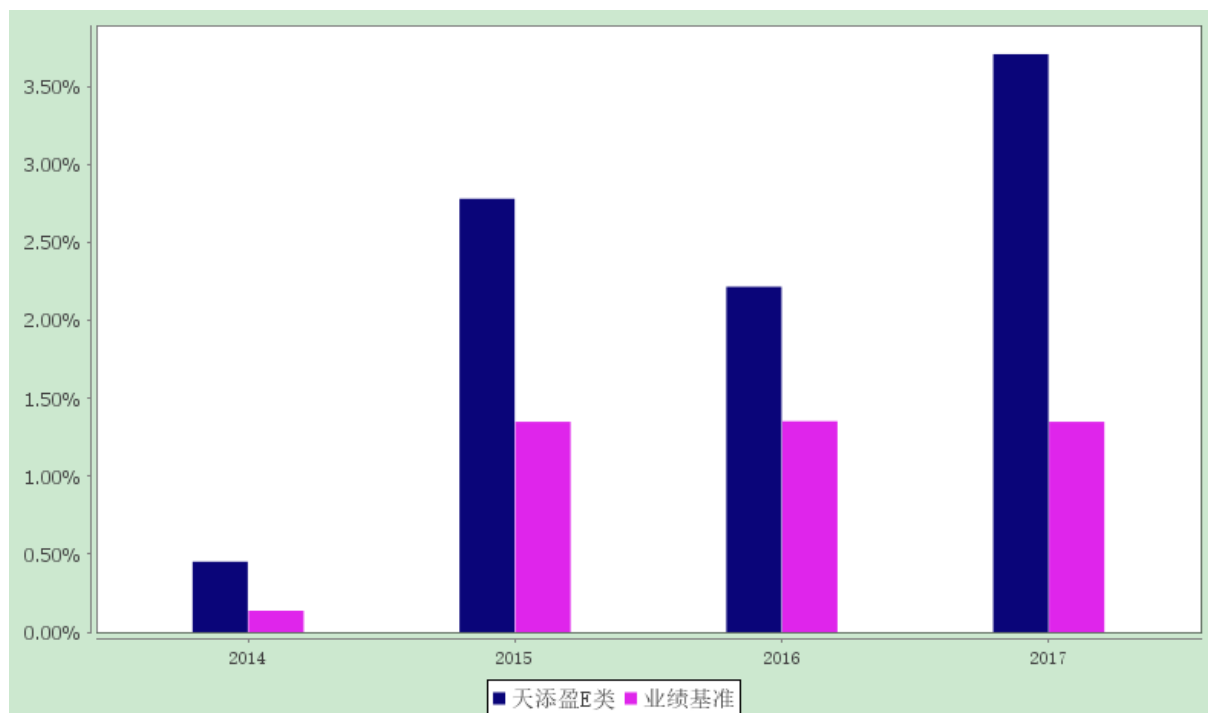
1、天添盈货币 A



2、天添盈货币 B



3、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 12 月 31 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

天添盈货币 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
2017 年	85,343.98	378.31	1,023.41	86,745.70	-
2016 年	31,036.89	181.42	96.98	31,315.29	-
2015 年	105,032.46	3,257.39	-2,716.00	105,573.85	-
合计	221,413.33	3,817.12	-1,595.61	223,634.84	-

天添盈货币 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
2017 年	7,627,397.63	-	18,304.15	7,645,701.78	-
2016 年	893,492.03	-	64,042.42	957,534.45	-

2015 年	1,841,945.58	-	-6,778.75	1,835,166.83	-
合计	10,362,835.2				
	4	-	75,567.82	10,438,403.06	-

天添盈货币 E:

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
2017 年	4,707,141.36	308,370.79	213,417.08	5,228,929.23	-
2016 年	3,178,604.95	11,099.16	8,628.52	3,198,332.63	-
2015 年	4,525,534.78	40,927.96	-120.67	4,566,342.07	-
合计	12,411,281.0	360,397.91	221,924.93	12,993,603.93	-
	9				

§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12月底，公司管理的基金共有六十只，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、上投摩根优选多因子股票型证券投资基金、上投摩根丰瑞债券型证券投资基金及上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金。

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		
鞠婷	本基金基金经理	2016-05-27	-	4 年（金融领域从业经验 13 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。
王之远	本基金基	2017-08-18	-	2 年	王之远先生，同济大学产业经济

