# 上投摩根天添盈货币市场基金 2019年半年度报告摘要

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:二〇一九年八月二十四日

## 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2019年8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30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 | 8,736,777,856.94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 | 8,620,415,380.62份 | –份 | 116,362,476.32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,基于对各部分市场的市场规模、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 | 李修滨 |
| | 联系电话 | 021-38794888 | 4006800000 |
| | 电子邮箱 | services@cifm.com | lixiubin@citichbank.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 |

## 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(2019年1月1日至2019年6月30日) | | |
|---|---|---|---|
| | 天添盈A类 | 天添盈B类 | 天添盈E类 |
| 本期已实现收益 | 89,054,437.37 | – | 1,361,212.34 |
| 本期利润 | 89,054,437.37 | – | 1,361,212.34 |
| 本期净值收益率 | 1.1897% | – | 1.2647% |
| 3.1.2期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) | | |
| | 天添盈A类 | 天添盈B类 | 天添盈E类 |
| 期末基金资产净值 | 8,620,415,380.62 | – | 116,362,476.32 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | – | 1.0000 |

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A类:

| 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 | 0.1909% | 0.0003% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0799% | 0.0003% |
| 过去三个月 | 0.5688% | 0.0002% | 0.3366% | 0.0000% | 0.2322% | 0.0002% |
| 过去六个月 | 1.1897% | 0.0005% | 0.6695% | 0.0000% | 0.5202% | 0.0005% |
| 过去一年 | 2.5157% | 0.0010% | 1.3500% | 0.0000% | 1.1657% | 0.0010% |
| 过去三年 | 9.2086% | 0.0022% | 4.0500% | 0.0000% | 5.1586% | 0.0022% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.6842% | 0.0026% | 6.2100% | 0.0000% | 7.4742% | 0.0026% |

2. 天添盈B类:

| 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 | – | – | – | – | – | – |
| 过去三个月 | – | – | – | – | – | – |
| 过去六个月 | – | – | – | – | – | – |
| 过去一年 | – | – | – | – | – | – |
| 过去三年 | 6.9527% | 0.0024% | 2.6667% | 0.0000% | 4.2860% | 0.0024% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.7702% | 0.0028% | 4.8267% | 0.0000% | 6.9435% | 0.0028% |

3. 天添盈E类:

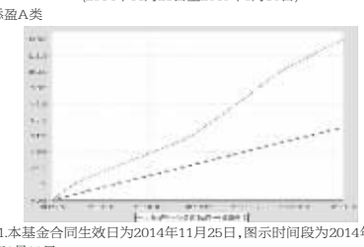
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.2032% | 0.0003% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0922% | 0.0003% |
| 过去三个月 | 0.6064% | 0.0002% | 0.3366% | 0.0000% | 0.2698% | 0.0002% |
| 过去六个月 | 1.2647% | 0.0005% | 0.6695% | 0.0000% | 0.5952% | 0.0005% |
| 过去一年 | 2.6648% | 0.0010% | 1.3500% | 0.0000% | 1.3148% | 0.0010% |
| 过去三年 | 9.6976% | 0.0022% | 4.0500% | 0.0000% | 5.6476% | 0.0022% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.4748% | 0.0026% | 6.2100% | 0.0000% | 8.2648% | 0.0026% |

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2019年6月30日)

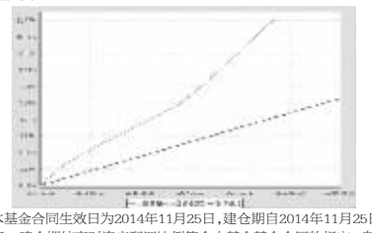
天添盈A类



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2019年6月30日。

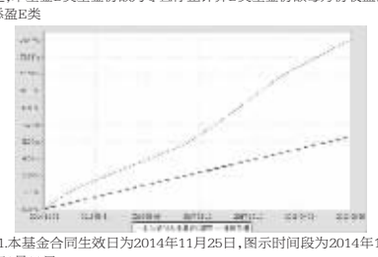
2.本基金建仓期自2014年11月25日至2015年5月24日, 建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同的规定。

天添盈B类



注:本基金合同生效日为2014年11月25日,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。自2018年6月22日起,本基金B类基金份额为零且停止计算B类基金份额每万份收益。

