

信息披露

基金管理人:上海摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月三十日

1.1 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,保证报告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预示其未来表现,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基金合同。
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。
本报告自2015年1月1日起至2016年12月31日止。

§1 重要提示

§2 基金简介

基金简称	上投摩根添添宝货币
基金代码	000712
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	中国建设银行银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	68,737,229.62份
报告期末存续期	不定期
下属分级基金的基本情况	上投摩根添添宝货币A 上投摩根添添宝货币B
下属分级基金的交易代码	000712 000713
报告期末下属分级基金的份额	13,935,644.56份 54,801,585.07份

2.2 基金产品说明	本基金以投资于具有良好投资价值和持续高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的超额收益。
投资目标	本基金综合考虑各类资产的收益性、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的基础上,力争为基金份额持有人创造长期稳定的投资回报。本基金以短期固定收益类资产为投资对象,基于对各细分市场的基本面、宏观经济、各子品种的流动性、相对收益、信用风险以及投资组合平均期限等因素进行综合判断,合理配置资产,追求基金资产的长期增值。本基金通过投资于国内外的固定收益类资产,力争实现基金资产的长期增值。本基金通过投资于国内外的固定收益类资产,力争实现基金资产的长期增值。本基金通过投资于国内外的固定收益类资产,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金通过投资于国内外的固定收益类资产,力争实现基金资产的长期增值。本基金通过投资于国内外的固定收益类资产,力争实现基金资产的长期增值。本基金通过投资于国内外的固定收益类资产,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证全债指数收益率
风险特征	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 基金管理人和其他托管人	基金管理人:上海摩根基金管理有限公司 基金托管人:中国建设银行银行股份有限公司
名称	上海摩根基金管理有限公司
负责人	胡娟
联系电话	021-38794888
电子邮箱	shm@shimf.com
客户服务电话	400-880-4000
网址	021-20324000

2.4 信息披露方式
基金年度报告正文的管理人互联网网址: http://www.shimf.com
基金年度报告备置地点: 基金管理人基金人的办公场所

§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

项目	2015年	2014年11月25日至2015年12月31日	2014年11月25日至2015年12月31日	2014年11月25日至2015年12月31日	2014年11月25日至2015年12月31日
3.1.1期间数据指标					
本期已实现收益	1,473,011.09	3,262,416.03	1,292,738.36	1,876,037.12	
本期公允价值变动收益	1,473,011.09	3,262,416.03	1,292,738.36	1,876,037.12	
3.1.2期末数据和指标					
期末基金资产净值	13,935,644.56	54,801,585.07	294,210.46	406,231.40	
3.1.3累计期末指标					
累计净值增长率	-3.0399%	3.3341%	0.4413%	0.4651%	

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,本期已实现收益即为本期利润。
2.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。

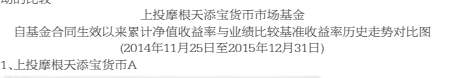
3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
1. 上投摩根添添宝货币A:

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-②
过去三个月	0.4730%	0.4030%	0.0000%	0.0019%
过去六个月	0.8570%	0.0015%	0.8555%	0.0019%
过去一年	2.5872%	0.0067%	1.3000%	0.0067%
自基金合同生效以来	3.0399%	0.0066%	1.4868%	0.0066%

2. 上投摩根添添宝货币B:

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-②
过去三个月	0.5348%	0.0010%	0.3403%	0.0019%
过去六个月	0.9796%	0.0016%	0.8800%	0.0021%
过去一年	2.3836%	0.0071%	1.3500%	0.0076%
自基金合同生效以来	3.3141%	0.0066%	1.4868%	0.0066%

3.2.2 基金净值表现
3.2.2.1 上投摩根添添宝货币A:



3.2.2.2 上投摩根添添宝货币B:



注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

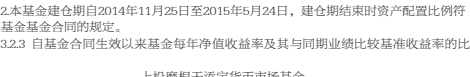


2. 上投摩根添添宝货币B:



注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:



2. 上投摩根添添宝货币B:



注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

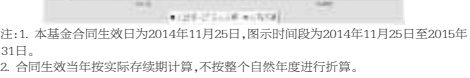


2. 上投摩根添添宝货币B:

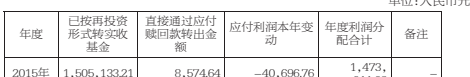


注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

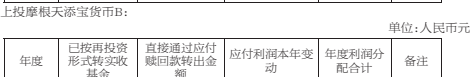


2. 上投摩根添添宝货币B:



注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:



2. 上投摩根添添宝货币B:



注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

2. 上投摩根添添宝货币B:

注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

2. 上投摩根添添宝货币B:

注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

2. 上投摩根添添宝货币B:

注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

2. 上投摩根添添宝货币B:

注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

2. 上投摩根添添宝货币B:

注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

2. 上投摩根添添宝货币B:

注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

2. 上投摩根添添宝货币B:

注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

2. 上投摩根添添宝货币B:

注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

2. 上投摩根添添宝货币B:

注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

2. 上投摩根添添宝货币B:

注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

2. 上投摩根添添宝货币B:

注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

2. 上投摩根添添宝货币B:

注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

2. 上投摩根添添宝货币B:

注:1.本基金合同生效日为2014年11月25日,图示时间为2014年11月25日至2015年12月31日。
2.本基金建仓期间为2014年11月25日至2015年6月24日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同的相关规定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 上投摩根添添宝货币A:

2. 上投摩根添添宝货币B:

