上投摩根民生需求股票型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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：二〇一六年一月二十二日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月21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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根民生需求股票
基金主代码	000524
交易代码	000524
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月14日
报告期末基金份额总额	315,944,860.64份
投资目标	本基金主要投资于民生需求相关行业的上市公司，分享中国经济增长模式转变带来的民生需求行业的投资机会，在控制风险的前提下力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将通过系统和深入的基本面研究，重点投资于与民生相关行业的上市公司，将不低于80%的非现金基金资产投资于民生需求相关行业，分享中国经济增长模式转变带来的投资机会。在行业配置层面，本基金将从行业生命周期、行业景气度、行业竞争格局等多角度，综合评估各个行业的投资价值，对基金资产在行业间分配进行安排。在个股选择层面，本基金将主要采用"自下而上"的方法，在备选行业内部通过定量与定性相结合的分析方法，综合分析上市公司的业绩质量、成长性和估值水平等各方面信息，精选具有良好成长性、估值合理的个股。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×85%+中债总指数收益率×15%
风险收益特征	本基金属于股票型基金产品，预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险收益水平的基金产品。
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

§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(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	104,211,685.26
2.本期利润	128,628,099.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.4419
4.期末基金资产净值	743,132,843.79
5.期末基金份额净值	2.352

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。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、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增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

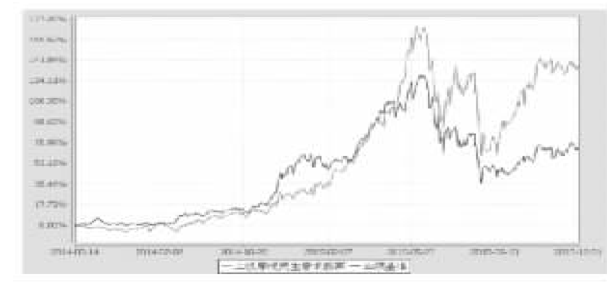
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	26.11%	1.90%	14.37%	1.42%	11.74%	0.48%

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

上投摩根民生需求股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年3月14日至2015年12月31日)



注：本基金合同生效日为2014年3月14日，图示时间段为2014年3月14日至2015年12月31日。

本基金建仓期自2014年3月14日至2014年9月12日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§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		
帅虎	本基金基金经理	2015-01-30	-	12年	帅虎先生，复旦大学硕士研究生，自2007年5月至2010年6月在海通证券担任分析师，自2010年6月至2011年6月在国投瑞银基金任投资经理。自2011年8月起加入上投摩根基金管理有限公司，自2014年11月起担任上投摩根双债增利债券型证券投资基金基金经理，自2014年12月起担任上投摩根智选30混合型证券投资基金基金经理，自2015年1月起同时担任上投摩根民生需求股票型证券投资基金基金经理。

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、《上投摩根民生需求股票型证券投资基金基金合同》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：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%的次数为两次，均发生在纯量化投资组合与主动管理投资组合之间。

4.4 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

2015年，市场波动极大，就全年而言，以互联网为代表的中小市值股票表现依然远优于蓝筹。考虑到市场的急剧波动，期间我们对组合里的成长股进行了适度的波段操作，以避免组合净值的激烈波动。当然，与市场提供的机会相比，我们的操作略显谨慎，仍有很大改进空间。

改革、转型与创新，无疑仍是中国经济的长期希望所在；对此，创业板指数在过去三年也淋漓尽致的加以展现。毋庸置疑，与优质成长股大幅上涨相伴的是，部分毫无估值可言的伪成长股、题材股也出现泡沫；创业板在经过调整之后，部分中小市值股票与蓝筹股的估值差距仍为全球所罕见。

如此极致的差距，依个人浅见，主要原因不外乎以下几点：首先，中国经济增速一直延续往下的趋势，投资者对于传统行业及公司的前景充满疑问；其次，企业上市仍有管制，优质成长股的供给相对稀缺；最后，个人投资者占比偏高。

现在，事情可能正在起变化。首先，宏观经济何时能寻找到新的中长期增速区间，我们无法准确判断；但是，随着管理层各项改革措施的落实，中国经济可能正接近或处于这个区间。其次，注册制、战略新兴板、新三板等诸多资本市场改革措施的推进，将逐步改变优质成长股供给相对稀缺的现状。

