上投摩根货币市场基金 2016年年度报告摘要

2016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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月三十日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017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2016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	上投摩根货币	
基金主代码	370010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年4月13日	
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	93,883,307,915.61份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	上投货币A	上投货币B
下属分级基金的交易代码	370010	370010
报告期末下属分级基金的份额总额	141,671,321.62份	93,741,636,593.99份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过合理的资产选择，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	本基金投资管理将充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法，对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略首先审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，在风险与收益的配比中，力求将各类风险降到最低，并在控制投资组合良好流动性的基础上，为投资者获取稳定的收益。 利率预期策略：并际利率因应货币循环、季节因素或货币政策变动而产生波动，本基金将首先根据对国内外经济形势的预测，分析市场投资环境的变化趋势，重点关注利率趋势变化；其次，在判断利率变动趋势时，我们将重点考虑货币供给的预期效应(Money- supply Expectations Effect)、通货膨胀与费雪效应(Fisher Effect)以及资金流量变化(Flow of Funds)等，全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、债券市场政策趋势、物价水平变化趋势等因素，对利率走势形成合理预期，从而做出各类资产配置的决策。 估值策略：建立不同品种的收益率曲线预测模型，并通过这些模型进行估值，确定价格中枢的变动趋势，根据收益率、流动性、风险匹配原则以及债券的估值原则构建投资组合，合理选择不同市场中有投资价值的券种，并根据投资环境的变化相机调整。 久期管理：久期作为衡量债券利率风险的指标，反映了债券价格对收益率变动的敏感度，本基金努力把握久期与债券价格波动之间的量化关系，根据未来利率变化预期，以久期和收益率变化评估为核心，通过久期管理，合理配置投资品种。在预期利率下降时适度加大久期，在预期利率上升时适度缩小久期。 流动性管理：由于货币市场基金要保持高流动性的特性，本基金会紧密关注申购/赎回现金流情况，季节性资金流动、日历效应等，建立综合流动性预警指标，实现对基金资产的结构化管理，并结合持续性投资的方法，将回购/债券到期日进行均衡等量配置，以确保基金资产的整体变现能力。 随着国内货币市场的进一步发展，以及今后相关法律法规允许本基金可投资的金融工具出现时，本基金将于以深入分析并加以审慎评估，在符合本基金投资目标的前提下适时调整本基金投资对象。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险品种，其预期风险和预期收益率都低于股票基金、债券基金和混合基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡追	田青
	联系电话	021- 38794888	010- 67595096
	电子邮箱	services@cifm.com	tianqing12h@ccb.com
客户服务电话		400- 889- 4888	010- 67595096
传真		021- 20628400	010- 66275853

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	2016年		2015年		2014年	
	上投货币A	上投货币B	上投货币A	上投货币B	上投货币A	上投货币B
本期已实现收益	2,640,606.80	1,349,383,903.09	4,559,433.91	2,109,611,269.55	5,469,680.77	1,928,702,342.23
本期利润	2,640,606.80	1,349,383,903.09	4,559,433.91	2,109,611,269.55	5,469,680.77	1,928,702,342.23
本期净值收益率	2.0543%	2.2993%	2.6756%	2.9221%	3.8365%	4.0853%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
	上投货币A	上投货币B	上投货币A	上投货币B	上投货币A	上投货币B
期末基金资产净值	141,671,321.62	93,741,636,593.99	161,674,878.96	69,142,743,785.23	209,186,468.29	67,181,852,944.35
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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.本基金收益分配按月结转份额。

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. 上投货币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	0.5591%	0.0012%	0.3393%	0.0000%	0.2198%	0.0012%
过去六个月	1.0636%	0.0011%	0.6787%	0.0000%	0.3849%	0.0011%
过去一年	2.0543%	0.0012%	1.3500%	0.0000%	0.7043%	0.0012%
过去三年	8.8047%	0.0027%	4.0500%	0.0000%	4.7547%	0.0027%
过去五年	15.4111%	0.0024%	6.8178%	0.0001%	8.5933%	0.0023%
自基金合同生效起至今	30.8472%	0.0036%	18.7504%	0.0014%	12.0968%	0.0022%

