

# 华泰柏瑞天添宝货币市场基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 债券回购融资情况.....	42
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	42
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.5 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.....	44
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
7.8 投资组合报告附注.....	45
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
8.3 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.....	47
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	50
10.9 其他重大事件.....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>52</b>
11.1 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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>

12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞天添宝货币市场基金	
基金简称	华泰柏瑞天添宝货币	
基金主代码	003246	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 22 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,262,220,496.62 份	
基金和同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞天添宝货币 A 级	华泰柏瑞天添宝货币 B 级
下属分级基金的交易代码:	003246	003871
报告期末下属分级基金的份额总额	2,332,477,841.20 份	3,929,742,655.42 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在力争保持基金资产安全和流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的稳健投资收益。
投资策略	本基金将采用主动的投资管理策略对短期货币市场工具进行投资，在投资中将充分利用现代金融工程理论以及数量分析方法来提高投资决策的及时性与合理性，在保证基金资产的安全性和流动性的基础上，获得稳健的投资收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为当期银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金属于证券投资基金较高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票型基金、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		华泰柏瑞基金管理有限公司	江苏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王凯宁
	联系电话	021-38601777	025-58587606
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	wangkaining@jsbchina.cn
客户服务电话		400-888-0001	95319
传真		021-38601799	025-58588155

注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	南京市中华路 26 号
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	南京市中华路 26 号
邮政编码	200135	210001
法定代表人	贾波	夏平

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、中国证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

### § 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	华泰柏瑞天添宝货币 A 级	华泰柏瑞天添宝货币 B 级
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 )	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	15,761,277.08	46,988,733.37
本期利润	15,761,277.08	46,988,733.37
本期净值收益率	1.87%	1.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	2,332,477,841.20	3,929,742,655.42
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	2.64%	2.33%

#### 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

华泰柏瑞天添宝货币 A 级

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	0.3672%	0.0017%	0.0292%	0.0000%	0.3380%	0.0017%
过去三个月	1.0478%	0.0011%	0.0885%	0.0000%	0.9593%	0.0011%
过去六个月	1.8716%	0.0018%	0.1760%	0.0000%	1.6956%	0.0018%
自基金合同生效起至今	2.6351%	0.0022%	0.2742%	0.0000%	2.3609%	0.0022%

华泰柏瑞天添宝货币 B 级

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	0.3866%	0.0017%	0.0292%	0.0000%	0.3574%	0.0017%

