

# 汇添富货币市场基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 日

## § 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 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	汇添富货币			
基金主代码	519518			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2006 年 3 月 23 日			
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司			
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司			
报告期末基金份 额总额	26,545,904,666.30 份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基 金简称	汇添富货币 A	汇添富货币 B	汇添富货币 C	汇添富货币 D
下属分级基金的交 易代码	519518	519517	000642	000650
报告期末下属分级 基金的份额总额	296,639,995.93 份	18,840,922,377.90 份	5,759,512,530.79 份	1,648,829,761.68 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	力求本金稳妥和基金资产高流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。
业绩比较基准	税后活期存款利率(即活期存款利率×(1-利息税率))。
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。

### 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	汇添富基金管理股份有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李鹏	胡波
	联系电话	021-28932888	021-61618888
	电子邮箱	service@99fund.com	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95528
传真		021-28932998	021-63602540

## 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.99fund.com
基金半年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

## § 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-2019年6月30日)			
	汇添富货币 A	汇添富货币 B	汇添富货币 C	汇添富货币 D
本期已 实现收 益	3,401,535.91	340,873,935.61	71,867,261.62	26,986,145.25
本期利 润	3,401,535.91	340,873,935.61	71,867,261.62	26,986,145.25
本期净 值收益 率	1.3416%	1.4621%	1.3416%	1.3416%
3.1.2 期末数 据和指 标	报告期末(2019年6月30日)			
期末基 金资产 净值	296,639,995.93	18,840,922,377.9 0	5,759,512,530.79	1,648,829,761.68

期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
----------	--------	--------	--------	--------

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。

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（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

汇添富货币 A

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	0.2034%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.1746%	0.0003%
过去三个月	0.6450%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.5577%	0.0004%
过去六个月	1.3416%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	1.1680%	0.0006%
过去一年	2.9793%	0.0010%	0.3503%	0.0000%	2.6290%	0.0010%
过去三年	10.1333%	0.0018%	1.0535%	0.0000%	9.0798%	0.0018%
自基金合同生效日起至今	50.7263%	0.0061%	12.7743%	0.0030%	37.9520%	0.0031%

汇添富货币 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	0.2232%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.1944%	0.0003%
过去三个月	0.7052%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.6179%	0.0004%
过去六个月	1.4621%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	1.2885%	0.0006%
过去一年	3.2268%	0.0010%	0.3503%	0.0000%	2.8765%	0.0010%
过去三年	10.9288%	0.0018%	1.0535%	0.0000%	9.8753%	0.0018%

自基金合同生效 日起至今	51.6948%	0.0062%	10.2436%	0.0030%	41.4512%	0.0032%
-----------------	----------	---------	----------	---------	----------	---------

汇添富货币 C

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	0.2034%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.1746%	0.0003%
过去三个月	0.6450%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.5577%	0.0004%
过去六个月	1.3416%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	1.1680%	0.0006%
过去一年	2.9793%	0.0010%	0.3503%	0.0000%	2.6290%	0.0010%
过去三年	10.1333%	0.0018%	1.0535%	0.0000%	9.0798%	0.0018%
自基金合同生 效日起至今	17.7266%	0.0027%	1.7870%	0.0000%	15.9396%	0.0027%

