

# 华宝现金添益交易型货币市场基金 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 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

报告送出日期：2024 年 10 月 25 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 2024 年 10 月 23 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 2024 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华宝添益
场内简称	华宝添益 ETF
基金主代码	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
报告期末基金份额总额	88,749,132,174.79 份
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	本基金通过对短期金融工具的积极稳健投资，在保持本金安全与资产充分流动性的前提下，追求稳定的现金收益。主要包括：久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、套利策略、逆回购策略、现金流管理策略。
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。

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		
下属分级基金的基金简称	华宝添益 ETF	华宝添益 B	华宝添益 D
下属分级基金的场内简称	华宝添益 ETF	-	-
下属分级基金的交易代码	511990	001893	021809
报告期末下属分级基金的份额总额	77,531,819,936.78 份	7,542,596,538.49 份	3,674,715,699.52 份

注：本基金场内基金份额（A类基金份额）简称为“华宝添益ETF”，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”、D类基金份额简称为“华宝添益D”，基金份额净值为1.00元。为便于投资者理解，本报告中场内基金份额均按份额净值为1.00折算后进行披露及汇总统计。

### §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(2024年7月1日-2024年9月30日)		报告期(2024年7月11日-2024年9月30日)
	华宝添益	华宝添益 B	华宝添益 D
1. 本期已实现收益	305,216,987.86	48,488,703.15	4,584,835.57
2. 本期利润	305,216,987.86	48,488,703.15	4,584,835.57
3. 期末基金资产净值	77,531,819,936.78	7,542,596,538.49	3,674,715,699.52

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于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实际利率计算投资账面价值，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. 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。

3. 自2024年07月11日起，增设华宝添益D,D份额的实际起始日为2024年07月15日。

#### 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	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	0.3390%	0.0002%	0.3393%	0.0000%	-0.0003%	0.0002%
过去六个月	0.7131%	0.0003%	0.6750%	0.0000%	0.0381%	0.0003%
过去一年	1.6001%	0.0006%	1.3509%	0.0000%	0.2492%	0.0006%
过去三年	5.0487%	0.0006%	4.0509%	0.0000%	0.9978%	0.0006%
过去五年	9.3071%	0.0009%	6.7509%	0.0000%	2.5562%	0.0009%
自基金合同 生效起至今	36.5678%	0.0029%	15.8791%	0.0000%	20.6887%	0.0029%

华宝添益 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	0.3997%	0.0002%	0.3393%	0.0000%	0.0604%	0.0002%
过去六个月	0.8341%	0.0003%	0.6750%	0.0000%	0.1591%	0.0003%
过去一年	1.8444%	0.0006%	1.3509%	0.0000%	0.4935%	0.0006%
过去三年	5.8081%	0.0006%	4.0509%	0.0000%	1.7572%	0.0006%
过去五年	10.6264%	0.0009%	6.7509%	0.0000%	3.8755%	0.0009%
自基金合同 生效起至今	25.0832%	0.0021%	12.0030%	0.0000%	13.0802%	0.0021%

华宝添益 D

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	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	0.2886%	0.0004%	0.2877%	0.0000%	0.0009%	0.0004%