因此，我们有理由相信，从稍微长期的角度看，如此极致的估值差距，未来逐步收敛至合理水平的趋势，将是不可避免的。或许，这一趋势已经在进行：2015年上半年表现抢眼的部分几乎毫无估值的伪成长股，在年中之后的表现，也许已经是估值收敛趋势的某种展现形式。

展望未来，我们深信，近年几乎被视为贬义词的价值投资，仍将是长期致胜的最优选择。成功的成长股投资，仍然是基于对企业长期价值的判断；真价值与真成长，并无本质差别。在一个处于成熟期甚至衰退期的行业里，部分优质公司仍能通过其竞争优势来提升其市占率，并维持其业绩的稳定增长。对于部分被严重低估的蓝筹股，组合会继续保持适当配置，我们愿意等待总是迟到的理性。对于新兴产业，我们继续看好军民融合、环保、移动互联网、传媒、教育、新能源汽车等领域，并关注其中有核心竞争力、估值合理的优质企业。当然，部分仍处于产业培育期的行业及个股，业绩暂无、前景很美、可能适合阶段性操作。最后，有品牌积淀、会不断创新、能保持领先优势的优质消费公司，仍是我们长期投资的极佳选择。

我们将继续秉持敬畏市场、勤勉尽责的态度，精选个股、均衡配置，力争为持有人创造更多价值。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为26.11%，同期业绩比较基准收益率为14.37%。

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	权益投资	681,228,654.42	78.06
	其中：股票	681,228,654.42	78.06
2	固定收益投资	26,219,602.40	3.00
	其中：债券	26,219,602.40	3.00
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	105,055,043.09	12.04
7	其他各项资产	60,185,936.52	6.90
8	合计	872,689,236.43	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	357,392,106.21	48.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	53,450,801.11	7.19
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,911,464.32	0.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,997,600.00	5.79
J	金融业	66,839,820.10	8.99
K	房地产业	94,798,210.00	12.76
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	16,946,300.00	2.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	41,892,352.68	5.64
S	综合	-	-
	合计	681,228,654.42	91.67

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300367	东方网力	869,763	60,622,481.10	8.16
2	600315	上海家化	1,499,919	59,231,801.31	7.97
3	000869	张裕A	1,280,030	58,599,773.40	7.89
4	002574	明牌珠宝	2,599,960	55,223,150.40	7.43
5	002077	大港股份	2,200,000	43,890,000.00	5.91
6	002325	洪涛股份	2,800,000	43,764,000.00	5.89
7	600036	招商银行	2,399,990	43,175,820.10	5.81
8	300027	华谊兄弟	1,009,941	41,892,352.68	5.64
9	300083	劲胜精密	800,000	37,856,000.00	5.09
10	300104	乐视网	600,000	36,108,000.00	4.86

5.4 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	12,400,220.60	1.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,819,381.80	1.86
	其中：政策性金融债	13,819,381.80	1.86
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,219,602.40	3.53

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018001	国开1301	138,180	13,819,381.80	1.86
2	019509	15国债09	123,730	12,400,220.60	1.67

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的上海家化联合股份有限公司（下称：上海家化，股票代码：600315）于2015年6月12日收到中国证券监督管理委员会上海监管局下发的《行政处罚决定书》（编号：沪[2015]4号）。上海家化与其构成关联关系的吴江市黎里沪江日用化学品厂（下称：沪江日化）之间于2009年至2012年发生的采购、销售及资金拆借等关联交易情况未按规定予以披露。上海家化的前述行为违反了《证券法》第六十三条关于"发行人、上市公司依法披露的信息，必须真实、准确、完整，不得有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏"的规定，构成了《证券法》第一百九十三条"发行人、上市公司或者其他信息披露义务人未按照规定披露信息，或者所披露的信息有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的"的行为。根据《证券法》第一百九十三条第一款的规定，中国证券监督管理委员会上海监管局决定：(1)对上海家化给予警告，并处以30万元罚款；(2)对相关责任人分别给予警告及不同金额罚款。

对上述股票投资决策程序的说明：本基金管理人在投资上海家化前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库，由研究员跟踪并分析。上述事件发生后，本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分析，认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，因此，没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