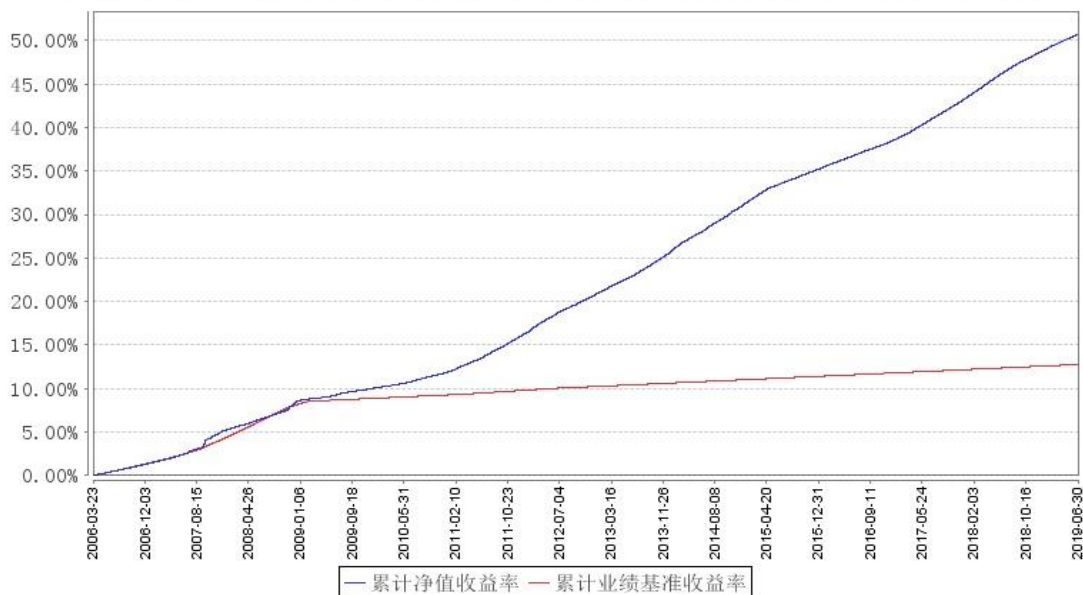
汇添富货币 D

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	0.2034%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.1746%	0.0003%
过去三个月	0.6450%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.5577%	0.0004%
过去六个月	1.3416%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	1.1680%	0.0006%
过去一年	2.9793%	0.0010%	0.3503%	0.0000%	2.6290%	0.0010%
过去三年	10.1333%	0.0018%	1.0535%	0.0000%	9.0798%	0.0018%
自基金合同生 效日起至今	17.7261%	0.0027%	1.7870%	0.0000%	15.9391%	0.0027%