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2019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2019年6月底,公司旗下运作的基金共有六十四只,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、上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)、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、上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金、上投摩根安隆回报混合型证券投资基金、上投摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根富时发达市场REITs指数型证券投资基金(QDII)、上投摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、上投摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、上投摩根安裕回报混合型证券投资基金、上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金(QDII)、上投摩根核心精选股票型证券投资基金、上投摩根动力精选混合型证券投资基金、上投摩根领先优选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 | | |
| 鞠婷 | 本基金基金经理 | 2016-05-27 | – | 5年(金融领域从业经验14年) | 鞠婷女士,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,先后担任我公司货币市场投资部基金经理助理、基金经理,2015年7月至2018年12月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。 |

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。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同公平分配交易量;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%的次数为一次,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

从2019年上半年的经济数据看,宏观经济仍存在下行压力,但整体下行趋势放缓, 显现企稳迹象。2019年1-5月份, 全国规模以上工业企业实现利润总额23790.2亿元,同比下降2.3%,降幅比1-4月份收窄1.1个百分点;5月份,官方制造业PMI为49.4,预期49.9,前值50.1;财新中国制造业PMI50.2,与上月持平,经济展现出一定的韧性和惯性;5月CPI 同比上涨 2.7%,PPI 同比上涨 0.6%, 整体而言通胀仍将保持较为温和的状态;5 月出口同比增速为 1.1%,好于市场预期,进口同比-8.5%,差于预期,贸易形势保持稳定。

回顾上半年,一季度为了对冲MLF到期和鼓励银行实施债转股项目用于扶持小微企业,央行1月4日宣布下调金融机构存款准备金率1个百分点;二季度在外部环境变化、国内经济仍存在下行压力以及包商银行被接管事件的冲击下,货币政策取向保持稳健中性,在“管好货币供给总闸门”的同时适时适度实施逆周期调节,以信贷为锚,兼顾物价水平,最终实现稳经济目标。受此影响,7天回购价格除了缴税缴款以及季末月末等干扰因素外, 基本围绕利率走廊下限波动,1年期国开债收益率在2.44%-2.75%区间震荡,10年期国开债收益率在3.47%-3.80%区间震荡,6个月同业存单发行利率以及高等级信用债发行利率呈下行趋势。

本基金在上半年继续以流动性安全性为首要目标, 合理分配各类资产配置比例,坚决防范信用风险,无论在银行存单还是信用债配置方面都坚持高等级原则。同时控制组合整体风险,主动了解季末等关键时点客户现金流动向,做好流动性前瞻性管理,力争在提高基金收益水平的同时,维护组合安全性。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期上投摩根天添盈货币A份额净值增长率为:1.1897%, 同期业绩比较基准收益率为:0.6695%,

上投摩根天添盈货币E份额净值增长率为:1.2647%, 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

展望未来,政策会根据内外部环境的变化,在“稳增长”与“调结构”之间不断进行平衡, 同时也会关注在主动化解金融风险过程中对流动性和实体经济带来的影响。操作上,本基金会继续保持稳健的投资风格,严格防范信用风险,无论在银行存单还是信用债投资中都坚守高等级投资原则,遵守各项监管要求,确保组合流动性和安全性,谨记货币基金现金管理工具的原则,密切关注海内外市场及监管政策变化,灵活调整资产配置,力争为投资者提供稳健的长期回报。

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90,415,649.71元,实际分配收益90,415,649.71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

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《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,对上投摩根天添盈货币市场基金2019年上半年的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,履行了托管人的义务,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。

本报告期内应分配收益90,415,649.71元,实际分配收益90,415,649.71元。

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

本托管人认为,上投摩根基金管理管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的2019年半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

## 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:2019年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产: | | – | – |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 2,974,939,550.46 | 2,439,268,184.68 |
| 结算备付金 | | 24,537,000.00 | 5,711,918.19 |
| 存出保证金 | | – | 26,304.93 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 5,343,409,541.86 | 2,205,374,715.65 |
| 其中:股票投资 | | – | – |
| 基金投资 | | – | – |
| 债券投资 | | 5,343,409,541.86 | 2,205,374,715.65 |
| 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 | 293,941,000.00 | 683,999,015.00 |
| 应收证券清算款 | | 75,389,976.86 | 454,231.78 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 42,034,810.56 | 17,887,116.24 |
| 应收股利 | | – | – |
| 应收申购款 | | 893,020.53 | 25,740.99 |
| 递延所得税资产 | | – | – |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | – | – |
| 资产总计 | | 8,755,144,900.27 | 5,352,747,227.46 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018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 | | – | 99,999,730.00 |
| 应付证券清算款 | | 11,489,850.76 | – |
| 应付赎回款 | | 158,247.67 | 565,231.95 |
| 应付管理人报酬 | | 2,358,422.77 | 1,239,916.81 |
| 应付托管费 | | 714,673.55 | 375,732.39 |
| 应付销售服务费 | | 1,772,329.09 | 926,631.37 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 31,884.98 | 25,414.50 |
| 应交税费 | | 44,965.40 | 6,020.53 |
| 应付利息 | | – | 88,147.68 |
| 应付利润 | | 1,683,360.41 | 1,649,902.47 |
| 递延所得税负债 | | – | – |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 113,308.70 | 74,010.86 |
| 负债合计 | | 18,367,043.33 | 104,950,738.56 |
| 所有者权益: | | – | – |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 8,736,777,856.94 | 5,247,796,488.90 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | – | – |
| 所有者权益合计 | | 8,736,777,856.94 | 5,247,796,488.90 |
| 负债和所有者权益总计 | | 8,755,144,900.27 | 5,352,747,227.46 |