除上述股票外，本基金投资的其余前九名证券的发行主体本期未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。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	945,869.80
2	应收证券清算款	55,709,055.82
3	应收股利	-
4	应收利息	1,031,439.82
5	应收申购款	2,499,571.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,185,936.52

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300104	乐视网	36,108,000.00	4.86	筹划重大事项

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	254,014,164.43
报告期基金总申购份额	204,736,431.31
减：报告期基金总赎回份额	142,805,735.10
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	315,944,860.64

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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民生需求股票型证券投资基金设立的文件；
2. 《上投摩根民生需求股票型证券投资基金基金合同》；
3. 《上投摩根民生需求股票型证券投资基金基金托管协议》；
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和营业执照。

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
二〇一六年一月二十二日

上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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：交通银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一六年一月二十二日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月21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2015年10月1日起至12月31日止。

§2基金产品概况

基金简称	上投摩根岁岁盈定期开放债券			
基金主代码	000257			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2013年8月28日			
报告期末基金份额总额	674,405,515.23份			
投资目标	在合理充分的定量分析及定性研究基础上，在风险可控的原则下，通过参与固定收益类资产的投资封闭运作，力争获取超越基准的稳健回报。			
投资策略	1、债券类属配置策略 本基金将对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，评估不同债券板块之间的相对投资价值，确定债券类属配置策略，并根据市场变化及时进行调整。 2、久期管理策略 本基金通过对影响债券投资的宏观经济变量和宏观经济政策等因素的综合分析，预测未来的市场利率的变动趋势，判断债券市场对上述因素及其变化的反应，并据此积极调整债券组合的久期。 3、收益率曲线策略 本基金在确定固定收益资产组合平均久期的基础上，将结合收益率曲线变化的预测，适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合，并进行动态调整。 4、信用策略 本基金将利用内部信用评级体系对债券发行人及其发行的债券进行信用评估，并结合外部信用评级机构的信用评级，分析违约风险以及合理信用利差水平，判断债券的投资价值，谨慎选择债券发行人基本面良好、债券条款优惠的信用债进行投资。			
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)+0.5%			
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。			
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司			
基金托管人	交通银行股份有限公司			
下属分级基金的基金简称	上投摩根岁岁盈定期开放债券A	上投摩根岁岁盈定期开放债券B	上投摩根岁岁盈定期开放债券C	上投摩根岁岁盈定期开放债券D
下属分级基金的交易代码	000257	000765	000258	000766
报告期末下属分级基金的份额总额	322,426,259.72份	341,485,750.56份	4,387,562.84份	6,105,942.11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(2015年10月1日-2015年12月31日)			
	上投摩根岁岁盈定期开放债券A	上投摩根岁岁盈定期开放债券B	上投摩根岁岁盈定期开放债券C	上投摩根岁岁盈定期开放债券D
1.本期已实现收益	3,140,151.37	3,155,533.19	38,149.16	50,017.88
2.本期利润	3,880,212.04	3,940,488.97	48,197.02	64,015.88
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0120	0.0115	0.0110	0.0105
4.期末基金资产净值	332,788,624.07	353,046,299.81	4,520,094.68	6,298,268.63
5.期末基金份额净值	1.032	1.034	1.030	1.031

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。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、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、上投摩根岁岁盈定期开放债券A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	1.18%	0.07%	0.58%	0.01%	0.60%	0.06%

2、上投摩根岁岁盈定期开放债券B：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	1.17%	0.07%	0.58%	0.01%	0.59%	0.06%

3、上投摩根岁岁盈定期开放债券C：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	1.08%	0.06%	0.58%	0.01%	0.50%	0.05%

4、上投摩根岁岁盈定期开放债券D：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	0.98%	0.07%	0.58%	0.01%	0.40%	0.06%

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

上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年8月28日至2015年12月31日)

1. 上投摩根岁岁盈定期开放债券A：

注：本基金建仓期自2013年8月28日至2014年2月27日，建仓期结束时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2013年8月28日，图示时间段为2013年8月28日至2015年12月31日。

2. 上投摩根岁岁盈定期开放债券B：

注：本基金建仓期自2013年8月28日至2014年2月27日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

