

上投摩根天添盈货币市场基金
2019 年半年度报告摘要
2019 年 6 月 30 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。 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	lixubin@citicbank.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）。

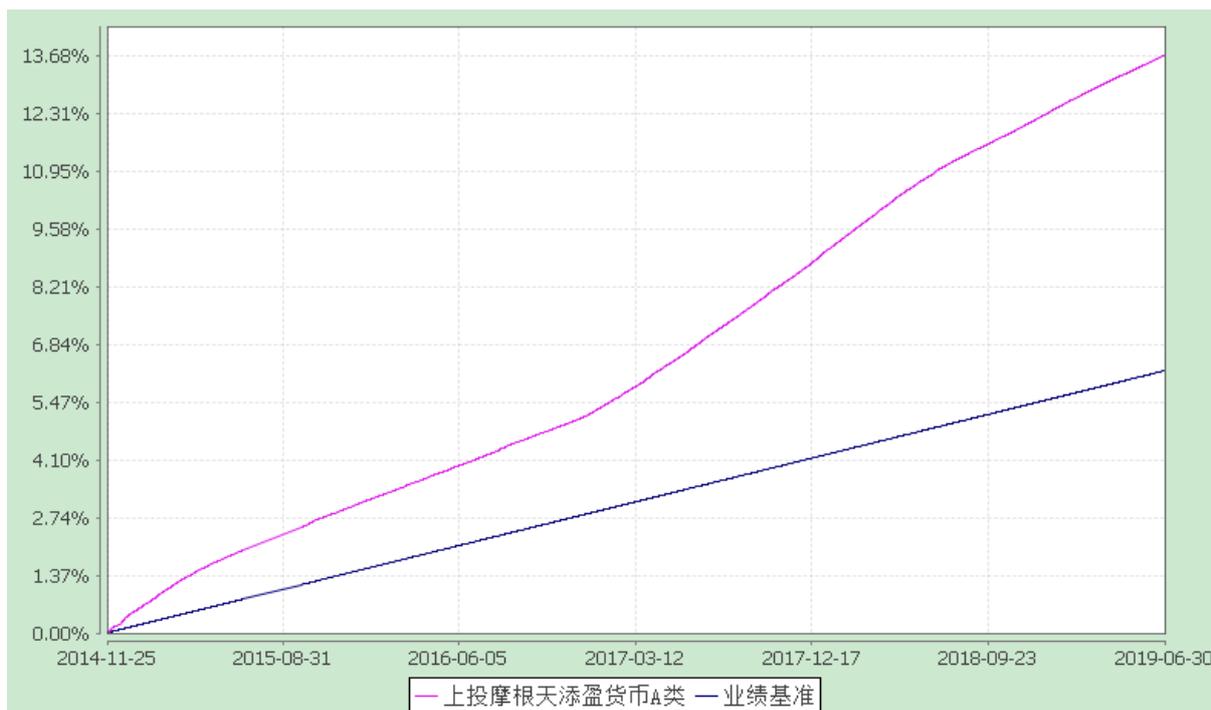
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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)