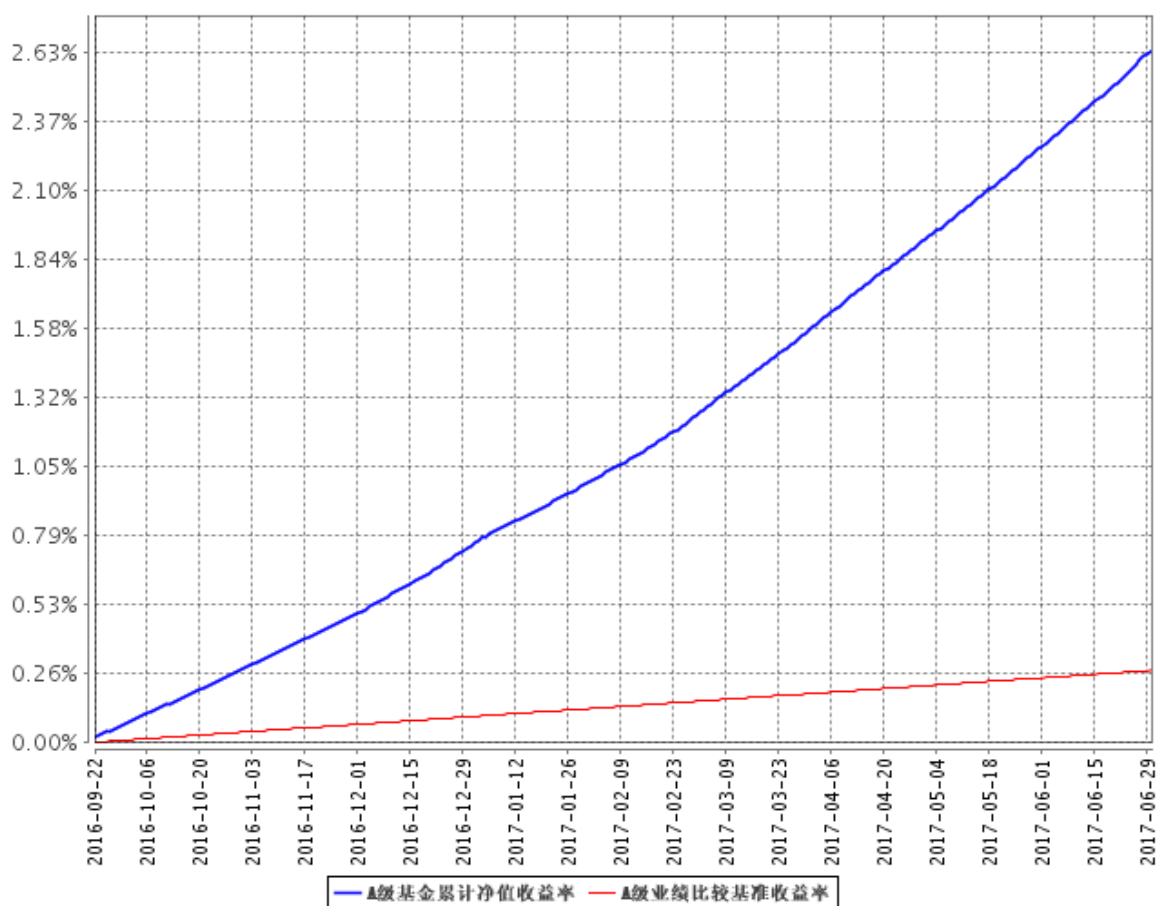


过去三个月	1.1072%	0.0011%	0.0885%	0.0000%	1.0187%	0.0011%
过去六个月	1.9916%	0.0018%	0.1760%	0.0000%	1.8156%	0.0018%
自基金合同生效起至今	2.3294%	0.0021%	0.2742%	0.0000%	2.0552%	0.0021%

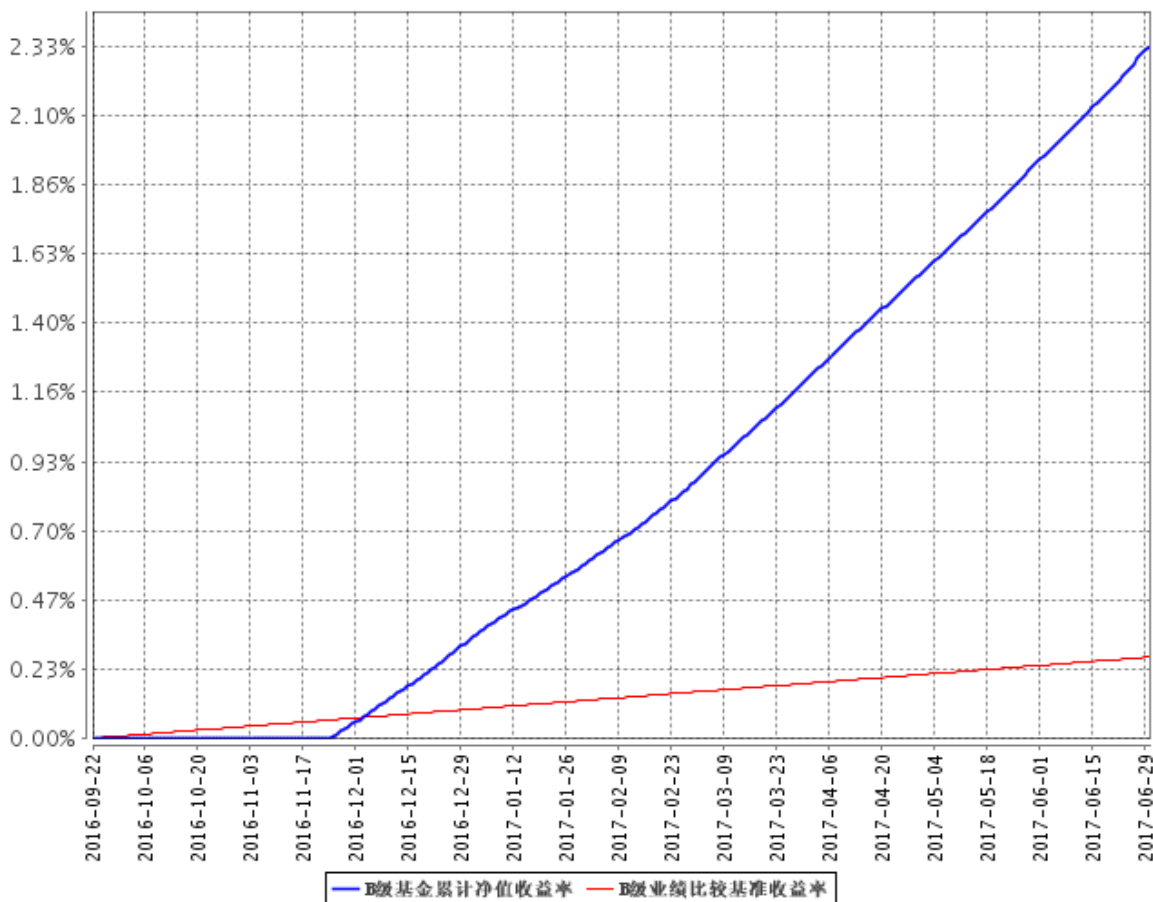
注：本基金于 2016 年 11 月 23 日新增 B 类份额，上述 A 类指标计算日期为 2016 年 9 月 22 日至 2017 年 6 月 30 日，上述 B 类指标计算日期为 2016 年 11 月 23 日至 2017 年 6 月 30 日。

