

# 华宝现金添益交易型货币市场基金 2018 年半年度报告（摘要）

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 24 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 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 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华宝添益	
场内简称	华宝添益	
基金主代码	511990	
交易代码	511990	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 12 月 27 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
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	27,552,060,904.98 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2013 年 1 月 28 日	
下属分级基金的基金简称:	华宝添益	华宝添益 B
下属分级基金的交易代码:	511990	001893
报告期末下属分级基金的份额总额	946,313,329.93 份	26,605,747,575.05 份

注：本基金场内基金份额（A 类基金份额）简称为“华宝添益”，基金份额净值为 100.00 元；场外基金份额（B 类基金份额）简称为“华宝添益 B”，基金份额净值为 1.00 元。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	保持本金的安全性和基金财产的流动性，追求高于比较基准的稳定收益。
投资策略	<p>1. 久期策略：基于对宏观经济环境的深入研究，预期未来市场利率的变化趋势，结合基金未来现金流的分析，确定投资组合平均剩余期限，把握买卖时机。</p> <p>2. 收益率曲线策略：收益率曲线策略是根据收益曲线的非平行移动调整资产组合，将预期到的变动资本化。</p> <p>3. 类属配置策略：类属配置策略主要实现两个目标：一是通过类属配置满足基金流动性需求，二是通过类属配置获得投资收益。</p> <p>4. 套利策略：基金管理人将在保证基金的安全性和流动性的前提下，适当参与市场的套利，捕捉和把握无风险套利机会，进行跨市场、跨品种操作，以期获得安全的超额收益。</p> <p>5. 逆回购策略：基金管理人将密切关注由于新股申购等原因导致的短期资金需求激增的机会，通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金拆借利率陡升的投资机会。</p> <p>6. 现金流管理策略：投资运作中本基金将采用均衡分布、滚动投资、优化期限配置等方法，加强流动性管理。</p>
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、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		华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	010—67595096
传真		021-38505777	010-66275853

### 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	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所

### § 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

基金级别	华宝添益	华宝添益 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日 )	报告期( 2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,782,007,584.58	850,575,474.31
本期利润	1,782,007,584.58	850,575,474.31
本期净值收益率	1.9555%	2.0450%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2018 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	94,631,332,993.76	26,605,747,575.05
期末基金份额净值	100	1.0000

注：1、所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、本基金收益分配按日结转份额。

#### 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

华宝添益

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	0.3090%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.1980%	0.0002%
过去三个月	0.9435%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.6069%	0.0004%
过去六个月	1.9555%	0.0005%	0.6695%	0.0000%	1.2860%	0.0005%
过去一年	3.9425%	0.0004%	1.3500%	0.0000%	2.5925%	0.0004%
过去三年	9.6119%	0.0020%	4.0500%	0.0000%	5.5619%	0.0020%
自基金合同生效日起至今	20.9197%	0.0026%	7.4379%	0.0000%	13.4818%	0.0026%

华宝添益 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
过去一个月	0.3288%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.2178%	0.0002%
过去三个月	1.0039%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.6673%	0.0004%
过去六个月	2.0450%	0.0004%	0.6695%	0.0000%	1.3755%	0.0004%
过去一年	4.1598%	0.0004%	1.3500%	0.0000%	2.8098%	0.0004%
自基金合同 生效日起至 今	9.1018%	0.0023%	3.5618%	0.0000%	5.5400%	0.0023%

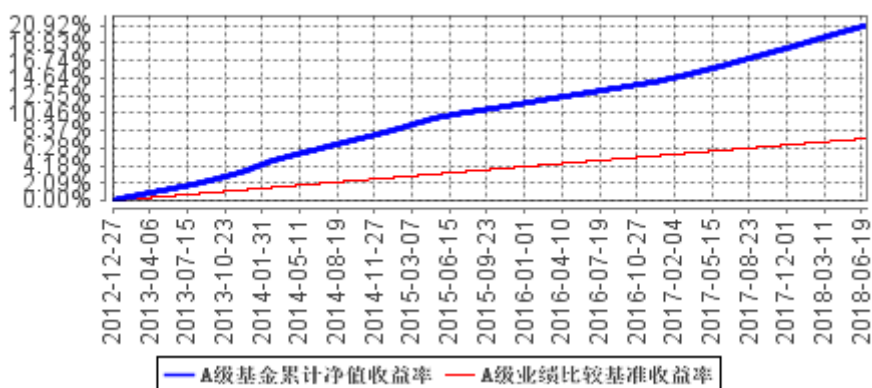
注：1、本基金业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