	金经理				学硕士，2007 年 4 月至 2016 年 6 月在交通银行上海分行历任营业网点营销支持、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。自 2017 年 8 月起担任上投摩根天添盈货币市场基金基金经理。
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	2017-8-18	9 年（金融领域从业经验 23 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 月起担任上投摩根天添宝货币市场基金基金经理，2014 年 11 月至 2017 年 8 月担任上投摩根天添盈货币市场基金基金经理。
王之远	本基金基金经理助理	2016-7-1	2017-8-18	2 年	王之远先生，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历任营业网点营销支持、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。自 2017 年 8 月起担任上投摩根天添盈货币市场基金基金经理。

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。

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% 的次数为四次，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

2017 年经济表现出较强的韧性，全年 GDP 增速达到 6.9%，为七年来首次提速。受益于供给侧改革和内需平稳，企业利润较上年明显改善，实现了 2 位数的增长；随着外部经济的回暖，对外贸易强势复苏，净出口对经济增长的贡献率由负转正；CPI 呈现“V”形走势，全年通胀水平为 1.6%，其中食品价格下降对 CPI 形成拖累；PPI 呈现“M”形走势，全年上涨 6.3%，结束了 2012 年以来的连降态势；外储止跌回升，年末达 3.14 万亿美元，较 2016 年末增加 1300 亿美元；人民币对美元汇率双向浮动的弹性明显增强。

货币政策保持稳健中性。央行综合利用公开市场操作、常备借贷便利(SLF)和中期借贷便利(MLF)等金融工具，通过“削峰填谷”的操作，维持流动性的基本稳定，并先后三次上调政策利率合计 25 个基点；此外，9 月央行宣布对普惠金融实施定向降准，增加了对资金“脱虚向实”的正向激励。

“严监管”成为 2017 年金融市场的鲜明特征。央行继续构建和完善逆周期调节的宏观审慎评估体系(MPA)，一季度将表外理财纳入广义信贷，还将把同业存单纳入同业负债占比；针对银行业市场乱象，银监会开展了“三三四十”（三违反、三套利、四不当、十个方面）等一系列专项治理行动；下半年，针对公募基金流动性风险管理、金融机构资产管理业务、商业银行流动性风险管理等领域的监管文件发布稿或征求意见稿陆续出台。

在“稳货币+严监管”的背景下，货币市场和债券市场收益率中枢较 2016 年明显抬升。资金面尽管总体稳定，但受参与者结构（银行和非银）、税期、跨季、监管指标等因素影响，经常会出现阶段性紧张，银行间 7 天质押式回购加权利率在 2.37%-6.94% 内波动；同业存单发行需求旺盛，全年发行超过 20 万亿，发行价格也位于较高水平，年末资金紧张时发行价格普遍超过 5%；债券收益率震荡上行，国债收益率曲线较 2016 年末显著上移，1 年期和 10 年期分别上行 114 和 87 个基点，收

于 3.79%和 3.88%。

本基金在运作中始终把安全性和流动性放在首位。在市场利率逐步上行的环境中，执行短久期策略，并控制债券和同业存单等有估值压力的资产的仓位；在月末、季末等流动性偏紧时期，加强客户现金流的预测和管理，资产配置中始终保持一定比例的期限较短的逆回购资产，一方面增强了基金的流动性，另一方面在资金价格短期冲高时取得了较好的收益。

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、E 类的净值收益率分别为 3.5553%，3.8039%和 3.7107%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。

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，在外部经济持续改善、内需平稳的背景下，预期经济依然会有较强的韧性。根据中央经济工作会议精神，2018 年依然是“稳货币+严监管”之年。经济发展更加强调质量而非速度，中央对经济放缓的容忍度会进一步提高，即使经济增速有所下行，货币政策保持稳健中性的方向不会改变；为打好防控金融风险的攻坚战，金融严监管也会继续稳步推进。本基金将继续通过严格的久期管理和信用风险管理，严把交易对手风险，在确保组合安全性和流动性的同时，力争为投资者创造持久的有竞争力的收益。

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

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 12,961,376.71 元,实际分配收益 12,961,376.71 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

本托管人认为,上投摩根基金管理有限公司在上投摩根天添盈货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