### 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、本基金未规定建仓期，本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
- 2、本基金的收益分配是按日结转份额。
- 3、本基金于2016年11月23日新增B类份额，上述A类指标计算日期为2016年9月22日至2017年6月30日，上述B类指标计算日期为2016年11月23日至2017年6月30日。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资

资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金。截至 2017 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 916.45 亿元。

#### 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		
郑青	固定收益部副总监、本基金的基金经理	2016 年 9 月 22 日	-	12 年	12 年证券（基金）从业经验，经济学硕士。曾任职于国信证券股份有限公司、平安资产管理有限责任公司，2008 年 3 月至 2010 年 4 月任中海基金管理有限公司交易员，2010 年加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任债券研究员。2012 年 6 月起任华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金经理，2013 年 7 月起任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基金经理，2015 年 1 月起任固定收益部副总监。2015 年 7 月起任华泰柏瑞交易型货币市场证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月起任华泰柏瑞天添宝货币市场证券投资基金的基金经理。

#### 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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及《华泰柏瑞天添宝货币市场基金基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额

持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在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，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平，只在少数情况下“存在显著的倾向性”。针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究表明，交易价差方向没有规律性，即没有明确的利益输送方向。同时潜在利益输送金额比较小，因此不构成利益输送。造成少量显著交易价差的原因来自两方面：一是报告期内股票市场的波动幅度较大，为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件；二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异，对证券买卖时点的把握也不同，导致股票买卖存在价差。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。本报告期公司旗下基金所管理的投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易。

### 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

今年以来货币政策保持中性，央行数次上调公开市场操作利率，传递出了货币政策逐渐收紧

的信号。一季度存单利率在年初曾经经历了一波下行，之后重新上行，并主要在 4.2%~4.6% 区间震荡。一季末 MPA 考核期间，银行收缩资产负债表，大量赎回货币基金，并且减少对非银机构的融出，一个月内的短端回购利率达到了 6% 以上，在此期间货币基金保持了充足的流动性，并择机配置了短期的存单和回购。进入二季度之后央行配合监管的趋严，在日常的操作中以平衡略偏紧为主。在四月初银行间利率下行、3 个月期股份制银行同业存单利率降低到 4.3% 附近之后，利率逐渐上行。伴随着对 6 月末资金面的悲观预期，非银机构纷纷降低久期和杠杆，进一步引起信用债和存单利率的上行。但是央行在 6 月份采取了偏宽松的操作，前半月合计净投放了约 5000 亿，叠加银行和非银机构为二季末做的充分准备，季末非常宽松，同业存单利率从高点下行超过 50BP。在此期间，货币基金大比例配置同业存单和逆回购，并适当加杠杆。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期华泰柏瑞天添宝货币 A 级的基金份额净值收益率为 1.8716%，本报告期华泰柏瑞天添宝货币 B 级的基金份额净值收益率为 1.9916%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，短端利率仍然较高，而资金面的走势基本可以被央行所掌控，从央行近期的表态来看，“削峰填谷”的意图仍然明显，短端利率的下降尚不能形成趋势，基金操作上仍将适度谨慎，配置以三个月期为主的资产，积极参与较长期限资产的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，计入投资人收益账户。本基金在本报告期共支付 62,750,010.45 元基金收益并结转为基金份额。