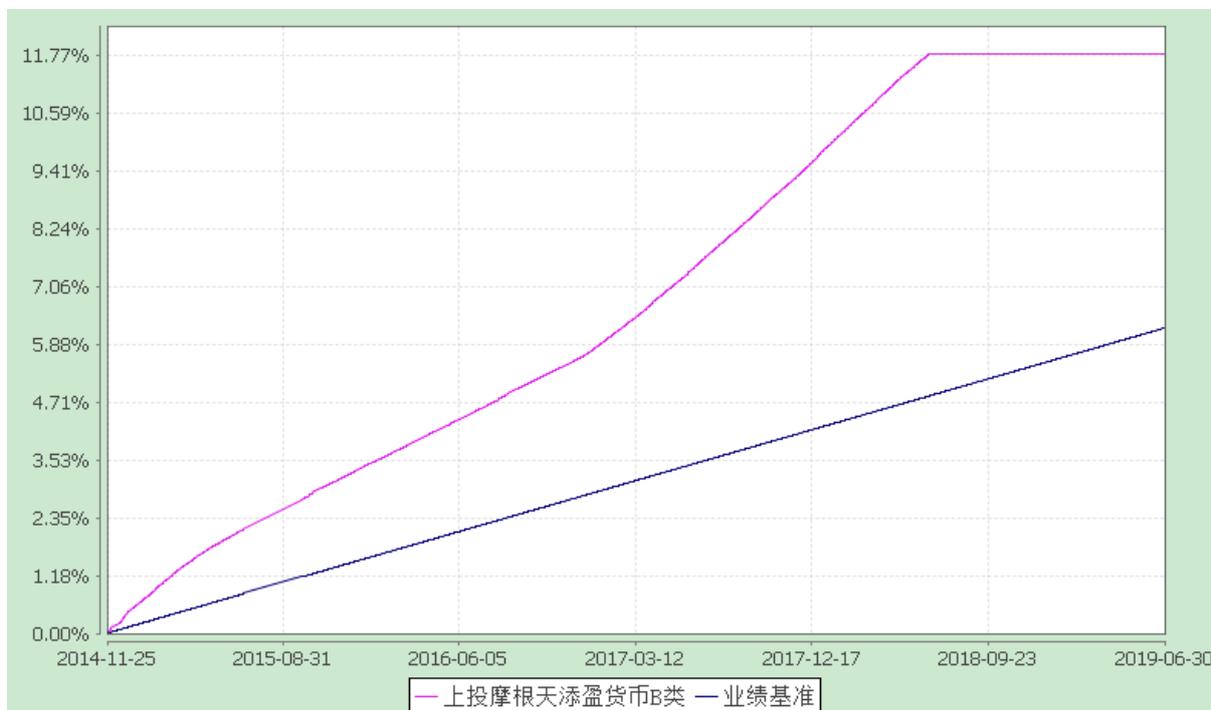
天添盈 A 类



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。

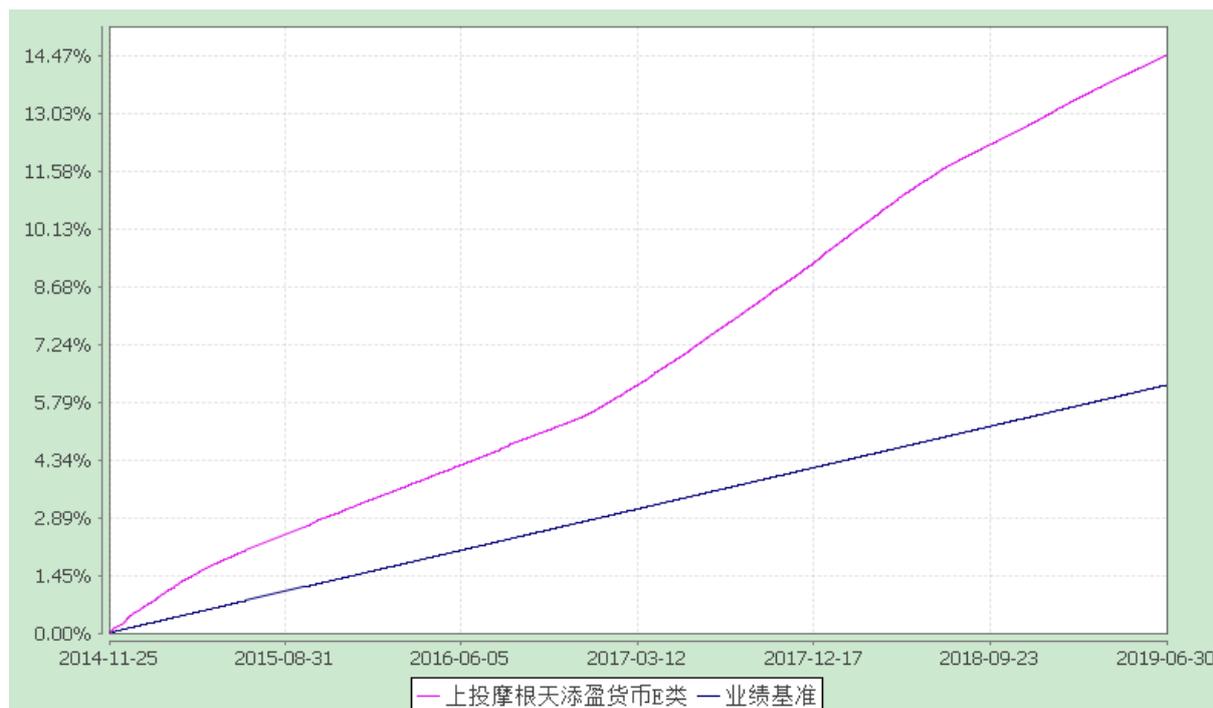
2.本基金建仓期自 2014 年 11 月 25 日至 2015 年 5 月 24 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同的规定。