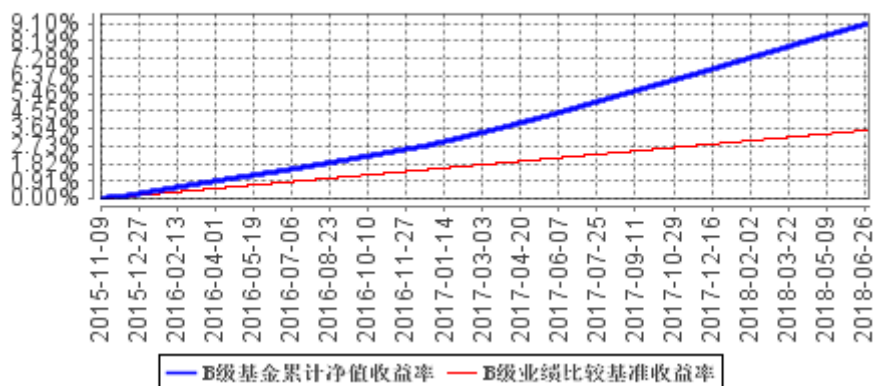
3、2015 年 11 月 9 日起，华宝现金添益基金新增场外基金份额（B 类基金份额，简称“华宝添益 B”），11 月 10 日起有资金进入申购，本报告中其累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的数据的计算起始日期为 2015 年 11 月 10 日。

### 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

A 级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、根据基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至 2013 年 6 月 27 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

2、2015 年 11 月 9 日起，华宝现金添益基金新增场外基金份额（B 类基金份额，简称“华宝添益 B”），11 月 10 日起有资金进入申购，本报告中其累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图的数据的计算起始日期为 2015 年 11 月 10 日。

## § 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

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2018 年 6 月 30 日），所管理的证券投资基金包括宝康系列基金、华宝多策略基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合基金、华宝收益增长基金、华宝先进成长基金、华宝行业精选基金、华宝海外中国成长基金、华宝大盘精选基金、华宝增强收益基金、华宝中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接基金、华宝新兴产业基金、华宝可转债基金、上证 180 成长 ETF、华宝上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、华宝医药生物基金、华宝资源优选基金、华宝添益货币市场基金、华宝服务优选基金、华宝创新优选基金、华宝生态中国基金、华宝量化对冲基金、华宝高端制造基金、华宝品质生活基金、华宝稳健回报基金、华宝事件驱动基金、华宝国策导向基金、华宝新价值基金、华宝新机遇基金、华宝医疗分级基金、华宝中证 1000 分级基金、华宝万物互联基金、华宝转型升级基金、华宝核心优势基金、华宝美国消费基金、华宝宝鑫纯债基金、华宝香港中小盘基金、华宝中证全指证券公司 ETF、华宝中证军工 ETF、华宝新活力基金、华宝沪深 300 指数增强基金、华宝未来主导产业基金、华宝新起点基金、华宝红利基金、华宝新飞跃基金、华宝新优选基金、华宝香港大盘基金、华宝智慧产业基金、华宝第三产业基金、华宝新优享基金、华宝银行 ETF、华宝价值发现基金、华宝香港本地基金、华宝中证 500 指数增强基金、华宝香港精选基金、华宝券商 ETF 联接基金，所管理的证券投资基金资产净值合计 153,280,039,194.92 元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
陈昕	固定收益部总经理、本基金基	2012 年 12 月 27 日	-	14 年	经济学学士。2003 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后在清算登记部、交易部、固定收益部从事固定收