#### 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

在托管华泰柏瑞天添宝货币市场基金的过程中，本基金托管人一江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《华泰柏瑞天添宝货币市场基金基金合同》、《华泰柏瑞天添宝货币市场基金托管协议》的约定，对华泰柏瑞天添宝货币市场基金的基金管理人—华泰柏瑞基金管理有限公司 2017 年上半年度基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，华泰柏瑞基金管理有限公司在华泰柏瑞天添宝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《中华人民共和国证券投资基金法》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。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，华泰柏瑞基金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华泰柏瑞天添宝货币市场基金的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：华泰柏瑞天添宝货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,991,238,385.95	1,180,105,366.34
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,238,283,234.08	115,235,871.61
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,238,283,234.08	115,235,871.61
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	661,441,666.66	432,803,769.21
应收证券清算款		49,082,612.23	-
应收利息	6.4.7.5	15,270,129.69	2,674,087.84
应收股利		-	-
应收申购款		534,054.13	10,496,696.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	50,760.03	-
资产总计		6,955,900,842.77	1,741,315,791.00
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		674,283,942.85	-
应付证券清算款		17,000,000.00	-
应付赎回款		17,487.23	4,320.39
应付管理人报酬		799,737.38	127,938.06
应付托管费		210,457.19	29,852.19
应付销售服务费		405,747.69	86,314.09
应付交易费用	6.4.7.7	105,894.23	14,145.31

应交税费		-	-
应付利息		58,739.77	-
应付利润		747,212.29	176,249.52
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	51,127.52	55,000.00
负债合计		693,680,346.15	493,819.56
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	6,262,220,496.62	1,740,821,971.44
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		6,262,220,496.62	1,740,821,971.44
负债和所有者权益总计		6,955,900,842.77	1,741,315,791.00

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额为 6,262,220,496.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞天添宝货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		73,705,675.72
1.利息收入		73,987,133.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	42,051,891.73
债券利息收入		24,094,882.54
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		7,840,359.07
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-281,457.62
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	-281,457.62
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
<b>减：二、费用</b>		10,955,665.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,610,289.43
2. 托管费	6.4.10.2.2	882,173.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,064,000.34
4. 交易费用	6.4.7.19	30,410.00
5. 利息支出		5,297,524.83
其中：卖出回购金融资产支出		5,297,524.83
6. 其他费用	6.4.7.20	71,267.49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		62,750,010.45
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		62,750,010.45

注：基金合同生效日为 2016 年 9 月 22 日，无上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞天添宝货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	1,740,821,971.44	-	1,740,821,971.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	62,750,010.45	62,750,010.45
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）	4,521,398,525.18	-	4,521,398,525.18
其中：1. 基金申购款	9,154,965,365.22	-	9,154,965,365.22
2. 基金赎回款	-4,633,566,840.04	-	-4,633,566,840.04
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）	-	-62,750,010.45	-62,750,010.45
五、期末所有者权益（基	6,262,220,496.62	-	6,262,220,496.62

金净值)			
------	--	--	--

注：基金合同生效日为 2016 年 9 月 22 日，无上年度可比期间。

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：

<u>          韩勇          </u>	<u>          房伟力          </u>	<u>          赵景云          </u>
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

华泰柏瑞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”)证监基金字[2016]第 1838 号《关于准予华泰柏瑞天添宝货币市场基金注册的批复》核准，由华泰柏瑞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《华泰柏瑞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 201,930,396.50 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(2016)第 1237 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞天添宝货币市场基金基金合同》于 2016 年 9 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 201,930,396.50 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

根据本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司 2016 年 11 月 23 日《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞天添宝货币市场基金增加 B 类份额并修改基金合同的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2016 年 11 月 23 日起对本基金增加 B 类份额并相应修改基金合同。本基金原有的基金份额类别更名为 A 类基金份额，新增的基金份额类别命名为 B 类基金份额。A 类基金份额的业务规则与现行规则相同；新增 B 类基金份额的注册登记机构为华泰柏瑞基金管理有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞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现金；期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或

监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。  
本基金的业绩比较基准为：当期银行活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2017 年 6 月 30 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》、《华泰柏瑞天添宝货币市场基金 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间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政策和会计估计与上年度相一致。

#### **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[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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	31,238,385.95
定期存款	2,960,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	1,100,000,000.00
存款期限 3 个月以上	1,860,000,000.00
其他存款	-

合计:	2,991,238,385.95
-----	------------------

注：定期存款的存款期限为定期存款的票面存期。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	3,238,283,234.08	3,240,975,890.84	2,692,656.76	0.04%
	合计	3,238,283,234.08	3,240,975,890.84	2,692,656.76	0.04%