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 审计报告

上投摩根天添盈货币市场基金 2017 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计、注册会计师薛竞、沈兆杰签字出具了“无保留意见的审计报告”(编号:普华永道中天审字(2018)第 21890 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:上投摩根天添盈货币市场基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	265,653,481.32	238,462,118.15
结算备付金		3,192,272.72	868,181.82
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	49,857,043.43	69,929,727.53
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		49,857,043.43	69,929,727.53
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	75,991,134.99	143,536,479.90
应收证券清算款		-	11,309.24
应收利息	7.4.7.5	2,502,134.33	1,080,225.88
应收股利		-	-
应收申购款		1,922,252.95	15,142,353.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		399,118,319.74	469,030,396.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		930,326.56	4,998,356.16
应付赎回款		6,811,869.76	399,382.03
应付管理人报酬		124,174.46	48,677.58
应付托管费		37,628.59	14,750.78
应付销售服务费		22,373.26	9,775.22
应付交易费用	7.4.7.7	484.99	974.02
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		316,349.89	83,605.25
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	69,038.47	69,202.81
负债合计		8,312,245.98	5,624,723.85
所有者权益：			-
实收基金	7.4.7.9	390,806,073.76	463,405,672.29
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		390,806,073.76	463,405,672.29
负债和所有者权益总计		399,118,319.74	469,030,396.14

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 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 390,806,073.76 份，其中 A 类基金份额 2,958,639.24 份，B 类基金份额 200,221,012.87 份，E 类基金份额 187,626,421.65 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		14,770,286.98	5,276,973.78
1.利息收入		14,770,286.98	5,276,973.78

其中：存款利息收入	7.4.7.11	10,197,316.00	2,452,871.59
债券利息收入		1,803,242.66	1,961,024.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,769,728.32	863,077.30
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-	-
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	-	-
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		1,808,910.27	1,089,791.41
1. 管理人报酬		1,153,635.97	617,560.00
2. 托管费		349,586.54	187,139.44
3. 销售服务费		168,314.92	154,444.54
4. 交易费用	7.4.7.18	-	-
5. 利息支出		-	2,471.91
其中：卖出回购金融资产支出		-	2,471.91
6. 其他费用	7.4.7.19	137,372.84	128,175.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,961,376.71	4,187,182.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,961,376.71	4,187,182.37

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	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）	-	12,961,376.71	12,961,376.71
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）	-72,599,598.53	-	-72,599,598.53
其中：1.基金申购款	1,111,065,956.26	-	1,111,065,956.26
2.基金赎回款	-1,183,665,554.79	-	-1,183,665,554.79
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）	-	-12,961,376.71	-12,961,376.71
五、期末所有者权益（基金净值）	390,806,073.76	-	390,806,073.76
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	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）	-	4,187,182.37	4,187,182.37
三、本期基金份额交易产生	250,503,180.48	-	250,503,180.48

的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	882,371,517.29	-	882,371,517.29
2.基金赎回款	-631,868,336.81	-	-631,868,336.81
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）	-	-4,187,182.37	-4,187,182.37
五、期末所有者权益（基金净值）	463,405,672.29	-	463,405,672.29

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 2018 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》、《上投摩根天添盈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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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

本基金本报告期所采用的会计政策、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

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[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。

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
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人、基金销售机构
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
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金管理人的股东上海国际信托有限公司的控股股东、基金销售机构
尚腾资本管理有限公司	基金管理人的子公司
上投摩根资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
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 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：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据浦发银行于 2016 年 3 月 16 日发布的《上海浦东发展银行股份有限公司关于发行股份购买资产暨关联交易之标的资产过户完成的公告》，浦发银行发行股份购买资产暨关联交易事项已经中国证监会证监许可[2015]2677 号《关于核准上海浦东发展银行股份有限公司向上海国际集团有限公司等发行股份购买资产的批复》核准。于 2016 年 3 月 15 日，上海信托已完成了相关工商变更登记手续，成为浦发银行的控股子公司

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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管 理费	1,153,635.97	617,560.00
其中：支付销售机构的客户	3,112.84	1,040.27

维护费		
-----	--	--

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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	349,586.54	187,139.44

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 0.1% 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 0.1% / 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			
	2017年1月1日至2017年12月31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	116.29	20,528.41	141,717.53	162,362.23
浦发银行	2,308.25	16.44	-	2,324.69
合计	2,424.54	20,544.85	141,717.53	164,686.92
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12月31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	1,569.86	3,883.96	146,726.38	152,180.20
浦发银行	71.95	4.10	-	76.05
合计	1,641.81	3,888.06	146,726.38	152,256.25

注：1. 支付基金销售机构的 A 类基金份额、B 类基金份额和 E 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%、0.01% 和 0.10% 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 × 约定年费率 / 当年天数。