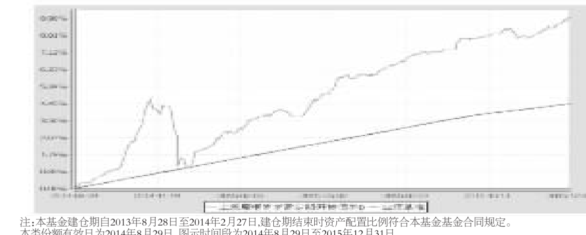
本类份额有效日为2014年8月29日，图示时间段为2014年8月29日至2015年12月31日。

3. 上投摩根岁岁盈定期开放债券C：

注：本基金建仓期自2013年8月28日至2014年2月27日，建仓期结束时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2013年8月28日，图示时间段为2013年8月28日至2015年12月31日。

4. 上投摩根岁岁盈定期开放债券D：



注：本基金建仓期自2013年8月28日至2014年2月27日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本类份额有效日为2014年8月29日，图示时间段为2014年8月29日至2015年12月31日。

§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		
赵峰	本基金基金经理，债券投资部总监	2013-08-28	2015-11-20	13年	上海财经大学金融学硕士，2003年4月至2006年5月在申银万国证券研究所担任研究员负责债券研究方面的工作；2006年6月至2011年3月在富国基金管理有限公司担任投资经理负责债券投资方面的工作；2011年4月加入上投摩根基金管理有限公司，2011年9月至2014年12月担任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理，2012年6月起任上投摩根分红添利债券型证券投资基金基金经理，2013年7月至2014年12月担任上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金经理，2013年8月至2015年11月担任上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金基金经理，自2014年6月起任上投摩根优信增利债券型证券投资基金基金经理，自2014年12月起同时担任上投摩根纯债添利债券型证券投资基金基金经理。
唐瑭	本基金基金经理	2015-05-19	-	8年	英国爱丁堡大学硕士，2008年2月至2010年4月任JPMorgan(EMEA)分析师，2011年3月加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任研究员及基金经理助理，自2015年5月起担任上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金基金经理，自2015年12月起同时担任上投摩根优化回报债券型证券投资基金和上投摩根轮动添利债券型证券投资基金基金经理。

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.赵峰先生为本基金首任基金经理，其任职日期指本基金基金合同生效之日。

3.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报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金基金合同》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：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%的次数为两次，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

四季度，经济疲弱，债券收益率整体下行，但受信用事件影响不乏波动。国庆长假之后公布的9月经济数据仍差强人意，工业增加值大幅回落，市场对央行再度双降的预期增强。四季度初期，在资金趋松、经济数据疲弱及货币政策宽松预期等多重因素的推动下，债券收益率快速下行，10年期国债收益率向下突破3%。10月23日，双降预期兑现，存款利率放开，中国完成利率市场化最后一步，27日央行同时下调公开市场7天逆回购利率10bp至2.25%，略有透支的债券市场开始出现调整。随后美联储议息会议强化了市场对于美联储12月份加息的预期，加之市场疑虑监管当局控制债市杠杆，债市收益率转降为升。11月6日证监会宣布重启IPO，债市收益率加速回升。11月中旬开始，央行提出的利率走廊管理稳定了市场对于货币政策的预期，加之机构为来年提前抢配，以中高等级信用债收益率快速下行为首带动收益率曲线整体下移。12月16日美联储加息落地，长债收益加速下行至季度最低点，10年期国开债收益率一度突破3.1%大关。中低等级信用债受信用事件频发影响，收益率下降幅度较小，中低等级信用利差扩大。

本基金9月底完成新的一个运作周期募集，在四季度初快速建仓，并在债市回调过程中吸纳筹码，拉长组合久期，使得基金在本季度既控制了回撤又受益于11月中旬之后的收益率下行。同时，由于实体经济和企业基本面恶化，信用风险频发，发债企业资质分化加剧，本基金提高了中高评级信用债的比例，降低组合信用风险曝露。

展望2016年一季度，中央经济工作会议对2016年的定位更加着重于中长期改革而非对经济的短期刺激，经济增长出现"L"型走势概率大于"V"型反转。而货币政策更着眼于维持货币环境的稳定，债市环境仍然较为健康。风险因素在于海外大宗商品价格及国内物价的阶段性走强，经济边际改善以及收益率过低而造成的债市波动。因此，本基金将维持中性杠杆，组合品种资质上移的操作策略，并根据市场情况择机参与高弹性品种的交易型机会。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A类份额净值增长率为1.18%，本基金C类基金份额净值增长率为1.08%，同期业绩比较基准收益率为0.58%。