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合规守信情况的说明

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 PMI 50.2，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，本基金将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投资基金行业从业经验。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合规守信、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，未发现有关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	3,488,981,368.04	-	3,488,981,368.04

少以“-”号填列)			
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量存单、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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.33\% / \text{当年天数。}$$

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数。}$$

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
上投摩根基金管理有限公司	14.47	8,696.83	83,588.18	92,299.48
浦发银行	1,830.08	-	-	1,830.08
合计	1,844.55	8,696.83	83,588.18	94,129.56

注：1. 基金销售服务费对 A 类基金份额，B 类基金份额和 E 类基金份额收取。

2. 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类基金份额资产净值 0.25%、B 类基金份额资产净值 0.01% 和 E 类基金份额资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给上投摩根基金管理有限公司，再由上投摩根基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

A 类的日销售服务费=前一日 A 类基金份额 X 0.25%/ 当年天数。

B 类的日销售服务费=前一日 B 类基金份额 X 0.01%/ 当年天数。

E 类的日销售服务费=前一日 E 类基金份额 X 0.10%/ 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2019年1月1日至2019年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中信银行	98,292,693.15	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

天添盈 A 类

份额单位：份

关联方名称	天添盈A类本期末 2019年6月30日		天添盈A类上年度末 2018年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
浦发银行	0.97	0.00%	0.97	0.00%

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	1,939,550.46	44,507.93	3,462,056.26	104,442.37
浦发银行	330,000,000.00	5,473,256.44	-	555,652.94

注：1.本基金的活期银行存款和部分定期存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。2. 本基金的部分定期银行存款存放于浦发银行，按银行约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

6.4.9 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	5,343,409,541.86	61.03
	其中：债券	5,343,409,541.86	61.03
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	293,941,000.00	3.36
	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	2,999,476,550.46	34.26
4	其他各项资产	118,317,807.95	1.35
5	合计	8,755,144,900.27	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.43	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	105
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	93

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

根据基金合同约定，本基金投资组合的平均剩余期限不超过 120 天。在本报告期内本基金未出现投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 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	20.77	0.13
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	25.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	12.00	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	9.89	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	31.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.59	0.13