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

3. 本基金基金合同生效日为2016年9月22日，无上年可比期间数据。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	57,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	604,441,666.66	-
合计	661,441,666.66	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,347.67
应收定期存款利息	11,442,791.12
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	1,857,491.52
应收买入返售证券利息	1,967,499.38
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	15,270,129.69

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	50,760.03
合计	50,760.03

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	105,894.23
合计	105,894.23

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	51,127.52
合计	51,127.52



### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞天添宝货币 A 级		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	378,144,100.99	378,144,100.99
本期申购	5,149,825,150.31	5,149,825,150.31
本期赎回(以“-”号填列)	-3,195,491,410.10	-3,195,491,410.10
– 基金拆分/份额折算前	–	–
基金拆分/份额折算变动份额	–	–
本期申购	–	–
本期赎回(以“-”号填列)	–	–
本期末	2,332,477,841.20	2,332,477,841.20

金额单位：人民币元

华泰柏瑞天添宝货币 B 级		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,362,677,870.45	1,362,677,870.45
本期申购	4,005,140,214.91	4,005,140,214.91
本期赎回(以“-”号填列)	-1,438,075,429.94	-1,438,075,429.94
– 基金拆分/份额折算前	–	–
基金拆分/份额折算变动份额	–	–
本期申购	–	–
本期赎回(以“-”号填列)	–	–
本期末	3,929,742,655.42	3,929,742,655.42

注：1. 申购含红利再投份额。

2. 本基金于 2016 年 9 月 19 日期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 201,930,396.50 元。

3. 根据《华泰柏瑞天添宝货币市场基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资等业务公告》的相关规定，本基金的申购业务、赎回业务自 2016 年 9 月 23 日起开始办理。

4. 根据本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司 2016 年 11 月 23 日《华泰柏瑞基金管理有限公

司关于华泰柏瑞天添宝货币市场基金增加 B 类份额并修改基金合同的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2016 年 11 月 23 日起对本基金增加 B 类份额并相应修改基金合同。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞天添宝货币 A 级			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	15,761,277.08	-	15,761,277.08
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-15,761,277.08	-	-15,761,277.08
本期末	-	-	-

单位：人民币元

华泰柏瑞天添宝货币 B 级			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	46,988,733.37	-	46,988,733.37
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-46,988,733.37	-	-46,988,733.37
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	42,995.96
定期存款利息收入	42,007,881.77
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,014.00
其他	-
合计	42,051,891.73

### 6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-281,457.62
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-281,457.62

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,494,173,173.04
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,485,621,504.63
减：应收利息总额	8,833,126.03
买卖债券差价收入	-281,457.62

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期内无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.18 其他收入

注：无。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	30,410.00
合计	30,410.00

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	14,878.20
银行间账户服务费	24,476.24
其他费用	4,639.97
合计	71,267.49

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金直销机构、基金份额的注册登记机构
江苏银行股份有限公司（“江苏银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内未进行股票交易。

### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内未进行权证交易。

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	3,610,289.43
其中：支付销售机构的客户维护费	8,586.38

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的适用年费率计提，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×适用年费率/当年天数。

2016年9月22日(基金合同生效日)至2017年5月7日，管理人报酬的适用年费率为0.30%，自2017年5月8日起适用年费率为0.19%。

本基金基金合同生效日为2016年9月22日，无上年可比期间数据。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	882,173.18

注：支付基金托管人江苏银行的托管费按前一日基金资产净值的适用年费率计提，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×适用年费率/当年天数。

2016年9月22日(基金合同生效日)至2017年5月7日，托管人报酬的适用年费率为0.07%，自

2017 年 5 月 8 日起适用年费率为 0.05%。

本基金基金合同生效日为 2016 年 9 月 22 日，无上年可比期间数据。

### 6.4.10.2.3 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 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		
	华泰柏瑞天添宝货币 A 级	华泰柏瑞天添宝货币 B 级	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	837,574.98	107,824.06	945,399.04
华泰证券股份有限公司	349.33	-	349.33
江苏银行股份有限公司	112,261.12	-	112,261.12
合计	950,185.43	107,824.06	1,058,009.49

注：本基金 A 类基金份额应支付销售机构的销售服务费，按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，B 类基金份额应支付销售机构的销售服务费，按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率 (A 类 0.25\%, B 类 0.01\%)} \div \text{当年天数}$$

H 为每日 A 类或 B 类基金份额应支付的销售服务费

E 为前一日的 A 类或 B 类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各基金销售机构。

本基金合同生效日为 2016 年 9 月 22 日，无上年可比期间。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期与关联方未进行银行间同业市场债券和回购交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	华泰柏瑞天添宝货币 A 级	华泰柏瑞天添宝货币 B 级
基金合同生效日 ( 2016 )	-	-