	金经理、 华宝现 金宝货 币基金 经理				益产品相关的估值、交易、 投资工作，2011 年 11 月至 今任华宝现金宝货币市场 基金基金经理，2012 年 6 月-2014 年 2 月兼任华宝中 证短融 50 指数债券型证券 投资基金基金经理，2012 年 12 月起兼任华宝现金添 益交易型货币市场基金基 金经理。2015 年 3 月起任固 定收益部副总经理。2016 年 5 月起任固定收益部总经 理。
高文庆	本基金 基金经 理助理、 华宝新 起点混 合基金 经理、华 宝现金 宝货币 基金经 理	2015 年 8 月 27 日	-	8 年	硕士。2010 年 5 月加入华宝 基金管理有限公司，先后担 任助理风险分析师、助理产 品经理、信用分析师、高级 信用分析师、基金经理助理 等职务。2017 年 3 月起任华 宝现金宝货币市场基金、华 宝新起点灵活配置混合型 证券投资基金基金经理。
林昊	本基金 基金经 理助理、 华宝新 机遇混 合、华宝 新活力 混合、华 宝新价 值混合、 华宝新 回报混 合、华宝 新优选 混合基 金经理	2014 年 6 月 16 日	-	12 年	本科。2006 年 5 月加入华宝 基金管理有限公司，先后担 任渠道经理、交易员、高级 交易员、基金经理助理等职 务。2017 年 3 月起担任华宝 新价值灵活配置混合型证 券投资基金、华宝新机遇灵 活配置混合型证券投资基 金（LOF）、华宝新活力灵 活配置混合型证券投资基金 基金经理。2017 年 12 月至 2018 年 6 月任华宝新动力 一年定期开放灵活配置混 合型证券投资基金基金经 理。2017 年 12 月任华宝新 回报一年定期开放混合型 证券投资基金和华宝新优 选一年定期开放灵活配置 混合型证券投资基金基金 经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《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

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《货币市场基金监督管理办法》、《华宝现金添益交易型货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生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%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

## 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

2018 年上半年国内 GDP 增速 6.8%，同比下降 0.1 个百分点，经济走势整体稳中趋缓。投资方

面，1-6 月固定资产投资增速为 6.0%，其中制造业投资累计增速企稳回升至 6.8%，在土地购置费延后支付的影响下上半年地产投资增速较 17 年上半年和全年分别提高 1.2 和 2.7 个百分点，保持了较高的增速。1-6 月份社会消费品零售总额累计同比增长 9.4%，消费对 GDP 累计同比贡献率上升至 78.5%。虽然受到中美贸易摩擦的影响，1-6 月出口累计增速仍在 17 年的高增速基础上进一步回升 4.9 个百分点，对支撑上半年经济的平稳起到至关重要的作用。

2018 年上半年市场流动性整体处于中性偏宽松，央行货币政策由稳健中性转为稳健宽裕，分别于 4 月和 7 月实施定向降准，其中 4 月 25 日下调准备金率 1 个百分点，用来置换到期的 MLF 9000 亿元，同时释放增量资金 4000 亿元。在央行降准和 MLF 续作等多种手段呵护下，市场资金面持续宽松，上半年银行间隔夜和 7 天回购利率中枢分别较去年下半年下行了 13BP 和 18BP 至 2.7% 和 3.29%。债市方面，1 月在银监会密集出台多项监管政策后，市场对监管趋严的担忧增加，10 年期国开债估值收益率一度从 4.87% 上行 26BP 至 5.13% 的高点。1 月中下旬开始，在宏观经济数据转弱、社会融资总量累计同比增速持续下行、金融监管边际趋缓、中美贸易战升级引发的避险情绪下，债市做多情绪持续发酵，长端利率债快速振荡下行，以 10 年期国开债为例，估值收益率较年初高点下行幅度超过 90BP。高等级信用债跟随利率债大幅上涨，而低等级信用债受上市民企违约事件影响，收益率持续上行，信用利差整体走扩。

本基金在上半年的资产配置仍以同业存款为主要投资标的，债券、同业存单等其他品种为辅。在保证流动性的前提下，基金整体久期适度拉长。本基金在报告期内整体运行平稳。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，华宝添益 A 类基金份额净值收益率为 1.9555%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%，本报告期华宝添益 B 的基金份额净值收益率为 2.0450%，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