2. 上投货币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
过去三个月	0.6196%	0.0012%	0.3393%	0.0000%	0.2803%	0.0012%
过去六个月	1.1854%	0.0011%	0.6787%	0.0000%	0.5067%	0.0011%
过去一年	2.2993%	0.0012%	1.3500%	0.0000%	0.9493%	0.0012%
过去三年	9.5895%	0.0027%	4.0500%	0.0000%	5.5395%	0.0027%
过去五年	16.8012%	0.0024%	6.8178%	0.0001%	9.9834%	0.0023%
自基金合同生效起至今	34.5740%	0.0036%	18.7504%	0.0014%	15.8236%	0.0022%

注：本基金合同生效日为2005年4月13日。

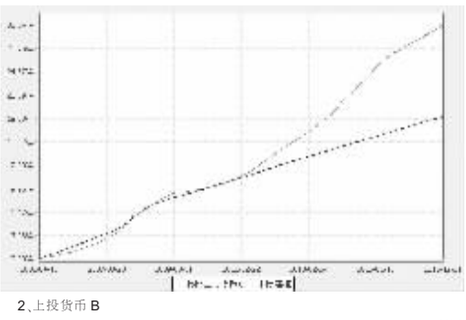
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根货币市场基金

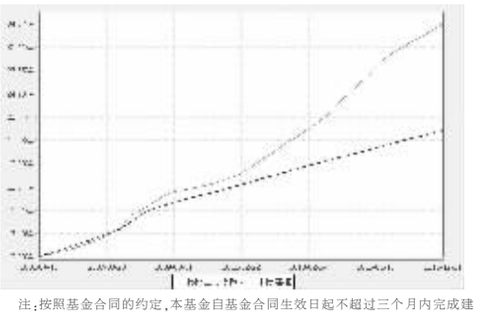
自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005年4月13日至2016年12月31日)

1、上投货币A



2、上投货币B



注：按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效日起不超过三个月内完成建仓。截止2005年07月13日，本基金已根据基金合同完成建仓且资产配置比例符合本基金基金合同规定。

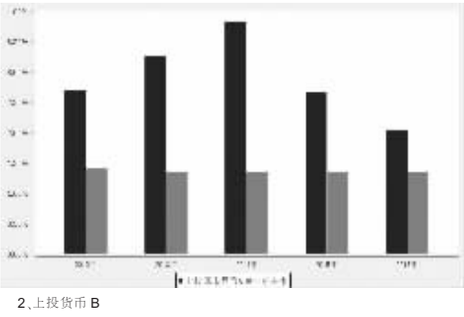
本基金合同生效日为2005年04月13日。图示时间段为2005年04月13日至2016年12月31日。

3.2.3 过去五年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

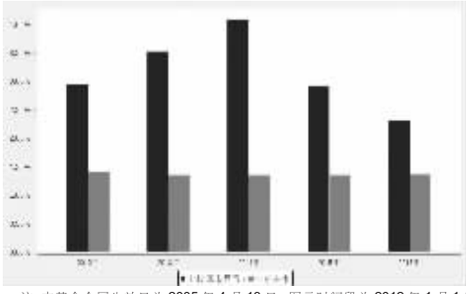
上投摩根货币市场基金

过去五年基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

1、上投货币A



2、上投货币B



注：本基金合同生效日为2005年4月13日。图示时间段为2005年04月13日至2016年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

上投货币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
2016年	2,332,383.47	291,581.07	16,642.26	2,640,606.80	-
2015年	3,755,181.32	896,444.41	-92,191.82	4,559,433.91	-
2014年	4,841,360.72	726,872.63	-98,552.58	5,469,680.77	-
合计	10,928,925.51	1,914,898.11	-174,102.14	12,669,721.48	-

上投货币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
2016年	1,276,242,085.28	57,647,989.14	15,493,828.67	1,349,383,903.09	-
2015年	2,080,496,436.94	51,933,627.06	-22,818,794.45	2,109,611,269.55	-
2014年	1,853,459,678.90	58,565,971.24	16,676,692.09	1,928,702,342.23	-
合计	5,210,198,201.12	168,147,587.44	9,351,726.31	5,387,697,514.87	-

