上投摩根天添宝货币市场基金 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	上投摩根天添宝货币	
基金主代码	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	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	961,345,203.45份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	上投摩根天添宝货币A	上投摩根天添宝货币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总额	9,374,606.62份	951,970,596.83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基础上，力争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。

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	胡迪	田青
	联系电话	021-38794888	010-67595096
	电子邮箱	services@cifm.com	tianqing1zh@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11月25日（基金合同生效日）至2014年12月31日	
	上投摩根天添宝货币A	上投摩根天添宝货币B	上投摩根天添宝货币A	上投摩根天添宝货币B	上投摩根天添宝货币A	上投摩根天添宝货币B
本期已实现收益	145,372.72	1,009,677.07	1,473,011.09	3,262,416.03	1,292,738.36	1,876,037.12
本期利润	145,372.72	1,009,677.07	1,473,011.09	3,262,416.03	1,292,738.36	1,876,037.12
本期净值收益率	1.6147%	1.8595%	2.5872%	2.8359%	0.4413%	0.4651%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
	上投摩根天添宝货币A	上投摩根天添宝货币B	上投摩根天添宝货币A	上投摩根天添宝货币B	上投摩根天添宝货币A	上投摩根天添宝货币B
期末基金资产净值	9,374,606.62	951,970,596.83	13,935,644.55	54,801,585.07	294,210,677.28	405,231,400.45
期末基金份额净值	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. 上投摩根天添宝货币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	0.4854%	0.0019%	0.3403%	0.0000%	0.1451%	0.0019%
过去六个月	0.8692%	0.0016%	0.6805%	0.0000%	0.1887%	0.0016%
过去一年	1.6147%	0.0015%	1.3537%	0.0000%	0.2610%	0.0015%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.7036%	0.0051%	2.8405%	0.0000%	1.8631%	0.0051%

2. 上投摩根天添宝货币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	0.5461%	0.0019%	0.3403%	0.0000%	0.2058%	0.0019%
过去六个月	0.9913%	0.0016%	0.6805%	0.0000%	0.3108%	0.0016%
过去一年	1.8595%	0.0015%	1.3537%	0.0000%	0.5058%	0.0015%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	5.2353%	0.0051%	2.8405%	0.0000%	2.3948%	0.0051%

注：本基金收益分配按日结转份额。

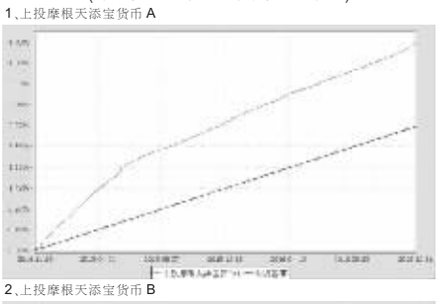
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根天添宝货币市场基金

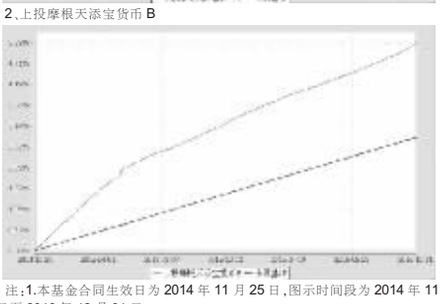
自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年11月25日至2016年12月31日)

1、上投摩根天添宝货币A



2、上投摩根天添宝货币B



注：1.本基金合同生效日为2014年11月25日，图示时间段为2014年11月25日至2016年12月31日。

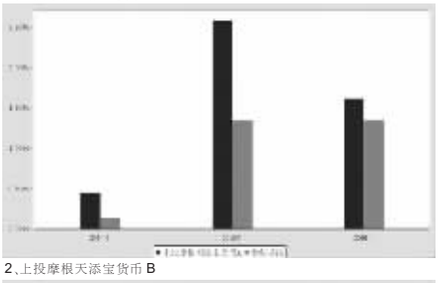
2.本基金建仓期自2014年11月25日至2015年5月24日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同的规定。