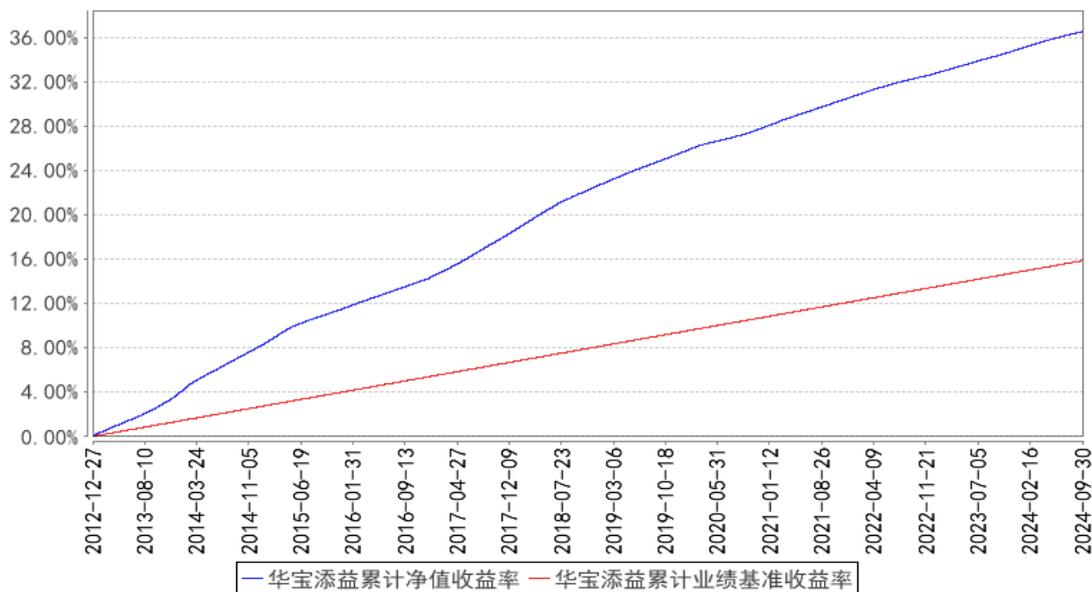
注：（1）基金业绩基准：同期七天通知存款利率（税后）；

（2）基金收益分配是按日结转份额；

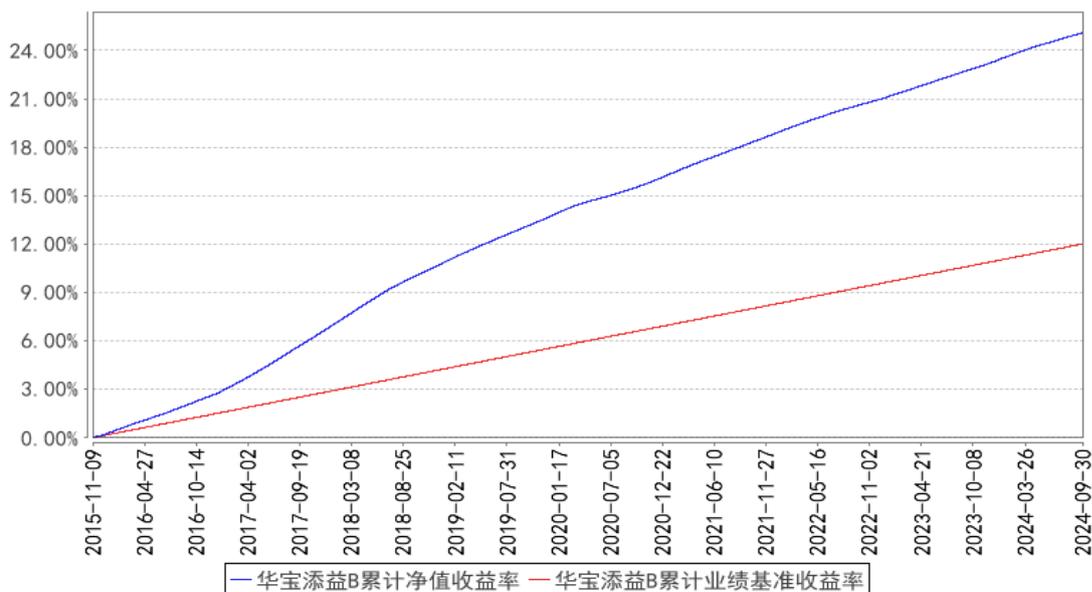
（3）报告期内新增基金 D 份额，基金 D 份额成立于 2024 年 07 月 11 日。