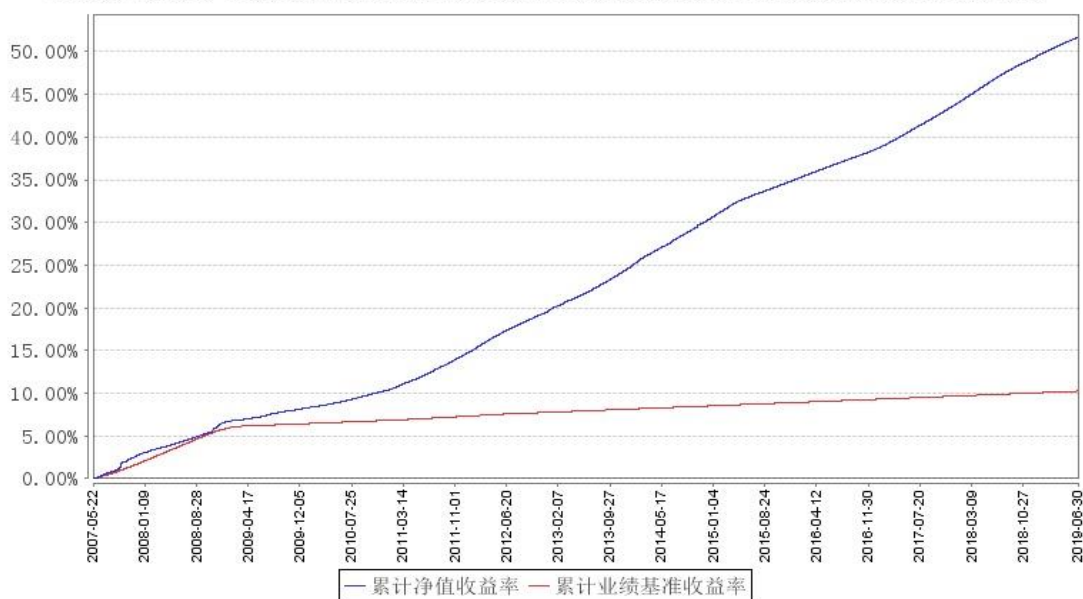
注:2012年8月21日,本基金收益分配由按月结转份额改为按日结转份额。

### 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

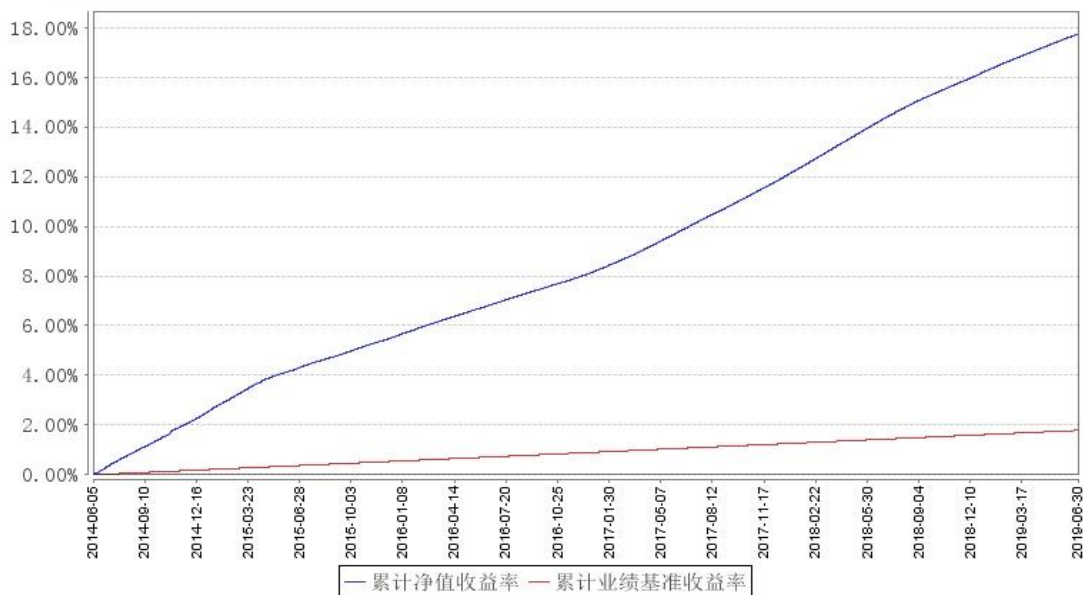
汇添富货币A 累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



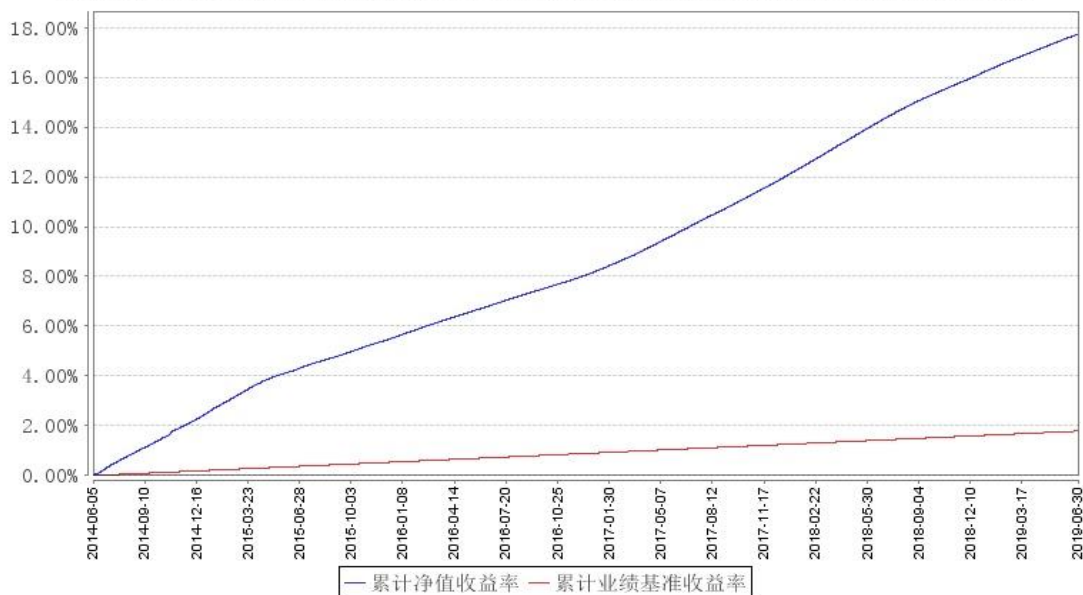
汇添富货币B 累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



汇添富货币C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



汇添富货币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：1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2006年3月23日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

2、本基金从本《基金合同》生效之日起至2009年2月15日采用的业绩比较基准为同期税后一年定期存款利率。从2009年2月16日起，本基金业绩比较基准为同期税后活期存款利率。



## § 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

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立。目前，公司注册资本金为 132,724,224 元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理、全国社保基金境外配售策略方案投资管理、基本养老保险基金投资管理、保险资金投资管理、专户资产管理、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2019 上半年，汇添富基金新成立 13 只公开募集证券投资基金，包括 5 只债券型基金、4 只混合型基金、2 只基金中基金、2 只指数基金联接基金。截至 2019 年 6 月 30 日，公司共管理 133 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