年 9 月 22 日 ) 持有的基金份额		
期初持有的基金份额	53,206,819.23	30,081,362.35
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	1,006,814.88	601,869.82
减: 期间赎回/卖出总份额	88,892.89	-
期末持有的基金份额	54,124,741.22	30,683,232.17
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.8600%	0.4900%

注: 基金合同生效日为 2016 年 9 月 22 日, 无上年可比期间数据。

#### 6.4.10.4.2 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

##### 华泰柏瑞天添宝货币 A 级

份额单位: 份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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
柏瑞投资(原 AIG Global Investment Corp. (AIGGIC))	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-
苏州新区高新技术产业股份有限公司	-	-	-	-
华泰联合证券有限责任公司	-	-	-	-
江苏银行股份有限公司	40,010.20	0.0000%	201,459,830.82	11.5700%

##### 华泰柏瑞天添宝货币 B 级

份额单位: 份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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



华泰证券股份有限公司	-	-	-	-
苏州新区高新技术产业股份有限公司	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-
江苏银行股份有限公司	-	-	-	-

#### 6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
江苏银行股份有限公司	31,238,385.95	42,995.96

注：本基金基金合同生效日为2016年9月22日，无上年可比期间数据。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

##### 华泰柏瑞天添宝货币A级

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	本期利润分配 合计	备注
15,528,832.77	-	232,444.31	15,761,277.08	-

##### 华泰柏瑞天添宝货币B级

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	本期利润分配 合计	备注
46,650,214.91	-	338,518.46	46,988,733.37	-

### 6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未持有股票。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未持有股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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为 674,283,942.85 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
111615257	16 民生 CD257	2017 年 7 月 3 日	99.03	100,000	9,903,000.00
111780296	17 长沙银行 CD062	2017 年 7 月 3 日	97.82	1,000,000	97,820,000.00
111780314	17 盛京银行 CD132	2017 年 7 月 3 日	98.95	1,000,000	98,950,000.00
111795134	17 广州银行 CD034	2017 年 7 月 3 日	99.94	500,000	49,970,000.00
111797883	17 重庆农村商行 CD111	2017 年 7 月 3 日	99.45	500,000	49,725,000.00
111799316	17 西安银行 CD013	2017 年 7 月 3 日	99.15	500,000	49,575,000.00
111695423	16 广东顺德农商行 CD055	2017 年 7 月 3 日	99.80	316,000	31,536,800.00
179919	17 贴现国债 19	2017 年 7 月 3 日	99.81	100,000	9,981,000.00
160308	16 进出 08	2017 年 7 月 3 日	99.92	5,000	499,600.00
179921	17 贴现国债 21	2017 年 7 月 3 日	99.69	100,000	9,969,000.00
179926	17 贴现国债 26	2017 年 7 月 3 日	99.45	100,000	9,945,000.00
070214	07 国开 14	2017 年 7 月 3 日	99.57	130,000	12,944,100.00

		日			
150417	15 农发 17	2017 年 7 月 3 日	100.01	100,000	10,001,000.00
160018	16 付息国债 18	2017 年 7 月 3 日	99.90	200,000	19,980,000.00
170204	17 国开 04	2017 年 7 月 3 日	99.57	300,000	29,871,000.00
170401	17 农发 01	2017 年 7 月 3 日	99.62	200,000	19,924,000.00
179907	17 贴现国债 07	2017 年 7 月 3 日	99.63	900,000	89,667,000.00
179922	17 贴现国债 22	2017 年 7 月 3 日	99.63	400,000	39,852,000.00
179925	17 贴现国债 25	2017 年 7 月 3 日	99.49	300,000	29,847,000.00
179927	17 贴现国债 27	2017 年 7 月 3 日	99.39	100,000	9,939,000.00
179930	17 贴现国债 30	2017 年 7 月 3 日	99.27	300,000	29,781,000.00
合计				7,151,000	709,680,500.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0.00 元。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，投资于各类货币市场工具，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。本基金的基金管理人通过对国内外宏观经济发展以及货币、财政政策趋势等因素的分析辅以系统的数量模型和金融工程技术，对短期金融工具进行积极地投资管理，在有效控制风险和保持基金资产较高流动性的基础上，追求超过业绩基准的稳健投资收益。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行江苏银行，定期存款存放在广发银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、重庆农村商业银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司以及光大银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且

通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	3,217,993,300.00	92,229,842.68
合计	3,217,993,300.00	92,229,842.68