上半年经济稳中趋缓，表现出一定的韧性。展望下半年，经济依然存在一定的下行压力，一方面海外经济复苏分化，中美贸易争端可能对外需出口形成一定的负面影响。另一方面上半年投资整体低迷，城投平台融资渠道收缩以及民营企业融资环境尚未改善的背景下，后续基建投资和房地产投资对经济的承压影响或将持续显现。预计下半年货币政策继续维持总体稳健、结构性宽松，财政政策将更为积极。在一系列包括扩大开放、关税下调、增值税调降、小微企业税收优惠

等政策安排下，内需在下半年是否会有所回暖有待观察。短期来看，债市交易情绪仍会受金融数据以及中美贸易争端预期变化的影响，而经济和政策的变化在下半年也显得更为关键。在此背景下，本基金管理人将继续本着谨慎、稳健、安全的原则，兼顾组合的安全性和流动性，维持资产结构的均衡配比，随时把握市场动向，为投资者谋取稳定回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

##### （1）日常估值流程

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

##### （2）特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度，对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况，量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金 A 类份额在本年度累计分配收益 1,782,007,584.58 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 1,784,266,982.23 元，计入应付利润科目-2,259,397.65 元。B 类份额在本年度累计分配收益 850,575,474.31 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 853,212,882.64 元，计入应付利润科目-2,637,408.33 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**

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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关损害基金份额持有人利益的行为。

本基金 A 类份额在本年度累计分配收益 1,782,007,584.58 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 1,784,266,982.23 元，计入应付利润科目-2,259,397.65 元。B 类份额在本年度累计分配收益 850,575,474.31 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 853,212,882.64 元，计入应付利润科目-2,637,408.33 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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华宝现金添益交易型货币市场基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	72,287,192,469.27	68,946,411,638.86
结算备付金	1,353,650,754.55	159,609,609.09
存出保证金	-	-
交易性金融资产	33,475,547,899.22	19,904,884,218.74
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	33,475,547,899.22	19,904,884,218.74
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	15,455,097,398.70	99,875,224.94
应收证券清算款	-	-
应收利息	891,210,646.19	758,852,660.54
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	1,638.73	1,888.73
资产总计	123,462,700,806.66	89,869,635,240.90
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> <b>2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末</b> <b>2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	1,184,273,047.86	999,998,800.00
应付证券清算款	934,314,369.23	50,000,000.00
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	46,480,777.42	29,285,617.86
应付托管费	11,952,199.89	7,530,587.42
应付销售服务费	22,235,605.56	15,584,176.05
应付交易费用	314,766.61	226,446.72

应交税费	-	-
应付利息	199,053.68	373,288.44
应付利润	25,639,093.99	30,535,899.97
递延所得税负债	-	-
其他负债	211,323.61	277,000.00
负债合计	2,225,620,237.85	1,133,811,816.46
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	121,237,080,568.81	88,735,823,424.44
未分配利润	-	-
所有者权益合计	121,237,080,568.81	88,735,823,424.44
负债和所有者权益总计	123,462,700,806.66	89,869,635,240.90

报告截止日 2018 年 6 月 30 日，华宝添益基金份额净值 100.0000 元，基金份额总额 946313329.93 份；华宝添益 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 26605747575.05 份。华宝添益份额总额合计为 27552060904.98 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝现金添益交易型货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	3,080,413,391.99	1,820,252,107.25
1.利息收入	3,080,391,999.72	1,820,342,393.46
其中：存款利息收入	1,954,795,670.68	1,563,004,531.36
债券利息收入	554,395,727.85	184,229,656.09
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	571,200,601.19	73,108,206.01
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	21,392.27	-90,286.21
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	21,392.27	-90,286.21
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填	-	-