#### 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		
徐寅喆	汇添富和聚宝货币基金、汇添富理财 7 天债券基金、汇添富货币基金、汇添富理财 14 天债券基金、汇添富理财 30 天债券基金、汇添富理财 60 天债券基金、汇添富添	2018 年 5 月 4 日	-	11	国籍：中国。学历：复旦大学法学学士。曾任长江养老保险股份有限公司债券交易员。2012 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司任债券交易员、固定收益基金经理助理。2014 年 8 月 27 日至今任汇添富理财 7 天债券型证券投资基金的基金经理，2014 年 8 月 27 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富收益快线货

	富通货币基金的基金经理。				币市场基金的基金经理，2014 年 11 月 26 日至今任汇添富和聚宝货币市场基金经理，2014 年 12 月 23 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富收益快钱货币基金基金经理，2016 年 6 月 7 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富全额宝货币基金的基金经理，2018 年 5 月 4 日至今任汇添富货币基金、汇添富理财 14 天债券基金、汇添富理财 30 天债券基金、汇添富理财 60 天债券基金的基金经理，2019 年 1 月 25 日至今任汇添富添富通货币基金的基金经理。
温开强	汇添富理财 30 天债券、汇添富添富通货币、汇添富货币、汇添富理财 7 天债券的基金经理，汇添富现金宝货币、汇添富理财 14 天债券、汇添富理财 60 天债券基金的基金经理助理	2019 年 1 月 25 日	-	7	国籍：中国，学历：天津大学管理学硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格、CFA。从业经历：曾任长城基金债券交易员、中金基金交易主管，高级经理，2016 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司，2016 年 8 月 30 日至今任汇添富现金宝货币、汇添富理财 14 天债券、汇添富理财 60 天债券基金的基金经理助理，2016 年 8 月 30 日至 2019 年 1 月 25 日任汇添富添富通货币、汇添富货币的基金经理助理，2016 年 8 月 30 日至

					2018 年 8 月 7 日任汇添富理财 30 天债券的基金经理助理，2018 年 8 月 7 日至今任汇添富理财 30 天债券的基金经理，2019 年 1 月 25 日至今任汇添富添富通货币、汇添富货币、汇添富理财 7 天债券的基金经理。
蒋文玲	现金宝货币基金、实业债债券基金、优选回报混合基金、汇添富鑫益定开债基金、添富年年益定开混合、添富鑫汇定开债券基金、汇添富睿丰混合（LOF）基金、汇添富新睿精选混合基金、添富短债债券基金、添富丰润中短债基金、汇添富丰利短债基金、汇添富 90 天短债基金的基金经理，汇添富多元收益债券基金的基金经理助理。	2016 年 6 月 7 日	2019 年 1 月 25 日	13	国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员。2012 年 11 月 30 日至 2014 年 1 月 7 日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理。2014 年 1 月加入汇添富基金，历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理。2014 年 4 月 8 日至今任汇添富多元收益债券基金的基金经理助理，2015 年 3 月 10 日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富优选回报混合基金（原理财 21 天债券基金）的基金经理，2015 年 3 月 10 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富理财 14 天债券基金的基金经理，2016 年 6 月 7 日至 2019 年 1 月 25 日任汇添富货币基金的基金经理，2016 年 6 月 7 日至今任实

					<p>业债债券基金的基金经理，2016 年 6 月 7 日至 2019 年 1 月 25 日任添富货币基金基金经理，2016 年 6 月 7 日至 2018 年 5 月 4 日任理财 30 天债券基金、理财 60 天债券基金的基金经理，2017 年 4 月 20 日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理，2017 年 5 月 15 日至今任添富年年益定开混合基金的基金经理，2017 年 6 月 23 日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理，2018 年 8 月 2 日至今任汇添富睿丰混合(LOF)基金、汇添富新睿精选混合基金的基金经理，2018 年 12 月 13 日至今任添富短债债券基金的基金经理，2018 年 12 月 24 日至今任添富丰润中短债基金的基金经理，2019 年 1 月 18 日至今任汇添富丰利短债基金的基金经理，2019 年 6 月 12 日至今任汇添富 90 天短债基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 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

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的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总成交量 5%的交易次数为 5 次，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