注：未评级的债券包括国债、政策性金融债、存单、超短融。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	22,994,500.00	23,006,028.93
合计	22,994,500.00	23,006,028.93

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购

赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2017 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额 674,283,942.85 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于定期存款和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	181,238,385.95	1,960,000,000.00	850,000,000.00	-	-	-	-2,991,238,385.95
交易性金融资产		548,509,129.64	2,666,774,984.21	9,999,312.20	12,999,808.03		3,238,283,234.08
买入返售金融资产	661,440,000.00	-	-	-	-	-	661,440,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	49,082,612.23	49,082,612.23
应收利息	-	-	-	-	-	15,270,129.69	15,270,129.69
应收申购款	-	-	-	-	-	534,054.13	534,054.13
其他资产	-	-	-	-	-	52,426.69	52,426.69
资产总计	842,678,385.95	2,508,509,129.64	3,516,774,984.21	9,999,312.20	12,999,808.03	64,939,222.74	6,955,900,842.77
负债							
卖出回购金融资产款	674,283,942.85	-	-	-	-	-	674,283,942.85
应付证券清算款	-	-	-	-	-	17,000,000.00	17,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	17,487.23	17,487.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	799,737.38	799,737.38
应付托管费	-	-	-	-	-	210,457.19	210,457.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-	405,747.69	405,747.69
应付交易费用	-	-	-	-	-	105,894.23	105,894.23
应付利息	-	-	-	-	-	58,739.77	58,739.77
应付利润	-	-	-	-	-	747,212.29	747,212.29
其他负债	-	-	-	-	-	51,127.52	51,127.52
负债总计	674,283,942.85	-	-	-	-	19,396,403.30	693,680,346.15
利率敏感度缺口	168,394,443.10	2,508,509,129.64	3,516,774,984.21	9,999,312.20	12,999,808.03	45,542,819.44	6,262,220,496.62
上年度末							
2016年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	954,105,366.34	226,000,000.00	-	-	-	-	-1,180,105,366.34
交易性金融资产	69,961,373.15	-	45,274,498.46	-	-	-	115,235,871.61
买入返售金融资产	432,802,000.00	-	-	-	-	-	432,802,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	2,674,087.84	2,674,087.84
应收申购款	-	-	-	-	-	10,496,696.00	10,496,696.00
其他资产	-	-	-	-	-	1,769.21	1,769.21

资产总计	1,456,868,739.49	226,000,000.00	45,274,498.46	-	-	13,172,553.05	1,741,315,791.00
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,320.39	4,320.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	127,938.06	127,938.06
应付托管费	-	-	-	-	-	29,852.19	29,852.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-	86,314.09	86,314.09
应付交易费用	-	-	-	-	-	14,145.31	14,145.31
应付利润	-	-	-	-	-	176,249.52	176,249.52
其他负债	-	-	-	-	-	55,000.00	55,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	493,819.56	493,819.56
利率敏感度缺口	1,456,868,739.49	226,000,000.00	45,274,498.46	-	-	12,678,733.49	1,740,821,971.44

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	2,170,000.00	-
2. 市场利率上升 25 个基点	-2,170,000.00	-	

注：上年度末（2016年12月31日），本基金持有交易性债券投资比例为 6.60%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于定期存款和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。



#### **6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

注：本基金主要投资于定期存款和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### **6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

注：本基金主要投资于定期存款和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### **6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

无。

#### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

## § 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	3,238,283,234.08	46.55
	其中:债券	3,238,283,234.08	46.55
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	661,441,666.66	9.51
	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	2,991,238,385.95	43.00
4	其他各项资产	64,937,556.08	0.93
5	合计	6,955,900,842.77	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	9.98	
	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	674,283,942.85	10.77
	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

注:本基金本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

### 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	86
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：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	23.21	11.04
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	22.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	32.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	8.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	23.59	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		110.82	11.04

### 7.4 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	248,909,891.97	3.97

2	央行票据	-	-
3	金融债券	82,767,881.62	1.32
	其中：政策性金融债	82,767,881.62	1.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	149,977,749.98	2.39
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,756,627,710.51	44.02
8	其他	-	-
9	合计	3,238,283,234.08	51.71
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 7.5 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	111710324	17 兴业银行 CD324	3,500,000	342,359,878.86	5.47
2	111710291	17 兴业银行 CD291	2,500,000	247,426,730.20	3.95
3	111780017	17 宁波银行 CD113	2,000,000	197,889,769.92	3.16
4	111715195	17 民生银行 CD195	2,000,000	197,810,402.65	3.16
5	111780429	17 中原银行 CD152	2,000,000	195,492,633.46	3.12
6	011753042	17 国电集 SCP003	1,000,000	99,992,473.67	1.60
7	111790902	17 厦门银行 CD038	1,000,000	99,655,259.30	1.59
8	111709173	17 浦发银行 CD173	1,000,000	99,641,222.86	1.59
9	111780314	17 盛京银行 CD132	1,000,000	98,891,589.36	1.58
10	111780296	17 长沙银行 CD062	1,000,000	97,770,939.66	1.56