列)		
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
<b>减：二、费用</b>	<b>447,830,333.10</b>	<b>295,124,366.31</b>
1. 管理人报酬	233,712,217.12	151,730,523.96
2. 托管费	60,097,427.20	39,016,420.39
3. 销售服务费	127,663,149.39	92,691,155.38
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	26,006,845.59	11,294,741.23
其中：卖出回购金融资产支出	26,006,845.59	11,294,741.23
6. 税金及附加	21,085.83	-
7. 其他费用	329,607.97	391,525.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>2,632,583,058.89</b>	<b>1,525,127,740.94</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>2,632,583,058.89</b>	<b>1,525,127,740.94</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝现金添益交易型货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	88,735,823,424.44	-	88,735,823,424.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,632,583,058.89	2,632,583,058.89
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）	32,501,257,144.37	-	32,501,257,144.37
其中：1. 基金申购款	221,323,909,124.45	-	221,323,909,124.45
2. 基金赎回款	-188,822,651,980.08	-	-188,822,651,980.08
四、本期向基金份额持	-	-2,632,583,058.89	-2,632,583,058.89

有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	121,237,080,568.81	-	121,237,080,568.81
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	75,515,727,758.62	-	75,515,727,758.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,525,127,740.94	1,525,127,740.94
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）	7,263,952,978.49	-	7,263,952,978.49
其中：1. 基金申购款	94,649,359,075.91	-	94,649,359,075.91
2. 基金赎回款	-87,385,406,097.42	-	-87,385,406,097.42
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）	-	-1,525,127,740.94	-1,525,127,740.94
五、期末所有者权益（基金净值）	82,779,680,737.11	-	82,779,680,737.11

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：

\_\_\_\_\_  
黄小慧

\_\_\_\_\_  
向辉

\_\_\_\_\_  
张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝现金添益交易型货币市场基金(原名为华宝兴业现金添益交易型货币市场基金,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[2012]1651号《关

于核准华宝兴业现金添益交易型货币市场基金募集的批复》核准，由华宝基金管理有限公司（原华宝兴业基金管理有限公司，已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记）依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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 1,802,628,000.00 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(2012)第 546 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》于 2012 年 12 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 18,026,280.00 份基金份额。本基金有效认购资金在募集期间产生的利息在银行结息日计入基金资产。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证基字[2013]17 号审核同意，本基金 18,026,280.00 份基金份额于 2013 年 1 月 28 日在上交所挂牌交易。

经中国证监会备案，本基金于 2015 年 11 月 9 日起增设本基金的场外基金份额（以下简称“B 类基金份额”）。本基金的原场内基金份额为 A 类基金份额，A 类基金份额仅在上交所申购、赎回和上市交易。B 类基金份额仅在场外进行申购和赎回。A 类基金份额的申购、赎回净值为每份人民币 100.00 元，B 类基金份额的申购、赎回净值为每份人民币 1.00 元。A 类基金份额由中国证券登记结算有限责任公司进行登记；B 类基金份额由华宝兴业基金管理有限公司进行登记。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，华宝兴业现金添益交易型货币市场基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝现金添益交易型货币市场基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝现金添益交易型货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括现金；通知存款；短期融资券；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单；期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券；期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的中期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同期七天通知存款利率（税后）。

## 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》、《华宝现金添益交易型货币市场基金基金合同》和在财务报表附注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。

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 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 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：

(a) 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。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 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
华宝基金管理有限公司（“华宝基金”）	基金管理人、B类基金份额登记机构、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
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人

华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司（“宝钢财务”）	受宝武集团控制的公司

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

#### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

### 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
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	233,712,217.12	151,730,523.96
其中：支付销售机构的客户维护费	24,173,477.22	21,528,567.04

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.35%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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.35% / 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
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	60,097,427.20	39,016,420.39

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.09%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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.09% / 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 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		
	华宝添益	华宝添益 B	合计
华宝基金	43,645,250.90	13,219,613.83	56,864,864.73
华宝证券	560,349.56	-	560,349.56
合计	44,205,600.46	13,219,613.83	57,425,214.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝添益	华宝添益 B	合计
华宝基金	34,916,827.61	653,657.96	35,570,485.57
华宝证券	1,975,805.90	-	1,975,805.90
合计	36,892,633.51	653,657.96	37,546,291.47

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华宝基金，再由华宝基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：  
日基金销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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 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
中国建设银行	251,280,252.05	-	-	-	23,778,820,000.00	2,580,292.43
上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日						
银行间市	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