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

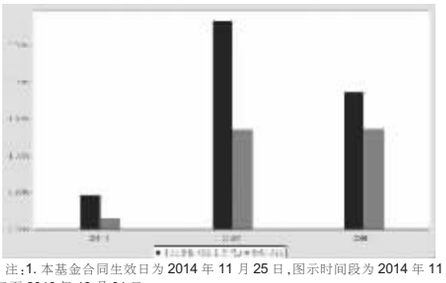
上投摩根天添宝货币市场基金

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、上投摩根天添宝货币A



2、上投摩根天添宝货币B



注：1.本基金合同生效日为2014年11月25日，图示时间段为2014年11月25日至2016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

上投摩根天添宝货币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	144,101.31	432.50	838.91	145,372.72	-
2015年	1,505,133.21	8,574.64	-40,696.76	1,473,011.09	-
2014年	1,251,166.30	-	41,572.06	1,292,738.36	-
合计	2,900,400.82	9,007.14	1,714.21	2,911,122.17	-

上投摩根天添宝货币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	827,195.92	-	182,481.15	1,009,677.07	-
2015年	3,318,537.05	-	-56,121.02	3,262,416.03	-
2014年	1,816,120.45	-	59,916.67	1,876,037.12	-
合计	5,961,853.42	-	186,276.80	6,148,130.22	-

§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	2014-11-25	-	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。
鞠婷	本基金基金经理	2016-05-27	-	3年（金融领域从业经验12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，担任现分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兴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。
王之远	本基金基金经理助理	2016-9-1	-	1年	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任高级资金管理岗，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。

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、《上投摩根天添宝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年经济保持平稳运行，供给侧改革初见成效。全年GDP同比增长6.7%，虽较上年的6.9%有所降低，但却在四季度出现弱复苏的迹象；CPI走势前低后高，全年通胀水平为2%，较上年的1.4%明显上升；PPI持续改善，并于9月由负转正；10月起官方制造业PMI连续三个月位于51上方，反映出市场对未来经济向好的信心不断增强。

2016年货币政策稳健中性，全年仅降准一次。相对于信号更强的“降息降准”，央行更多借助公开市场操作和中期借贷便利（MLF）等金融工具，通过调整量、价、期限完成基础货币投放。受金融去杠杆、债券违约事件、MPA考核、“营改增”、英国脱欧、美国大选等诸多因素影响，2016年债券市场牛熊交替，波动较大，10年期国债收益率在2.64%和3.37%间起伏。尤其是后两个月，市场资金紧张程度不断加剧，引发债券市场的剧烈调整，1年期国开债收益率在12月20日飙升至4%的年内最高点。

在上半年信用债违约事件多发的形势下，本基金资产配置以利率债和逆回购为主。四季度债券市场剧烈调整，本基金由于提前做好流动性前瞻管理，维持组合较高的流动性，受到的冲击有限；于此同时，在确保流动安全的前提下，有效利用资金价格上涨的时机，增加逆回购和协议存款配置，取得良好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A类和B类的净值增长率分别为1.6147%和1.8595%，同期业绩比较基准收益率为1.3537%。

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，在“稳增长”的背景下，经济短期企稳无忧，但中长期面临的下行压力依然较大。为防范金融风险，央行或将延续当前稳健中性的货币政策。此外，汇率、外储、房价、海外政治经济等方面的不确定因素依然很多，预计资金面和债券市场仍会有一定波动。本基金在新的一年中将继续保持谨慎稳健的投资风格，做好流动性风险和信用风险管理，在在债券市场波动时，债券投资采取“低仓位、短久期”的稳健策略，同时利用资金价格的波动，做好逆回购和协议存款的“择时”，增厚收益，规范投资，勤勉尽责，不辜负基金份额持有人信任。