## 7.6 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.04%
报告期内偏离度的最低值	-0.06%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.02%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：无。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：无。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 投资组合报告附注

### 7.8.1

本基金计价采用摊余成本法，即计价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，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额资产净值保持在人民币 1.00 元。

本基金本报告期内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。

### 7.8.2

本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体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。

### 7.8.3 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	49,082,612.23
3	应收利息	15,270,129.69
4	应收申购款	534,054.13
5	其他应收款	-
6	待摊费用	50,760.03
7	其他	-
8	合计	64,937,556.08

## § 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
华泰柏瑞天添宝货币 A 级	34,637	67,340.64	68,480,249.08	2.94%	2,263,997,592.12	97.06%
华泰柏瑞天添宝货币 B 级	20	196,487,132.77	3,929,742,655.42	100.00%	-	0.00%
合计	34,657	180,691.36	3,998,222,904.50	63.85%	2,263,997,592.12	36.15%

### 8.2 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	华泰柏瑞天添宝货币 A 级	15,352,623.16	0.6582%
	华泰柏瑞天添宝货币 B 级	-	-
	合计	15,352,623.16	0.2452%

### 8.3 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	华泰柏瑞天添宝货币 A 级	100 以上
	华泰柏瑞天添宝货币 B 级	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞天添宝货币 A 级	0~10
	华泰柏瑞天添宝货币 B 级	-

	合计	-
--	----	---

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 100 万份以上

该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	华泰柏瑞天添宝 货币 A 级	华泰柏瑞天添宝 货币 B 级
基金合同生效日（2016 年 9 月 22 日）基金 份额总额	201,930,396.50	-
本报告期期初基金份额总额	378,144,100.99	1,362,677,870.45
本报告期基金总申购份额	5,149,825,150.31	4,005,140,214.91
减：本报告期基金总赎回份额	3,195,491,410.10	1,438,075,429.94
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	2,332,477,841.20	3,929,742,655.42



## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

自 2017 年 4 月 6 日至 2017 年 5 月 5 日本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于调整华泰柏瑞天添宝货币市场基金管理费率、托管费率并修改基金合同的议案》，降低本基金的管理费率和托管费率。

上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自 2017 年 5 月 8 日起，由原《基金合同》修订而成的《华泰柏瑞天添宝货币市场基金基金合同》生效，原《基金合同》同日起失效。

### 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

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

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 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

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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	
广发证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

### 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
广发证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内没有出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

## 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞天添宝基金基金份额持有人大会公证书	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2017 年 5 月 9 日
2	华泰柏瑞天添宝基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2017 年 5 月 9 日
3	华泰柏瑞天添宝证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2017 年 4 月 24 日
4	华泰柏瑞基金关于以通讯方式召开华泰柏瑞天添宝货币市场基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2017 年 4 月 8 日
5	华泰柏瑞基金关于以通讯方式召开华泰柏瑞天添宝货币市场基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2017 年 4 月 7 日
6	天添宝货币修改管理费率托管费率持有人大会公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2017 年 4 月 6 日
7	华泰柏瑞天添宝货币市场基金 2016 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2017 年 3 月 29 日
8	华泰柏瑞天添宝货币市场基金 2016 年年度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2017 年 3 月 29 日
9	华泰柏瑞天添宝货币市场证券投资基金限制大额申购（含转换转入）业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2017 年 2 月 28 日
10	华泰柏瑞天添宝货币基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2017 年 1 月 19 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017.1.1-2017.1.5	201,458,830.82	1,486,629.07	202,905,449.69	40,010.20	0.000639
	2	2017.1.1-2017.1.16	100,010,347.81	152,592.77	100,162,940.58	-	0.00
	3	2017.1.1-2017.1.5	1,100,000,000.00	-	1,100,000,000.00	-	0.00
	4	2017.2.28-2017.6.30	-	3,043,915,039.87	-	3,043,915,039.87	48.61
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

### 12.3 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。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费）021-3878 4638 公司网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日