### 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

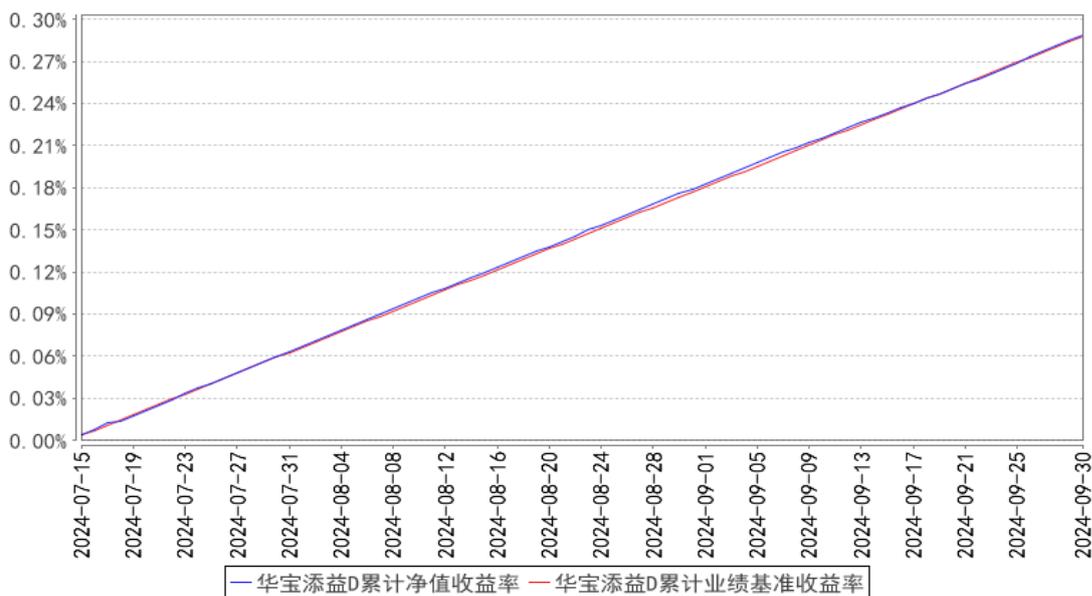
华宝添益累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华宝添益B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



华宝添益D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：按照基金合同的约定，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 06 月 27 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

## §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		
高文庆	本基金基金经理	2019-07-19	-	14 年	硕士。2010 年 7 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 月至 2023 年 2 月任华宝现金宝货币市场基金基金经理，2017 年 3 月至 2023 年 8 月任华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 3 月起任华宝中短债债券型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 5 月起任华宝宝怡纯债债券型证券投资基金基金经理，2019 年 7 月起任华宝现金添益交易型货币市场基金基金经理，2019 年 9 月起任华宝政策性金融债债券型证券投资基金基金经理，2024 年 6 月起任华宝浮动净值型发起式货币市场基金基金经理，2024 年 7 月起任华宝宝嘉 30 天持有期债券型证券投资基金基金经理。
厉卓然	本基金基金经理	2023-10-21	-	11 年	硕士。曾在华宸未来基金管理有限公司担任产品经理。2014 年 9 月加入华宝基金

					管理有限公司，先后担任交易员、高级交易员、基金经理助理等职务。2021 年 3 月起任华宝现金宝货币市场基金基金经理，2022 年 6 月起任华宝中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理，2022 年 12 月起任华宝宝通 30 天持有期短债债券型证券投资基金基金经理，2023 年 10 月起任华宝现金添益交易型货币市场基金基金经理。
陈昕	本基金基金经理、固定收益投资总监	2012-12-27	2024-07-20	21 年	硕士。2003 年 8 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益产品的估值、交易、投资等工作，现任固定收益投资总监。2011 年 11 月至 2023 年 2 月任华宝现金宝货币市场基金基金经理，2012 年 6 月至 2014 年 2 月任华宝兴业短融 50 基金经理，2012 年 12 月至 2024 年 7 月任华宝现金添益交易型货币市场基金基金经理，2019 年 5 月至 2021 年 3 月任华宝宝怡纯债债券型证券投资基金基金经理，2019 年 9 月至 2024 年 7 月任华宝浮动净值型发起式货币市场基金基金经理。