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1,155,049.79元，实际分配收益1,155,049.79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

报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，出现该情况的时间范围为2016年5月13日至2016年8月4日，2016年8月9日至2016年11月2日。

基金管理人拟调整本基金运作方式，加大营销力度，提升基金规模，方案已报监管机关。

§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145,372.72元，B类1,009,677.07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

上投摩根天添宝货币市场基金金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”（编号：普华永道中天审字(2017)第20530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：上投摩根天添宝货币市场基金

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	575,088,964.71	4,934,242.91
结算备付金		1,094,545.45	638,571.43
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	49,912,019.98	15,013,821.16
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		49,912,019.98	15,013,821.16
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	448,978,827.57	48,000,000.00
应收证券清算款		-	3,830.55
应收利息	7.4.7.5	1,241,537.08	250,754.90
应收股利		-	-
应收申购款		321,292.48	2,100.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,076,637,187.27	68,843,320.95
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		114,983,191.65	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		36,260.08	21,243.47
应付托管费		10,987.90	6,437.44
应付销售服务费		2,850.61	3,854.47
应付交易费用	7.4.7.7	1,702.57	885.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		187,991.01	4,670.95
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	69,000.00	69,000.00
负债合计		115,291,983.82	106,091.33
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	961,345,203.45	68,737,229.62
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		961,345,203.45	68,737,229.62
负债和所有者权益总计		1,076,637,187.27	68,843,320.95

注：报告截止日2016年12月31日，A类基金份额和B类基金份额净值均为1.00元，基金份额总额961,345,203.45份，其中A类基金份额9,374,606.62份，B类基金份额951,970,596.83份。

7.2 利润表

会计主体：上投摩根天添宝货币市场基金

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		1,504,158.80	5,659,940.91
1.利息收入		1,504,158.80	5,473,941.13
其中：存款利息收入	7.4.7.11	281,332.05	2,102,522.47
债券利息收入		318,738.54	1,675,426.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		904,088.21	1,695,991.77
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-	185,999.78
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	-	185,999.78
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		349,109.01	924,513.79
1. 管理人报酬		166,799.77	515,214.04
2. 托管费		50,545.52	156,125.47
3. 销售服务费		26,821.81	130,278.37
4. 交易费用	7.4.7.18	-	-
5. 利息支出		-	10,806.16
其中：卖出回购金融资产支出		-	10,806.16
6. 其他费用	7.4.7.19	104,941.91	112,089.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,155,049.79	4,735,427.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,155,049.79	4,735,427.12

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根天添宝货币市场基金

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）	68,737,229.62	-	68,737,229.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,155,049.79	1,155,049.79
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）	892,607,973.83	-	892,607,973.83
其中：1.基金申购款	963,250,716.78	-	963,250,716.78
2.基金赎回款	-70,642,742.95	-	-70,642,742.95
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）	-	-1,155,049.79	-1,155,049.79
五、期末所有者权益（基金净值）	961,345,203.45	-	961,345,203.45
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）	699,442,077.73	-	699,442,077.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,735,427.12	4,735,427.12
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）	-630,704,848.11	-	-630,704,848.11
其中：1.基金申购款	174,154,645.25	-	174,154,645.25
2.基金赎回款	-804,859,493.36	-	-804,859,493.36
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）	-	-4,735,427.12	-4,735,427.12
五、期末所有者权益（基金净值）	68,737,229.62	-	68,737,229.62

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

上投摩根天添宝货币市场基金（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623号《关于同意上投摩根天添宝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《上投摩根天添宝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696,344,938.37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717号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根天添宝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696,374,790.98份基金份额，其中认购资金利息折合29,852.61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《上投摩根天添宝货币市场基金招募说明书》和《上投摩根天添宝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5,000,000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《上投摩根天添宝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》、《上投摩根天添宝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。

7.4.5 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
中国建设银行股份有限公司（中国建设银行）	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