§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2016年12月底，公司管理的基金共有五十二只，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和上投摩根全球多元配置证券投资基金。

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	2009-09-17	-	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，担任固定收益部总监，2009年9月起任上投摩根货币市场基金经理，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宝货币市场基金和上投摩根天添宝货币市场基金基金经理。
王化鑫	本基金基金经理	2016-07-29	-	10年	上海财经大学金融工程学士，2007年7月起加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任客服助理、交易助理、交易员、资深交易员、固定收益首席交易员、基金经理助理，自2016年7月起担任上投摩根货币市场基金基金经理。
王化鑫	本基金基金经理助理	2015-2-13	2016-7-29	10年	上海财经大学金融工程学士，2007年7月起加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任客服助理、交易助理、交易员、资深交易员、固定收益首席交易员、基金经理助理，自2016年7月起担任上投摩根货币市场基金基金经理。
郭毅	本基金基金经理助理	2015-11-5	2016-9-5	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天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。

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进行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%的次数为三次，均发生在纯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

2016年，宏观经济基本面延续疲弱格局，全年GDP增速6.7%，工业增加值、固定资产投资增速、社会消费品零售增速均继续回落，出口下降幅度扩大，进口下降幅度缩窄。PPI降幅不断缩小，并在9月份转正，四季度CPI重回2%上方，但通胀压力暂时不大。M2增速11.3%，人民币贷款增速13.5%，均较上年有所下滑。

央行在2016年一季度降低了一次存款准备金率，但并未进行降息操作，逆回购、MLF等日常公开市场操作逐渐替代降息降准，成为央行运用的主要货币政策工具。下半年，央行逐步拉长逆回购及MLF等操作期限，市场资金成本上行，且年底中央经济工作会议提及货币政策稳健中性，把控货币闸门，防风险、降杠杆也成为央行稳健货币政策的关键词。在此过程中，债券市场在全年大部分时间依然走牛，虽然上半年“营改增”、银行MPA考核对市场形成阶段性冲击，但一年期国开债收益率还是最低降到了2.24%，紧贴央行“利率走廊”的下限2.25%，十年期国债收益率最低降到了2.70%以下。年底，受到国内经济出现企稳迹象、通胀预期上升，资金面持续偏紧因素叠加影响，债券市场快速调整，一年期国开债和十年期国债收益率上行至全年高点4.00%和3.37%，国债和国开债收益率曲线均平坦化上移，随后在央行释放流动性、银行加大对非银融出后，市场有所恢复。

由于2016年资金成本的大幅波动，甚至与不断走低的债券收益率出现倒挂，本基金判断该情况无法长时间维持，逐步增加了回购及同业存款的配置比例，降低了债券仓位，因此在年底债券市场快速调整的过程中，受到的影响较小。同时，由于对年底资金面紧张的预期，本基金维持了较高的回购和同业存款配置比例，在年底资金利率大幅上行的过程中，不仅保证了投资组合的高流动性和安全性，也有效的提高了收益率水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A类和B类的净值收益率分别为2.0543%和2.2993%，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2017年，美国已进入加息周期，人民币汇率面临一定压力，国内防风险、降杠杆进程不断推进，通胀压力暂时不大。央行货币政策的基调将维持稳健中性，以财政、税收等政策支持经济结构调整转型更加具有操作空间。在此背景下，市场资金成本较2016年抬升，本基金对债券市场维持谨慎观点，在投资过程中，将坚持以流动性、安全性为货币基金运作首要目标，严格防范风险，保持谨慎稳健的投资风格，在此基础上合理把握市场机会，为投资者争取稳健有竞争力的投资收益。

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

本基金于成立后的每月25日进行收益分配(如遇25日为节假日则顺延至下个工作日)，收益分配采用红利再投资方式，按月结转份额。2016年本基金A类收益分配金额为2,640,606.80元，B类收益分配金额为1,349,383,903.09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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为A类2,640,606.80元，B类1,349,383,903.09元。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