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度国内经济运行整体有所放缓，出口增速和 PMI 有所回升，但工业生产、投资、消费有所走弱。9 月制造业 PMI 为 49.8%，较上月抬升 0.7 pct。8 月规模以上工业增加值同比 4.5%，较上月回落 0.6 pct。1-8 月固定资产投资累计增速 3.4%，分项来看，制造业维持较快增长、基建增速放缓、房地产仍在低位。8 月社会消费品零售总额同比增长 2.1%，较上月回落 0.6 pct。贸易方面，以美元计，8 月出口同比 8.7%，较上月抬升 1.7pct；进口同比 0.5%，较上月回落 6.7pct；实现贸易顺差 910.2 亿美元，前值 846.5 亿美元。9 月 CPI 同比 0.4%，较上月回落 0.2pct；PPI 同比-2.8%，较上月回落 1pct。8 月社会融资规模存量同比 8.1%，较上月回落 0.1pct，M2 同比 6.3%，持平上月。

三季度银行间流动性整体充裕，隔夜加权利率季度均值下行 5BP 至 1.79%，4-6 月均值分别为 1.81%、1.78%、1.77%。货币政策方面，三季度央行两次下调公开市场 7 天逆回购操作利率，由 1.8% 下调至 1.5%。MLF 利率由 2.5% 下调至 2.0%，1 年和 5 年 LPR 分别由 3.45% 和 3.95% 下调至 3.35% 和 3.85%。三季度公开市场回购净投放 9451 亿元，MLF 净回笼 1950 亿元。此外，央行开展公开市场国债买卖操作，8 月和 9 月分别净买入国债 1000 亿和 2000 亿。截至三季度末，利率债收益率整体下行，中短端收益率下行幅度较大，国债下行幅度大于国开债。1Y 国债、国开债下行 17BP、4BP 至 1.37%、1.65%，10Y 国债、国开债下行 5BP、5BP 至 2.15%、2.25%，30Y 国债下行 7BP 至 2.36%。同业存单方面，1Y 商业银行 AAA 存单下行 5BP 至 1.91%。信用债方面，收益率整体上行，银行二级资本债波动最大；3Y 期 AAA、AA+ 中票收益率上行 19BP、20BP 至 2.32%、2.43%，3Y 期 AAA、AA+ 城投债收益率上行 13BP、16BP 至 2.32%、2.40%，3Y 期 AAA-、AA+ 商业银行二级资本收益率上行 20BP、25BP 至 2.33%、2.40%。

本基金报告期内运行平稳，在短端资产收益率较高时期拉长了组合久期，增加了对中长期同业资产的配置。本基金将一如既往秉承谨慎、稳健的原则，严格把控风险，资产配置上聚焦短

久期、高等级品种，在做好流动性管理的同时兼顾收益，根据市场变化对组合配置进行积极调整，为投资者获取持续稳定回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额 A 类净值增长率为 0.3390%，同期业绩比较基准收益率为 0.3393%；本报告期内基金份额 B 类净值增长率为 0.3997%，同期业绩比较基准收益率为 0.3393%；本报告期内基金份额 D 类净值增长率为 0.2886%，同期业绩比较基准收益率为 0.2877%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	26,948,666,980.54	28.39
	其中：债券	26,948,666,980.54	28.39
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	22,604,814,057.60	23.82
	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	44,885,474,047.01	47.29
4	其他资产	475,866,599.20	0.50
5	合计	94,914,821,684.35	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

### 5.2 报告期债券回购融资情况

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	5.82	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	6,103,854,145.39	6.88
	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%。

## 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	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	85
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	55

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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。

### 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	34.55	6.88
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	11.96	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	19.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	11.41	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	28.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	106.58	6.88

### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

## 5.5 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	349,412,301.14	0.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,538,269,034.58	5.11
	其中：政策性金融债	4,101,439,448.19	4.62