2. 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。

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。

7.4.8.4.1 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12月31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	200,221,012.87	51.23%	200,068,777.90	43.17%

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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中信银行股份有 限公司	20,653,481.32	91,554.32	13,462,118.15	54,837.56

浦发银行	40,000,000.00	1,261,188.74	25,000,000.00	274,569.44
------	---------------	--------------	---------------	------------

注：1. 本基金的活期银行存款和部分定期银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行约定利率计息。

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。

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（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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

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。

持续的以公允价值计量的金融工具

各层次金融工具公允价值

于 2017 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 49,857,043.43 元,无属于第一和第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日:第二层次 69,929,727.53 元,无第一或第三层次)。

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。

第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 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(2017 年 12 月 31 日:同)。

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) 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,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。

根据财政部、国家税务总局于 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。

此外,财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	49,857,043.43	12.49
	其中：债券	49,857,043.43	12.49
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	75,991,134.99	19.04
	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	268,845,754.04	67.36
4	其他各项资产	4,424,387.28	1.11
5	合计	399,118,319.74	100.00

8.2 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%。

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	49
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	22

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。

8.3.2 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	31.94	0.24
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	28.15	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	30.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	5.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	5.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.99	0.24

8.4 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。

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	39,993,107.23	10.23
	其中：政策性金融债	39,993,107.23	10.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	9,863,936.20	2.52
8	其他	-	-
9	合计	49,857,043.43	12.76
10	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	150207	15 国开 07	100,000.00	10,011,823.16	2.56
2	150406	15 农发 06	100,000.00	10,002,254.63	2.56
3	170203	17 国开 03	100,000.00	9,997,909.83	2.56
4	170306	17 进出 06	100,000.00	9,981,119.61	2.55
5	111707258	17 招商银行 CD258	100,000.00	9,863,936.20	2.52

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	0.0190%
报告期内偏离度的最低值	-0.0167%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0068%

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。

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 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。

8.9.3 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	-
3	应收利息	2,502,134.33
4	应收申购款	1,922,252.95
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,424,387.28

8.9.4 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
天添盈货币 A	22,314	132.59	615.17	0.02%	2,958,024.07	99.98%
天添盈货币 B	1	200,221,012.87	200,221,012.87	100.00%	-	0.00%
天添盈货币 E	16,352	11,474.22	438.02	0.00%	187,625,983.63	100.00%
合计	38,667	10,106.97	200,222,066.06	51.23%	190,584,007.70	48.77%

9.2 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	264,043.28	8.9245%
	天添盈货币 B	-	-
	天添盈货币 E	1,365,580.49	0.7278%
	合计	1,629,623.77	0.4170%

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	0
	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	0
	天添盈货币 B	0
	天添盈货币 E	0~10
	合计	0~10

§10 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	30,000,748.12
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	13,967,132.31	207,705,166.03	889,393,657.92
减: 本报告期基金总赎回份额	11,926,248.33	366,212,773.62	805,526,532.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,958,639.24	200,221,012.87	187,626,421.65

§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:

- 1、 本公司于 2017 年 7 月 15 日发布公告: 因个人原因, 穆矢先生自 2017 年 7 月 13 日起不再担任本公司董事长。
- 2、 本公司于 2017 年 7 月 29 日发布公告: 章硕麟先生自 2017 年 7 月 28 日起代任本公司董事长。
- 3、 本公司于 2017 年 9 月 23 日发布公告: 因个人原因, 刘万方先生自 2017 年 9 月 21 日起不再担任本公司督察长; 邹树波先生自 2017 年 9 月 21 日起担任本公司督察长。
- 4、 本公司于 2017 年 11 月 11 日发布公告: 自 2017 年 11 月 9 日起, 陈兵先生担任本公司董事长, 章硕麟先生不再代任本公司董事长。

基金托管人:

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

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 60,000 元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 3 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	
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。

3. 本基金本期无新增席位，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	成交金额	占当期回购	成交金额	占当期权证成

		总额的比例		成交总额的 比例		交总额的比例
中信证券	-	-	7,101,091,000.00	100.00%	-	-

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

12.1 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	20170101-20170103	100,000,000.00	84,883.88	100,084,883.88	0.00	0.00%
机构	2	20170101-20171231	200,068,777.90	207,554,621.65	207,402,386.68	200,221,012.87	51.23%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

注：红利再投资计入申购份额。

12.2 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

二〇一八年三月二十九日