上投摩根天添盈货币市场基金

2018 年第 3 季度报告

2018 年 9 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：二〇一八年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根天添盈货币
基金主代码	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
报告期末基金份额总额	120,806,708.04 份
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。		
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		
下属分级基金的基金简称	天添盈 A 类	天添盈 B 类	天添盈 E 类
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	2,617,120.16 份	-份	118,189,587.88 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)		
	天添盈A类	天添盈B类	天添盈E类
1.本期已实现收益	18,082.64	-	952,655.97
2.本期利润	18,082.64	-	952,655.97
3.期末基金资产净值	2,617,120.16	-	118,189,587.88

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。

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 本报告期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A类:

阶段	净值收益率①	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	0.6635%	0.0018%	0.3403%	0.0000%	0.3232%	0.0018%

2、天添盈B类:

阶段	净值收益率①	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	-	-	-	-	-	-

3、天添盈 E 类：

阶段	净值收益率①	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	0.7016%	0.0018%	0.3403%	0.0000%	0.3613%	0.0018%

注：本基金收益分配按日结转份额。

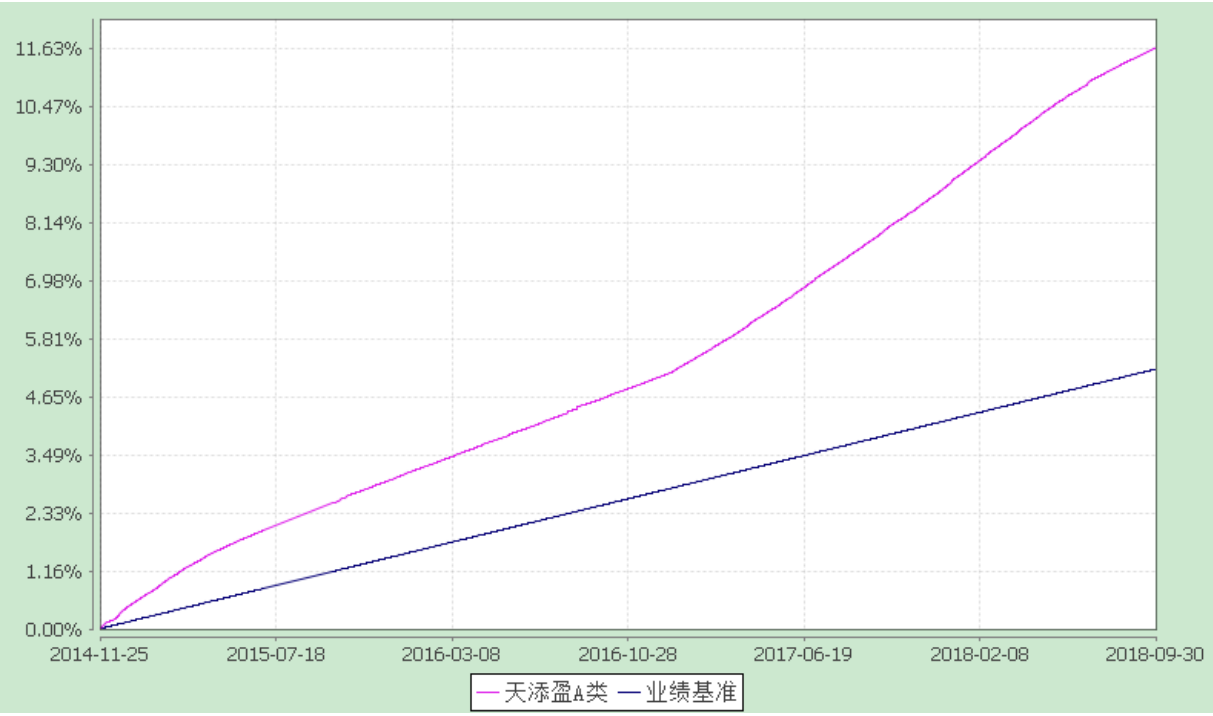
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根天添盈货币市场基金

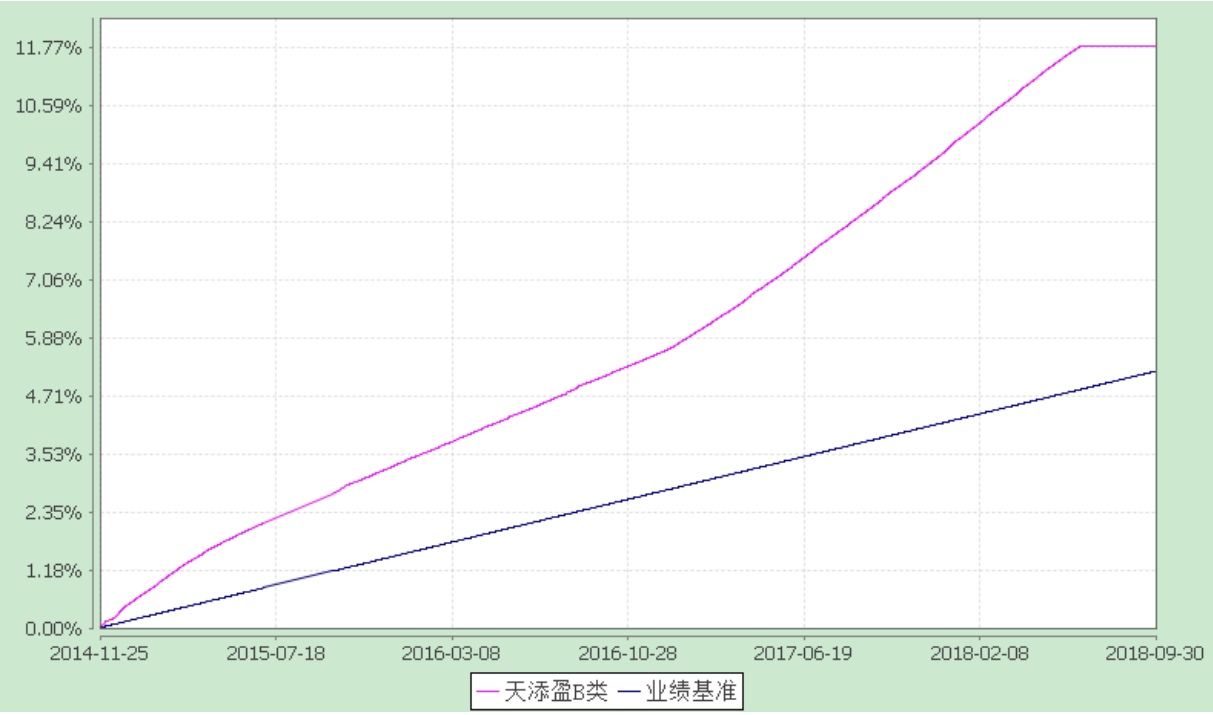
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014 年 11 月 25 日至 2018 年 9 月 30 日)

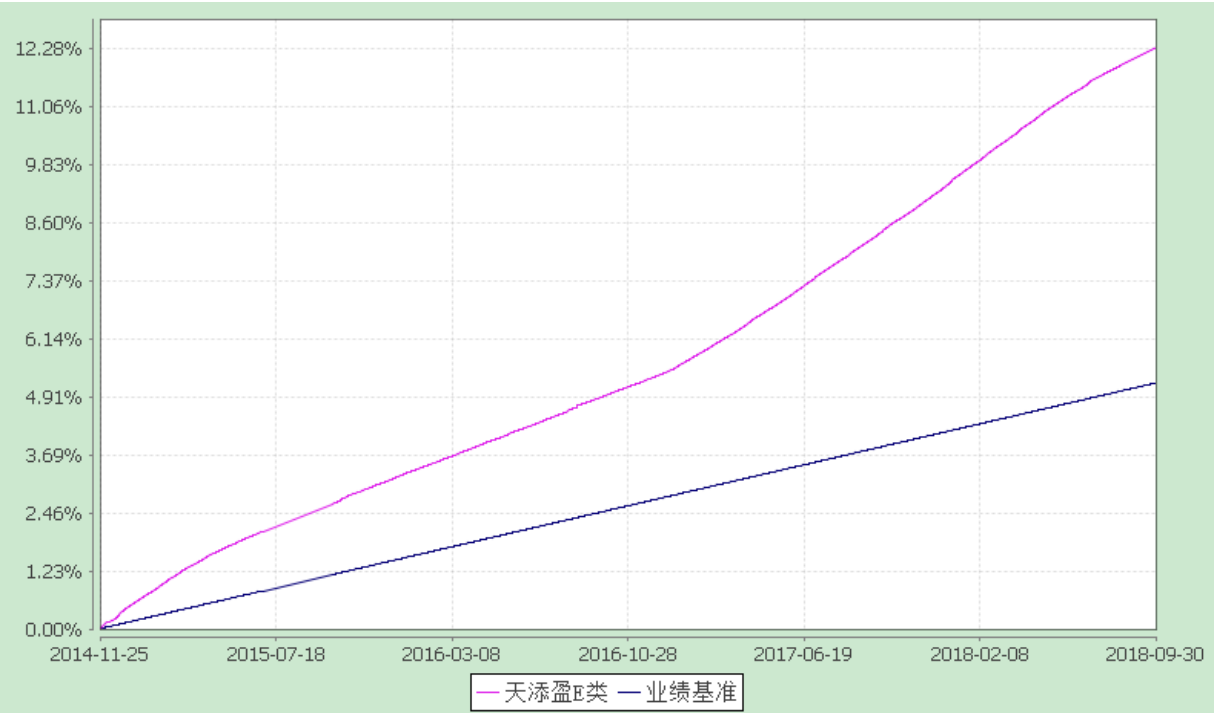
1、天添盈 A 类



2、天添盈 B 类



3、天添盈 E 类



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2018年9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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	本基金基金经理	2017-08-18	-	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 公平交易专项说明