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,677,033,830.14	5.27
6	中期票据	10,296,810.81	0.01
7	同业存单	17,373,655,003.87	19.58
8	其他	-	-
9	合计	26,948,666,980.54	30.36
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 5.6 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	200305	20 进出 05	8,900,000	909,812,200.01	1.03
2	112414205	24 江苏银行 CD205	8,000,000	796,784,001.05	0.90
3	112415069	24 民生银行 CD069	5,500,000	548,238,888.99	0.62
4	112485611	24 宁波银行 CD124	5,500,000	545,365,029.77	0.61
5	210313	21 进出 13	4,900,000	502,802,473.06	0.57
6	112484781	24 台州银行 CD036	5,000,000	498,651,688.25	0.56
7	112484612	24 西安银行 CD052	5,000,000	493,730,820.99	0.56
8	220332	22 进出 32	4,300,000	439,322,835.28	0.50
9	240301	24 进出 01	4,200,000	426,288,791.69	0.48
10	200203	20 国开 03	3,900,000	400,862,987.44	0.45

### 5.7 “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	0.0286%
报告期内偏离度的最低值	0.0070%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0170%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

### 5.8 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。

### 5.9 投资组合报告附注

#### 5.9.1 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。

### 5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

华宝添益截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 宁波银行股份有限公司因: 监管标准化数据与 1104 数据交叉核验不一致; 监管标准化数据与客户风险数据交叉核验不一致; 监管标准化数据漏报; 监管标准化数据错报; 虚假受托支付, 贷款资金长期留存借款人账户; 企业划型不准确; 于 2023 年 11 月 27 日收到国家金融监督管理总局宁波监管局罚款的处罚措施。

华宝添益截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 宁波银行股份有限公司因信贷业务违规, 违反审慎经营规则, 内部管理与控制制度不健全或执行监督不力, 内控管理未形成有效风险控制; 于 2023 年 12 月 01 日收到国家金融监督管理总局宁波监管局罚款的处罚措施。

华宝添益截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 台州银行股份有限公司因信贷业务违规, 存款业务违规, 违反审慎经营规则, 内部管理与控制制度不健全或执行监督不力, 编制或者提供虚假资料, 内控管理未形成有效风险控制; 于 2024 年 03 月 27 日收到国家金融监督管理总局台州监管分局罚款的处罚措施。

华宝添益截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 西安银行股份有限公司因公司现任独立董事睢国余、廖志生截至 2022 年 11 月已连续任职满 6 年。睢国余 2023 年 3 月向公司提交辞职报告, 但公司至今未完成独立董事的补选工作; 廖志生明知连续任职已超 6 年, 仍继续任职并领取津贴, 至今未向董事会提交书面辞职报告; 于 2024 年 04 月 25 日收到陕西证监局责令改正的处罚措施。

华宝添益截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 珠海华润银行股份有限公司因刚性兑付代销资管计划; 于 2024 年 05 月 22 日收到国家金融监督管理总局珠海监管分局罚款的处罚措施。

华宝添益截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 宁波银行股份有限公司因违规置换已核销贷款; 授信准入管理不到位; 于 2024 年 06 月 14 日收到国家金融监督管理总局宁波监管局罚款的处罚措施。

华宝添益截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,珠海华润银行股份有限公司因 1. 违反规定办理结汇业务; 2. 违反规定办理售汇业务; 3. 办理经常项目资金收付, 未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查; 于 2024 年 07 月 10 日收到国家外汇管理局广东省分局罚款, 没收违法所得的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和析, 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。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	24, 313. 35
2	应收证券清算款	475, 842, 235. 89
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	49. 96
6	其他	-
7	合计	475, 866, 599. 20

### 5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因, 合计数可能不等于分项之和。

## §6 开放式基金份额变动

单位: 份

项目	华宝添益	华宝添益 B	华宝添益 D
报告期 期初基 金份 额 总额	86, 536, 790, 125. 08	7, 671, 173, 020. 04	-
报告期 期间基 金总 申 购份 额	15, 785, 723, 518. 08	17, 853, 018, 733. 19	10, 946, 288, 660. 39
报告期 期间基	24, 790, 693, 706. 38	17, 981, 595, 214. 74	7, 271, 572, 960. 87