本报告期本基金B类份额净值增长率为1.17%，本基金D类基金份额净值增长率为0.98%，同期业绩比较基准收益率为0.58%。

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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,048,900,819.17	94.59
	其中：债券	1,048,900,819.17	94.59
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,548,866.61	1.04
7	其他各项资产	48,479,642.40	4.37
8	合计	1,108,929,328.18	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4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	44,994,600.00	6.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	171,380,000.00	24.60
	其中：政策性金融债	171,380,000.00	24.60
4	企业债券	373,204,219.17	53.57
5	企业短期融资券	190,671,000.00	27.37
6	中期票据	268,651,000.00	38.56
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,048,900,819.17	150.56

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140202	14国开02	500,000	54,200,000.00	7.78
2	018002	国开1302	400,000	43,852,000.00	6.29
3	010107	21国债(7)	300,000	32,529,000.00	4.67
4	140208	14国开08	300,000	30,978,000.00	4.45
5	1282049	12铁道MTN2	300,000	30,840,000.00	4.43

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1报告期内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。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	82,742.02
2	应收证券清算款	26,081,852.38
3	应收股利	-
4	应收利息	22,315,048.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,479,642.40

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6开放式基金份额变动

单位：份

项目	上投摩根岁岁盈定期开放债券A	上投摩根岁岁盈定期开放债券B	上投摩根岁岁盈定期开放债券C	上投摩根岁岁盈定期开放债券D
本报告期期初基金份额总额	322,426,259.72	341,485,750.56	4,387,562.84	6,105,942.11
报告期基金总申购份额	-	-	-	-
减：报告期基金总赎回份额	-	-	-	-
报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	322,426,259.72	341,485,750.56	4,387,562.84	6,105,942.11

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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岁岁盈定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
2. 《上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
4. 《上投摩根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和营业执照。

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
二〇一六年一月二十二日

上投摩根天添宝货币市场基金

2015 第四季度 报告

2015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：二〇一六年一月二十二日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月21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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	68,737,229.62份	
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，形成对未来市场利率变动的预判，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。	
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	
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	13,935,644.55份	54,801,585.07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(2015年10月1日-2015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
1.本期已实现收益	90,135.50	383,509.46
2.本期利润	90,135.50	383,509.46
3.期末基金资产净值	13,935,644.55	54,801,585.07

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、上投摩根天添宝货币A：

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	0.4736%	0.0019%	0.3403%	0.0000%	0.1333%	0.0019%

2、上投摩根天添宝货币B：

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	0.5348%	0.0019%	0.3403%	0.0000%	0.1945%	0.0019%

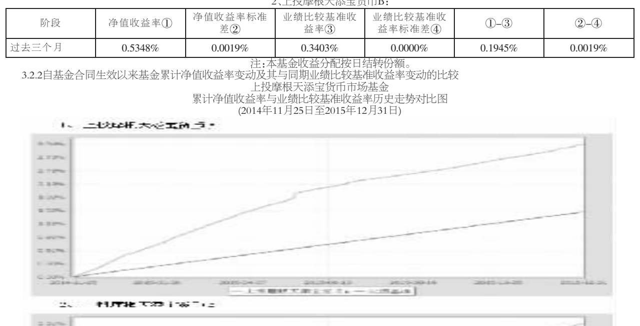
注：本基金收益分配按日结转份额。

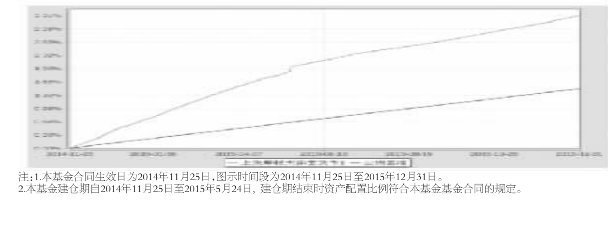
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根天添宝货币市场基金

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2015年12月31日)





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2015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。