上投摩根货币市场基金2016年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所有限公司审计、注册会计师陈玲、曹阳签字出具了“无保留意见的审计报告”(普华永道中天审字(2017)第20559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：上投摩根货币市场基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	34,237,392,271.92	19,209,276,114.27
结算备付金		656,682,877.27	788,797,619.05
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	14,484,585,718.03	21,834,637,128.32
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		14,484,585,718.03	21,834,637,128.32
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	49,685,504,000.00	26,792,200,000.00
应收证券清算款		-	214,967,741.14
应收利息	7.4.7.5	337,601,226.22	505,551,033.05
应收股利		-	-
应收申购款		1,855,065.64	16,690,712.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		99,403,621,159.08	69,362,120,348.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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		5,448,198,306.54	-
应付赎回款		44,026.02	703,085.98
应付管理人报酬		18,623,888.27	18,947,334.62
应付托管费		5,643,602.53	5,741,616.56
应付销售服务费		588,212.96	606,983.66
应付交易费用	7.4.7.7	12,372.50	8,300.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		46,800,834.65	31,290,363.72
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	402,000.00	404,000.00
负债合计		5,520,313,243.47	57,701,684.54
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	93,883,307,915.61	69,304,418,664.19
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		93,883,307,915.61	69,304,418,664.19
负债和所有者权益总计		99,403,621,159.08	69,362,120,348.73

注：报告截止日2016年12月31日，A类和B类基金份额净值均为1.0000元，基金份额总额93,883,307,915.61份，其中A类基金份额141,671,321.62份，B类基金份额93,741,636,593.99份。

7.2 利润表

会计主体：上投摩根货币市场基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		1,612,386,386.86	2,437,545,232.90
1.利息收入		1,621,844,444.19	2,436,974,486.72
其中：存款利息收入	7.4.7.11	520,411,188.42	895,035,848.13
债券利息收入		490,050,805.07	627,722,623.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		611,382,450.70	914,216,015.26
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-9,458,057.33	570,746.18
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	-9,458,057.33	570,746.18
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		260,361,876.97	323,374,529.44
1. 管理人报酬		194,659,464.04	241,803,762.05
2. 托管费		58,987,716.32	73,273,867.16
3. 销售服务费		6,210,101.61	7,766,862.25
4. 交易费用	7.4.7.18	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	504,595.00	530,037.98
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,352,024,509.89	2,114,170,703.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,352,024,509.89	2,114,170,703.46

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：上投摩根货币市场基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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)	69,304,418,664.19	-	69,304,418,664.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,352,024,509.89	1,352,024,509.89
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)	24,578,889,251.42	-	24,578,889,251.42
其中：1.基金申购款	346,300,181,978.47	-	346,300,181,978.47
2.基金赎回款	-321,721,292,727.05	-	-321,721,292,727.05
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)	-	-1,352,024,509.89	-1,352,024,509.89
五、期末所有者权益(基金净值)	93,883,307,915.61	-	93,883,307,915.61
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	67,391,039,412.64	-	67,391,039,412.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,114,170,703.46	2,114,170,703.46
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)	1,913,379,251.55	-	1,913,379,251.55
其中：1.基金申购款	343,955,439,581.65	-	343,955,439,581.65
2.基金赎回款	-342,042,060,330.10	-	-342,042,060,330.10
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)	-	-2,114,170,703.46	-2,114,170,703.46
五、期末所有者权益(基金净值)	69,304,418,664.19	-	69,304,418,664.19

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”)证监基金字[2005]第15号《关于同意上投摩根货币市场基金募集的批复》核准，由上投摩根富林明基金管理有限公司(后更名为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991,196,238.02元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第38号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根货币市场基金基金合同》于2005年4月13日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为991,360,522.73份基金份额，其中认购资金利息折合164,284.71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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《上投摩根货币市场基金招募说明书》的有关约定，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类基金份额和B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500,000份，即降级为A类基金份额持有人。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金；一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在397天以内(含397天)的债券；期限在一年以内(含一年)的债券回购；期限在一年以内(含一年)的中央银行票据以及中国证监会、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3月29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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016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2016年12月31日的财务状况以及2016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。

7.4.6 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