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、交易方向等的分析，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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：无。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

从三季度公布的数据来看，经济继续保持平稳运行：工业增加值和消费数据平稳；固定资产投资受基建投资的疲软拖累，增速继续下滑，而制造业投资和房地产投资则较为稳健；进出口保持较快增长；食品和能源价格上涨推动 CPI 小幅上行；PPI 小幅回落；官方制造业 PMI 继续位于扩张区间，但 9 月份数据显示制造业景气度有所回落；新增人民币贷款同比增加较多；社融数据逐步好转,其中企业债券融资恢复明显，而表外融资仍是净减少。

政策方面，7 月底的政治局会议做出一些部署，明确去杠杆方向不变，但要把握好

节奏和力度；货币政策要把好货币供给闸门；财政要更加积极，将体现在减税和基建领域补短板等方面。根据4月出台的资管新规，央行、银保监会和证监会各自出台了配套文件，其中央行发布了资管新规的补充通知，在延续资管新规总体要求的同时，对市场关注的一些问题作了进一步的明确，主要对过渡期内的一些安排做了适度调整，总体更加务实温和。货币政策继续保持流动性合理充裕，流动性投放结构上，央行减少了公开市场操作（本季回笼4700亿），同时增加了期限相对较长的MLF操作（本季净增9625亿），一方面是引导和鼓励资金流向实体经济，尤其是小微企业；另一方面为地方债密集发行提供平稳的流动性环境。

市场方面，资金面整体较为宽松。7天回购价格基本在2.5%-3%的区间内波动，季末报于3%；3个月期Shibor先在7月延续下行走势，而后8、9月保持平稳，季末报于2.85%。国债收益率曲线较上季末陡峭化，1年期和10年期分别下行19和上行13个基点，至2.96%和3.61%。同业存单发本季发行5万亿，较2季度有所减少，发行利率下行明显，从发行期限看，半年期以上占比显著提高。

本基金在三季度资产配置以协议存款、同业存单和短期限的逆回购为主；在市场收益率下行的形势下，以组合流动性安全为前提，适度拉长资产配置期限，以提升收益水平。

展望后市，中美贸易摩擦暂未看到缓和迹象，令经济增长承压，但随着稳增长政策的效果逐步显现，将较大程度上对冲掉贸易摩擦的不利影响。考虑到当前银行间市场流动性已经较为充裕，同时全球主要经济体货币政策逐步回归正常化，央行会坚持稳健中性的政策取向，继续通过优化流动性投放的结构，提升金融服务实体经济的能力。本基金将继续把安全性和流动性放在首位，做好信用风险和流动性风险管控，合理配置各类资产的仓位和久期，努力为投资人创造安全且有竞争力的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A类、E类的净值增长率分别为0.6635%，0.7016%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

B类本报告期内无份额。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	29,959,622.00	24.42
	其中：债券	29,959,622.00	24.42
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	36,470,000.00	29.73
	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	54,913,306.70	44.76
4	其他资产	1,330,611.45	1.08
5	合计	122,673,540.15	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	0.16	
	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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	55
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

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。

5.3.2 报告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	58.71	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	17.35	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	-	-
	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）	24.83	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		100.90	-

5.4 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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,002,617.73	8.28
	其中：政策性金融债	10,002,617.73	8.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	19,957,004.27	16.52
8	其他	-	-
9	合计	29,959,622.00	24.80
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	170311	17进出11	100,000.00	10,002,617.73	8.28
2	111714282	17江苏银行CD282	100,000.00	9,991,833.93	8.27
3	111891924	18宁波银行CD029	100,000.00	9,965,170.34	8.25

5.7“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次
报告期内偏离度的最高值	0.0881%
报告期内偏离度的最低值	0.0034%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0517%

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。

5.8报告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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1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。

5.9.2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。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	30,920.07
2	应收证券清算款	516,484.24
3	应收利息	532,818.66
4	应收申购款	250,388.48
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,330,611.45

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	天添盈A类	天添盈B类	天添盈E类
本报告期期初基金份额总额	2,815,964.94	-	147,301,554.71
报告期基金总申购份额	588,917.36	31,083.80	41,151,366.31
报告期基金总赎回份额	787,762.14	31,083.80	70,263,333.14
报告期基金拆分变动份额	-	-	-
报告期期末基金份额总额	2,617,120.16	-	118,189,587.88

§7　基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1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、营业执照。

8.2存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3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。

上投摩根基金管理有限公司

二〇一八年十月二十四日