## 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

2019 年上半年 GDP 同比增长 6.3%，分季度观察，2 季度实际 GDP 的增速为 6.2%，较 1 季度的 6.4%有所下降，但名义 GDP 增速从 1 季度的 7.8%提升至 8.3%。综合分析，尽管 2 季度经济延续下行趋势，但仍运行在合理区间，保持稳中有进态势。居民消费方面，上半年社会消费品零售总额增长 8.4%，其中 6 月份增速为 9.8%，缘由汽车消费回升带来出色表现。上半年固定资产投资增长

5.8%，略高于市场预期。外部环境方面，中美经贸关系峰回路转，5月双方谈判出现停摆，市场避险情绪迅速抬升，但大阪 G20 峰会后，中美两国元首决定重启两国经贸磋商，外部风险有所缓和。政策层面，为积极应对经济下行压力和外部风险，中央出台一系列“逆周期”调节政策，包括积极的财政政策和稳健的货币政策。财政政策加力提效，将赤字率上调至 2.8%，增加了 8000 亿专项债的发行额度，并且加大力度和节等，以及实施更大力度的减税降费等政策措施。货币政策灵活适度，继续强调松紧适度，保持广义货币 M2 和社会融资规模增速与国内生产总值名义增速相匹配。金融监管方面，金融风险防控稳妥推进，把握好处置风险的力度和节奏。今年上半年市场流动性整体保持合理充裕，5月下旬以来，流动性出现明显分层现象。银行间隔夜 R001 资金价格振幅较大，尽管一段时间跌破 1%，但中枢水平并未有稳固下移迹象。短端资产方面，国有股份制银行 3M 期限存单从年初 3.09%降至 3月底的 2.6%后反弹至 6月中旬的 2.98%，随后快速降至 2.5%。

本基金上半年组合规模有所下降。针对市场流动性环境出现的新变化，组合投资操作上采取灵活稳健的思路。在组合风险安全可控的前提下，努力为基金持有人获取更好的投资收益。整体思路是对组合剩余天数和杠杆水平进行灵活调节，同时对组合持有的债券种类和期限结构进行灵活切换。报告期内以高等级银行存款、高等级同业存单、逆回购为主要配置资产，抓住季末、缴税期等关键时点进行积极配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富货币 A 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.3416%；截至本报告期末汇添富货币 B 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.4621%；截至本报告期末汇添富货币 C 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.3416%；截至本报告期末汇添富货币 D 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.3416%；同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年宏观经济的不确定性依然较大，宏观政策在“稳增长”和“防风险”之间更加灵活地寻求平衡。外部环境方面，中美贸易谈判曲折前进，短期内难以出现一劳永逸的解决方案，两国经贸关系的纷争将长期持续化。国内方面，宏观经济的下行压力有所加大，但经济总体运行在合理区间。中央适时适度推出以加大基建为代表的逆周期政策，全面做好“六稳”，但房地产投资预

计出现拐点。一方面，房地产调控政策坚持“房子是用来住的、不是用来炒的定位”，明确提出不会将房地产作为短期刺激经济的手段以及今年棚改缩量的影响将逐渐显现；另一方面，房地产融资渠道不断收窄，从公开债券、信托融资到海外美元债都在边际收紧，对房地产投资的资金来源构成制约。政策方面，下半年预计将继续稳妥推进金融风险防控，把握好处置风险的力度和节奏，继续深化金融供给侧结构性改革。

根据货币基金的产品特点，本基金始终坚持货币市场基金作为流动性管理工具的定位，在保障组合流动性安全的情况下，努力为基金持有人争取更好的收益。针对流动性环境的新情况，积极研判货币市场的变化，在投资策略保持灵活稳健。具体基金操作上，在资产配置选择、杠杆水平、组合剩余天数等方面进行动态调整。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金每日计算投资人帐户当日所产生的收益，每月将投资人帐户累计的收益结转为基金份额，计入该投资人帐户的基金份额中。2012年8月21日，本基金收

益分配由按月结转份额改为按日结转份额。

本基金期初应付收益人民币 0 元，2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日期间累计分配收益人民币 443,128,878.39 元，其中人民币 443,128,878.39 元以红利再投资方式结转入实收基金，期末应付收益为人民币 0 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇添富货币市场基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇添富货币市场基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金收益的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，由汇添富基金管理股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。