场交易的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	252,323,109.49	210,177,112.88	-	-	31,567,708,000.00	2,960,140.61

#### 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

份额单位：份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	华宝添益	华宝添益 B
基金合同生效日（2012年12月27日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	1,864,278.00	-
期间申购/买入总份额	50,815,486.00	130,099,949.74
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	50,777,655.00	60,099,949.74
期末持有的基金份额	1,902,109.00	70,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2000%	0.2600%

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	华宝添益	华宝添益 B
基金合同生效日（2012年12月27日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	3,390,812.00	-
期间申购/买入总份额	43,326,118.00	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	44,887,448.00	-
期末持有的基金份额	1,829,482.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	-



- 注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投份额。  
2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 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

华宝添益 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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
华宝信托有 限责任公司	30,010,031.84	0.1128%	-	-
宝钢集团财 务有限责任 公司	-	-	100,012,018.94	0.4200%

#### 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
中国建设银行	2,192,469.27	15,066.22	2,467,628.59	28,275.18

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末（2018 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 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

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,184,273,047.86 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
170207	17 国开 07	2018 年 7 月 2 日	100.00	7,360,000	736,000,000.00
170207	17 国开 07	2018 年 7 月 2 日	100.00	2,642,000	264,200,000.00
170207	17 国开 07	2018 年 7 月 2 日	100.00	2,240,000	224,000,000.00
合计				12,242,000	1,224,200,000.00

-

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 33,475,547,899.22 元，无属于第一层次和第三层次的余额(2017 年 12 月 31

日：第二层次 19,904,884,218.74 元，无第二层次和第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，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	33,475,547,899.22	27.11
	其中：债券	33,475,547,899.22	27.11
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	15,455,097,398.70	12.52
	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	73,640,843,223.82	59.65
4	其他各项资产	891,212,284.92	0.72
5	合计	123,462,700,806.66	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	1.51	
	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	1,184,273,047.86	0.98
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

#### 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	90
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	91
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 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	25.27	1.75
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
2	30 天(含)—60 天	13.35	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
3	60 天(含)—90 天	27.76	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
4	90 天(含)—120 天	4.85	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
5	120 天(含)—397 天（含）	29.86	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
合计		101.10	1.75

### 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

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 240 天。

### 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	3,454,241,436.26	2.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,120,112,038.05	4.22
	其中：政策性金融债	5,120,112,038.05	4.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	24,901,194,424.91	20.54
8	其他	-	-
9	合计	33,475,547,899.22	27.61
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序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	111894976	18 盛京银行 CD131	34,700,000	3,466,636,871.57	2.86
2	170207	17 国开 07	15,800,000	1,580,003,031.66	1.30
3	189916	18 贴现国债 16	11,400,000	1,138,768,462.94	0.94
4	150418	15 农发 18	11,100,000	1,110,269,923.88	0.92
5	111891365	18 宁波银行 CD020	10,000,000	995,696,331.50	0.82
6	111806141	18 交通银行 CD141	10,000,000	993,904,417.40	0.82
7	111898900	18 徽商银行 CD085	10,000,000	980,109,180.43	0.81
8	111814097	18 江苏银行 CD097	10,000,000	980,084,466.04	0.81
9	111814055	18 江苏银行 CD055	10,000,000	976,753,404.25	0.81
10	111898200	18 厦门国际银行 CD114	9,900,000	950,798,903.00	0.78

**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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0373%
报告期内偏离度的最低值	-0.0013%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0124%

**报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明**

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内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。

**7.9 投资组合报告附注****7.9.1**

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

**7.9.2**

华宝添益货币基金截至 2018 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的 18 南京银行 CD054(111894663) 发行主体南京银行（601009）于 2018 年 1 月 30 日收到江苏银监局的处罚决定。因其镇江分行违规办理票据业务违反审慎经营原则，对南京银行处罚款 3230 万元。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**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	-
3	应收利息	891,210,646.19
4	应收申购款	-
5	其他应收款	1,638.73
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	891,212,284.92