注:报告截止日2019年06月30日,基金份额总额8,736,777,856.94份,其中:A类基金份额净值1.0000元,基金份额8,620,415,380.62份,, E类基金份额净值1.0000元,基金份额116,362,476.32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:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 119,249,714.00 | 7,463,427.05 |
| 1.利息收入 | | 117,447,641.26 | 7,463,427.05 |
| 其中:存款利息收入 | 6.4.7.11 | 47,015,672.18 | 4,355,785.82 |
| 债券利息收入 | | 62,697,464.12 | 1,296,747.10 |
| 资产支持证券利息收入 | | – | – |
| 买入返售金融资产收入 | | 7,734,504.96 | 1,810,894.13 |
| 其他利息收入 | | – | – |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 1,802,072.74 | – |
| 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 | 1,802,072.74 | – |
| 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“-”号填列) | | – | – |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 6.4.7.17 | – | – |
| 减:二、费用 | | 28,834,064.29 | 902,617.45 |
| 1. 管理人报酬 | | 12,549,709.43 | 567,886.79 |
| 2. 托管费 | | 3,802,942.32 | 172,086.96 |
| 3. 销售服务费 | | 9,426,630.13 | 95,878.87 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | – | – |
| 5. 利息支出 | | 2,875,247.73 | – |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 2,875,247.73 | – |
| 6.税金及附加 | | 20,968.87 | – |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.19 | 158,565.81 | 66,764.83 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 90,415,649.71 | 6,560,809.60 |
| 减:所得税费用 | | – | – |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 90,415,649.71 | 6,560,809.60 |

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:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019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) | 5,247,796,488.90 | – | 5,247,796,488.90 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | – | 90,415,649.71 | 90,415,649.71 |
| 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) | 3,488,981,368.04 | – | 3,488,981,368.04 |
| 其中:1.基金申购款 | 3,721,664,081.78 | – | 3,721,664,081.78 |
| 2.基金赎回款 | -232,682,713.74 | – | -232,682,713.74 |
| 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) | – | -90,415,649.71 | -90,415,649.71 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 8,736,777,856.94 | – | 8,736,777,856.94 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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) | 390,806,073.76 | – | 390,806,073.76 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | – | 6,560,809.60 | 6,560,809.60 |
| 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) | -240,688,554.11 | – | -240,688,554.11 |
| 其中:1.基金申购款 | 393,971,679.53 | – | 393,971,679.53 |
| 2.基金赎回款 | -634,660,233.64 | – | -634,660,233.64 |
| 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) | – | -6,560,809.60 | -6,560,809.60 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 150,117,519.65 | – | 150,117,519.65 |

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:王大智,主管会计工作负责人:杨怡,会计机构负责人:张璐

6.4 报表附注

6.4.1 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2019年8月23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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019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2019年6月30日的财务状况以及2019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[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》、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》、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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1 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

无。

6.4.7.2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。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 12,549,709.43 | 567,886.79 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 5,938,358.94 | 1,830.78 |

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。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,802,942.32 | 172,086.96 |

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。

6.4.8.2.3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 2019年1月1日至2019年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | |
| | 天添盈A类 | 天添盈B类 | 天添盈E类 | 合计 |
| 上投摩根基金管理有限公司 | 10.72 | – | – | 10.72 |
| 浦发银行 | 970.71 | – | – | 970.71 |
| 合计 | 981.43 | – | – | 981.43 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 | | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | |
| | 天添盈A类 | 天添盈B类 | 天添盈E类 | 合计 |
| 上投