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

在本报告期内本基金未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	109,486,015.09	1.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	580,455,608.49	6.64
	其中：政策性金融债	580,455,608.49	6.64
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	670,125,909.25	7.67
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,983,342,009.03	45.59
8	其他	-	-
9	合计	5,343,409,541.86	61.16
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	111918026	19 华夏银行 CD026	2,400,000.00	237,721,434.56	2.72
2	111804069	18 中国银行 CD069	2,000,000.00	199,512,313.02	2.28
3	111814151	18 江苏银行 CD151	2,000,000.00	199,288,031.64	2.28
4	111992734	19 重庆农村商行 CD013	2,000,000.00	198,983,841.08	2.28
5	111996593	19 宁波银行 CD074	1,500,000.00	149,645,243.61	1.71
6	111817182	18 光大银行 CD182	1,500,000.00	149,586,136.52	1.71
7	111812183	18 北京银行 CD183	1,500,000.00	149,184,548.20	1.71
8	111812200	18 北京银行 CD200	1,500,000.00	148,735,543.37	1.70
9	111904023	19 中国银行 CD023	1,500,000.00	146,284,438.12	1.67
10	190402	19 农发 02	1,200,000.00	119,642,810.19	1.37

7.7 “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
报告期内偏离度的最高值	0.0626%
报告期内偏离度的最低值	-0.0185%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0234%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期末未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期末未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	75,389,976.86
3	应收利息	42,034,810.56
4	应收申购款	893,020.53
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	118,317,807.95

7.9.4 其他需说明的重要事项

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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
天添盈 A 类	21,360	403,577.50	8,618,903,442. 92	99.98%	1,511,937.70	0.02%
天添盈 B 类	0	0.00	0.00	0.00%	0.00	0.00%
天添盈 E 类	17,680	6,581.59	2,030.22	0.00%	116,360,446.10	100.00 %
合计	39,040	223,790.42	8,618,905,473. 14	98.65%	117,872,383.80	1.35%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	个人	7,116,148.42	0.08%
2	个人	6,628,650.48	0.08%
3	个人	5,882,876.78	0.07%
4	个人	5,059,820.47	0.06%
5	个人	2,375,219.01	0.03%
6	个人	2,227,799.63	0.03%
7	个人	2,008,955.06	0.02%
8	个人	1,680,310.38	0.02%
9	个人	1,648,166.81	0.02%
10	个人	1,642,636.71	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人 所有从业人 员持有本基 金	天添盈 A 类	-	-
	天添盈 B 类	-	-
	天添盈 E 类	809,055.81	0.6953%
	合计	809,055.81	0.0093%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	天添盈 A 类	0
	天添盈 B 类	0
	天添盈 E 类	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	天添盈 A 类	0
	天添盈 B 类	0

	天添盈 E 类	0~10
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	天添盈 A 类	天添盈 B 类	天添盈 E 类
基金合同生效日（2014 年 11 月 25 日）基金份额总额	107,020,826.96	170,004,000.00	30,000,748.12
本报告期期初基金份额总额	5,153,662,565.27	-	94,133,923.63
本报告期基金总申购份额	3,580,772,624.71	-	140,891,457.07
减：本报告期基金总赎回份额	114,019,809.36	-	118,662,904.38
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,620,415,380.62	-	116,362,476.32

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：基金管理人于 2019 年 5 月 31 日公告，自 2019 年 5 月 31 日起，王大智先生担任公司总经理，章硕麟先生不再担任公司总经理。

基金托管人：

基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本报告期内，经中信银行股份有限公司董事会会议审议通过，聘任方合英先生为本行行长，任职资格于 2019 年 3 月 29 日获中国银行保险监督管理委员会批复核准。孙德顺先生因年龄原因不再担任本行执行董事、行长等职务。根据工作需要，任命杨璋琪先生担任本行资产托管部副总经理，主持资产托管部相关工作。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人、托管人未受稽查或处罚，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 交易单元的选择标准：

- 1) 资本金雄厚,信誉良好。
- 2) 财务状况良好,经营行为规范。
- 3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

5) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 交易单元的选择程序：

1) 本基金管理人定期召开会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进行评估，确定选用交易单元的券商。

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

4. 本基金本期无新增席位、注销席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	31,597,627,000.00	100.00%	-	-

上投摩根基金管理有限公司

二〇一九年八月二十四日