## § 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
华宝添益	36,054	26,247.11	778,386,158.16	82.25%	167,927,171.78	17.75%
华宝添益B	66	403,117,387.50	26,605,747,575.04	100.00%	0.00	0.00%
合计	36,120	762,792.38	27,384,133,733.20	99.39%	167,927,171.78	0.61%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

华宝添益

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	高盛国际—自有资金	18,949,145.00	2.00%
2	中信信托有限责任公司—中信信托锐进43期高毅晓峰投资集合资金信托计划	14,290,217.00	1.51%
3	海通证券股份有限公司	14,115,495.00	1.49%
4	上海保银投资管理有限公司—保银紫荆怒放私募基金	14,102,993.00	1.49%
5	民生通惠资产—工商银行—民生通惠通汇4号资产管理产品	13,825,091.00	1.46%
6	上海高毅资产管理合伙企业(有限合伙)—高毅晓峰2号致信基金	10,101,692.00	1.07%
7	浙江义乌市檀真投资管理合伙企业(有限合伙)—正心谷价值中国精选私募证券投资基金	9,096,531.00	0.96%
8	广发控股(香港)有限公司—客	7,309,759.00	0.77%

	户资金		
9	高瓴资本管理有限公司—HCM 中国基金	7,016,622.00	0.74%
10	泰康资产管理（香港）有限公司—客户资金	6,545,882.00	0.69%

注：华宝添益 B 类基金份额不上市交易。

### 8.3 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	银行类机构	2,826,000,505.65	10.26
2	银行类机构	2,509,510,580.94	9.11
3	银行类机构	2,020,232,356.90	7.33
4	银行类机构	2,019,329,056.11	7.33
5	银行类机构	2,015,321,669.50	7.31
6	其他机构	18,949,145.00	0.07
7	其他机构	1,725,467,008.03	6.26
8	银行类机构	1,447,079,551.52	5.25
9	信托类机构	14,290,217.00	0.05
10	券商类机构	14,115,495.00	0.05

注：

- 1、此表数据中，场内份额（序号：6、9、10）面值为 100.00 元，场外份额（序号：1、2、3、4、5、7、8）面值为 1.00 元；
- 2、持有份额由 1~10 依次按照市值由大到小排列；
- 3、占比=持有份额÷总份额（该总份额为场内份额和场外份额直接相加所得）。

### 8.4 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	华宝添益	0.00	0.0000%
	华宝添益 B	-	-

	合计	0.00	0.0000%
--	----	------	---------

### 8.5 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	华宝添益	0
	华宝添益 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	华宝添益	0
	华宝添益 B	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	华宝添益	华宝添益 B
基金合同生效日（2012 年 12 月 27 日）基金 份额总额	18,026,280.00	-
本报告期初基金份额总额	649,268,286.62	23,808,994,762.47
本报告期基金总申购份额	765,306,973.82	144,793,211,742.22
减：本报告期基金总赎回份额	468,261,930.51	141,996,458,929.64
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	946,313,329.93	26,605,747,575.05

注：1、本基金基金合同生效于 2012 年 12 月 27 日。本基金的份额折算日为基金合同生效当日。折算后本基金场内份额（A 类基金份额）的份额净值为 100.00 元。

2、自 2015 年 11 月 9 日起增设华宝兴业现金添益交易型货币市场基金的场外基金份额（B 类基金份额），场外份额（B 类基金份额）的份额净值为 1.00 元。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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

#### 1、基金管理人的重大人事变动

2018 年 4 月 11 日, 经公司董事会审议通过, 聘任李慧勇为公司副总经理。该事项经中国证券投资基金业协会备案, 并在指定媒体上披露。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内, 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为: 本基金合同生效之日起至本报告期末。

### 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

本报告期内, 管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

### 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	
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准：资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、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；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2. 本期交易单元未发生变化。

### 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
申万宏源	-	-	311,315,800,000.00	100.00%	-	-

中投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、基金管理人于 2018 年 3 月 28 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下基金修订基金合同有关条款的公告》，公司根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，对旗下部分基金基金合同有关条款进行修订并相应修订了托管协议，具体修订内容详见公司公告，请投资者予以关注。

华宝基金管理有限公司

2018 年 8 月 24 日