金总赎回份额			
报告期末基金份额总额	77,531,819,936.78	7,542,596,538.49	3,674,715,699.52

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	强制调减	2024-07-01	-5799624.00	-580000757.74	-
2	分红再投资	2024-07-01	733.00	0.00	-
3	申购	2024-07-02	5800008.00	580000800.00	-
4	强制调减	2024-07-03	-5120881.00	-512120952.85	-
5	分红再投资	2024-07-03	235.00	0.00	-
6	申购	2024-07-04	5121209.00	512120900.00	-
7	强制调减	2024-07-04	-680095.00	-68015332.26	-
8	分红再投资	2024-07-04	28.00	0.00	-
9	申购	2024-07-05	680154.00	68015400.00	-
10	强制调减	2024-07-05	-3793760.00	-379425588.47	-
11	分红再投资	2024-07-05	202.00	0.00	-
12	申购	2024-07-08	3794255.00	379425500.00	-
13	强制调减	2024-07-08	-2007833.00	-200797298.50	-
14	分红再投资	2024-07-08	229.00	0.00	-
15	申购	2024-07-09	2007973.00	200797300.00	-
16	强制调减	2024-07-09	-125500.00	-12550753.00	-
17	分红再投资	2024-07-09	144.00	0.00	-
18	赎回	2024-07-10	-1304500.00	-130455265.18	-
19	分红再投资	2024-07-10	176.00	0.00	-
20	分红再投资	2024-07-11	163.00	0.00	-
21	强制调减	2024-07-12	-167083.00	-16710305.00	-
22	分红再投资	2024-07-12	167.00	0.00	-

23	申购	2024-07-15	167164.00	16716400.00	-
24	强制调减	2024-07-15	-4206024.00	-420625494.36	-
25	分红再投资	2024-07-15	460.00	0.00	-
26	申购	2024-07-16	4206255.00	420625500.00	-
27	强制调减	2024-07-16	-167624.00	-16763440.92	-
28	分红再投资	2024-07-16	6.00	0.00	-
29	申购	2024-07-17	167634.00	16763400.00	-
30	强制调减	2024-07-17	-714600.00	-71463373.01	-
31	分红再投资	2024-07-17	158.00	0.00	-
32	申购	2024-07-18	714634.00	71463400.00	-
33	分红再投资	2024-07-18	133.00	0.00	-
34	分红再投资	2024-07-19	172.00	0.00	-
35	分红再投资	2024-07-22	475.00	0.00	-
36	强制调减	2024-07-23	-20000.00	-2000080.00	-
37	分红再投资	2024-07-23	157.00	0.00	-
38	申购	2024-07-24	20001.00	2000100.00	-
39	强制调减	2024-07-24	-3466251.00	-346642379.30	-
40	分红再投资	2024-07-24	171.00	0.00	-
41	申购	2024-07-25	3466423.00	346642300.00	-
42	强制调减	2024-07-25	-363099.00	-36311883.50	-
43	分红再投资	2024-07-25	33.00	0.00	-
44	申购	2024-07-26	363119.00	36311900.00	-
45	分红再投资	2024-07-26	145.00	0.00	-
46	分红再投资	2024-07-29	478.00	0.00	-
47	强制调减	2024-07-30	-4376044.00	-437674673.95	-
48	分红再投资	2024-07-30	167.00	0.00	-
49	申购	2024-07-31	4376747.00	437674700.00	-
50	强制调减	2024-08-01	-1100000.00	-110005040.00	-