§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		
王亚南	本基金基金经理	2014-11-25	2015-12-11	12年	复旦大学金融工程专业硕士。2003年至2007年，就职于海通证券股份有限公司研究所，任固定收益研究员。2007年6月加入国泰基金管理有限公司，任国泰金鹿保本基金基金经理助理。2008年6月加入上投摩根基金管理有限公司，自2008年11月至2015年12月任上投摩根货币市场基金基金经理，自2009年8月至2014年9月任上投摩根纯债债券型证券投资基金基金经理，自2014年6月至2015年12月任上投摩根优信增利债券型证券投资基金基金经理，自2014年8月至2015年12月担任上投摩根现金管理货币市场基金基金经理，自2014年11月至2015年12月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。
孟晨波	本基金基金经理、货币市场投资部总监	2014-11-25	-	7年（金融领域从业经验21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，先后担任固定收益部总监、货币市场投资部总监，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。

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.王亚南先生和孟晨波女士为本基金首任基金经理，其任职日期指本基金基金合同生效之日。

3.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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 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：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%的次数为两次，均发生在纯量化投资组合与主动管理投资组合之间。

4.4 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

2015年四季度，宏观经济依然未有太大改观，工业产出增速维持低位，固定资产投资增速和进出口数据继续下滑，仅社会消费品零售增速略有上行。CPI数据自八月的高点2%回落至1.5%附近，通胀水平保持温和。同时PMI数据未有起色，短期内经济增速或将继续滑落。

货币政策在四季度继续宽松，央行下调了存贷款基准利率及法定存款准备金率各一次，人民币新增贷款数据较三季度出现下滑。在此背景下，大量的配置需求使得债券市场年底迎来了一波快速上涨，收益率曲线呈现平坦化。政策性银行金融债短端利率下降30bps，中长端收益率下降接近60bps至3.10%，一年期与十年期利差已从三季度的110bps降至80bps。一年期与十年期国债期限利差更是从100bps快速缩小至50bps。

本基金在维持适当的债券投资比例同时，灵活把握回购市场与银行协议存款之间的相对优势，在回购市场利率年末上行的过程中加大了回购投资比例，同时降低了收益率相对较低的银行存款投资比例。

展望2016年，货币政策宽松环境将持续以支持实体经济转型。同时，财政政策、供给侧改革、以及对地产等行业的政策刺激是否能支持实体经济探底反弹还有待观察，目前看空债市动力不足。但长端债券收益率目前已经接近2008年的低点，短端收益率还有较大下行空间，在利差快速缩小后，短债无疑更具吸引力。同时需要关注人民币汇率走势及信用风险事件对债市走势的扰动。本基金将维持利率债及高等级信用债适度投资比例，同时择机在回购及银行存款之间灵活调整投资比例，在保持高流动性及安全性的情况下力争取得更高投资收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A类份额净值增长率为0.4736%，本基金B类基金份额净值增长率为0.5348%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

§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	15,013,821.16	21.81
	其中：债券	15,013,821.16	21.81
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	48,000,000.00	69.72
	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	5,572,814.34	8.09
4	其他资产	256,685.45	0.37
5	合计	68,843,320.95	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	0.32	
	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	25
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	37
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	14

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	77.94	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	7.27	-
	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)—180天	14.57	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.79	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	10,014,469.76	14.57
	其中：政策性金融债	10,014,469.76	14.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,999,351.40	7.27
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	15,013,821.16	21.84
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 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	150411	15农发11	100,000.00	10,014,469.76	14.57
2	011542005	15中航空SCP005	50,000.00	4,999,351.40	7.27

5.6"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	0.0301%
报告期内偏离度的最低值	0.0048%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0186%

5.7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。

5.8投资组合报告附注

5.8.1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。

5.8.2报告期内本基金不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3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。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	3,830.55
3	应收利息	250,754.90
4	应收申购款	2,100.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	256,685.45

5.8.5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	上投摩根天添宝货币A	上投摩根天添宝货币B
本报告期期初基金份额总额	23,236,944.00	97,969,045.07
报告期基金总申购份额	3,948,252.97	1,307,085.36
报告期基金总赎回份额	13,249,552.42	44,474,545.36
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	13,935,644.55	54,801,585.07

§7备查文件目录

7.1备查文件目录

1. 中国证监会批准上投摩根天添宝货币市场基金设立的文件；
2. 《上投摩根天添宝货币市场基金基金合同》；
3. 《上投摩根天添宝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。

7.2存放地点

基金管理人或基金托管人处。

7.3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

二〇一六年一月二十二日