51	分红再投资	2024-08-01	162.00	0.00	-
52	申购	2024-08-02	1100050.00	110005000.00	-
53	分红再投资	2024-08-02	119.00	0.00	-
54	强制调减	2024-08-05	-4377245.00	-437750706.16	-
55	分红再投资	2024-08-05	478.00	0.00	-
56	申购	2024-08-06	4377507.00	437750700.00	-
57	强制调减	2024-08-07	-3359600.00	-335975698.04	-
58	分红再投资	2024-08-07	167.00	0.00	-
59	申购	2024-08-08	3359757.00	335975700.00	-
60	强制调减	2024-08-08	-1018552.00	-101862449.47	-
61	分红再投资	2024-08-08	39.00	0.00	-
62	申购	2024-08-09	1018625.00	101862500.00	-
63	强制调减	2024-08-09	-489072.00	-48913357.94	-
64	分红再投资	2024-08-09	126.00	0.00	-
65	申购	2024-08-12	689133.00	68913300.00	-
66	强制调减	2024-08-12	-3889475.00	-388967454.39	-
67	分红再投资	2024-08-12	429.00	0.00	-
68	申购	2024-08-13	3889675.00	388967500.00	-
69	强制调减	2024-08-13	-689562.00	-68960846.57	-
70	分红再投资	2024-08-13	25.00	0.00	-
71	申购	2024-08-14	689608.00	68960800.00	-
72	强制调减	2024-08-14	-1157300.00	-115735966.51	-
73	分红再投资	2024-08-14	137.00	0.00	-
74	申购	2024-08-15	1157360.00	115736000.00	-
75	强制调减	2024-08-15	-1014900.00	-101495805.81	-
76	分红再投资	2024-08-15	120.00	0.00	-
77	申购	2024-08-16	1014958.00	101495800.00	-
78	分红再投资	2024-08-16	134.00	0.00	-

79	分红再投资	2024-08-19	513.00	0.00	-
80	分红再投资	2024-08-20	179.00	0.00	-
81	分红再投资	2024-08-21	157.00	0.00	-
82	分红再投资	2024-08-22	173.00	0.00	-
83	分红再投资	2024-08-23	158.00	0.00	-
84	分红再投资	2024-08-26	493.00	0.00	-
85	分红再投资	2024-08-27	166.00	0.00	-
86	分红再投资	2024-08-28	158.00	0.00	-
87	分红再投资	2024-08-29	172.00	0.00	-
88	分红再投资	2024-08-30	167.00	0.00	-
89	强制调减	2024-09-02	-50000.00	-5000200.00	-
90	分红再投资	2024-09-02	469.00	0.00	-
91	强制调增	2024-09-03	50000.00	4999850.00	-
92	分红再投资	2024-09-03	170.00	0.00	-
93	分红再投资	2024-09-04	182.00	0.00	-
94	分红再投资	2024-09-05	156.00	0.00	-
95	强制调减	2024-09-06	-4583130.00	-458369578.33	-
96	分红再投资	2024-09-06	165.00	0.00	-
97	申购	2024-09-09	4583699.00	458369900.00	-
98	分红再投资	2024-09-10	157.00	0.00	-
99	强制调增	2024-09-11	250000.00	24999500.00	-
100	分红再投资	2024-09-11	164.00	0.00	-
101	分红再投资	2024-09-12	170.00	0.00	-
102	分红再投资	2024-09-13	181.00	0.00	-
103	分红再投资	2024-09-18	840.00	0.00	-
104	分红再投资	2024-09-19	166.00	0.00	-
105	分红再投资	2024-09-20	165.00	0.00	-
106	分红再投资	2024-09-23	506.00	0.00	-

107	分红再投资	2024-09-24	176.00	0.00	-
108	分红再投资	2024-09-25	180.00	0.00	-
109	分红再投资	2024-09-26	195.00	0.00	-
110	分红再投资	2024-09-27	201.00	0.00	-
111	分红再投资	2024-09-30	551.00	0.00	-
合计			-962,108.00	-98,000,531.26	

注：交易日期为确认日期，交易金额为确认金额。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2024 年 07 月 10 日发布华宝基金管理有限公司关于华宝现金添益交易型货币市场基金增加 D 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；  
 华宝现金添益交易型货币市场基金基金合同；  
 华宝现金添益交易型货币市场基金招募说明书；  
 华宝现金添益交易型货币市场基金托管协议；  
 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；  
 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；  
 基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

### 9.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司  
2024 年 10 月 25 日