## § 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：汇添富货币市场基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	10,970,753,338.78	13,979,175,628.48
结算备付金	72,051,000.00	70,909,090.91
存出保证金	5,141.87	-
交易性金融资产	10,168,673,064.50	10,455,424,327.48
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	10,168,673,064.50	10,455,424,327.48
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	5,504,099,151.15	6,060,332,645.48
应收证券清算款	151,121,250.00	-
应收利息	129,188,403.72	143,161,862.45
应收股利	-	-
应收申购款	8,586,371.98	25,274,707.66
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	27,004,477,722.00	30,734,278,262.46
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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	449,999,575.00	1,999,975,440.03
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	70,008.75	1,974.01
应付管理人报酬	3,587,759.87	4,166,814.39
应付托管费	1,195,919.95	1,388,938.12
应付销售服务费	1,805,023.84	1,783,989.36
应付交易费用	78,378.25	99,976.98
应交税费	1,495,656.61	1,505,646.87
应付利息	51,466.10	1,051,726.24

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	289,267.33	389,329.56
负债合计	458,573,055.70	2,010,363,835.56
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	26,545,904,666.30	28,723,914,426.90
未分配利润	-	-
所有者权益合计	26,545,904,666.30	28,723,914,426.90
负债和所有者权益总计	27,004,477,722.00	30,734,278,262.46

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 26,545,904,666.30 份，其中汇添富货币 A 基金份额总额为 296,639,995.93 份，基金份额净值 1 元；汇添富货币 B 基金份额总额为 18,840,922,377.90 份，基金份额净值 1 元；汇添富货币 C 基金份额总额为 5,759,512,530.79 份，基金份额净值 1 元；汇添富货币 D 基金份额总额为 1,648,829,761.68 份，基金份额净值 1 元。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富货币市场基金

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	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	487,236,765.24	369,079,564.99
1. 利息收入	489,598,249.33	377,337,025.03
其中：存款利息收入	258,693,331.33	191,032,635.05
债券利息收入	167,891,568.33	150,789,898.63
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	63,013,349.67	35,514,491.35
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-2,815,457.16	-8,311,310.07
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,815,457.16	-8,311,310.07
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）	453,973.07	53,850.03
减：二、费用	44,107,886.85	28,049,393.47

1. 管理人报酬	23,175,587.77	12,265,341.97
2. 托管费	7,725,195.95	4,088,447.32
3. 销售服务费	10,690,551.54	9,180,415.09
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	2,271,127.43	2,228,613.97
其中：卖出回购金融资产支出	2,271,127.43	2,228,613.97
6. 税金及附加	33,453.24	28,116.12
7. 其他费用	211,970.92	258,459.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	443,128,878.39	341,030,171.52

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富货币市场基金

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）	28,723,914,426.90	-	28,723,914,426.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	443,128,878.39	443,128,878.39
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）	-2,178,009,760.60	-	-2,178,009,760.60
其中：1. 基金申购款	71,355,394,363.78	-	71,355,394,363.78
2. 基金赎回款	-73,533,404,124.38	-	-73,533,404,124.38
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）	-	-443,128,878.39	-443,128,878.39
五、期末所有者权益（基金净值）	26,545,904,666.30	-	26,545,904,666.30
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)	10,288,521,703.43	-	10,288,521,703.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	341,030,171.52	341,030,171.52
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)	9,335,094,494.50	-	9,335,094,494.50
其中：1. 基金申购款	75,044,597,757.76	-	75,044,597,757.76
2. 基金赎回款	-65,709,503,263.26	-	-65,709,503,263.26
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)	-	-341,030,171.52	-341,030,171.52
五、期末所有者权益(基金净值)	19,623,616,197.93	-	19,623,616,197.93

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

李骁

雷青松

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

汇添富货币市场基金（以下简称“本基金”），系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[2006]21 号文《关于核准汇添富货币市场基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开发行募集，基金合同于 2006 年 3 月 23 日正式生效，首次设立募集规模为 4,104,914,022.13 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司和汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

2007 年 5 月 22 日，本基金按照 500 万份基金份额的界限划分为 A 级基金份额和 B 级基金份额，单一持有人持有 500 万份基金份额以下的为 A 级，达到或超过 500 万份的为 B 级。本基金份额分级规则于分级日起生效。基金分级后，当份额持有人在单个基金账户保留的基金份额减少至 500 万份以下时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金帐户持有的 B 级基金份额降级为 A 级基金份额；相应地，当达到或超过 500 万份时，A 级基金份额自动升级为 B 级基金份额。两级基金份额单独计算及公布基金日收益和基金七日收益率。

自 2014 年 6 月 5 日起本基金增设 C 级基金份额和 D 级基金份额。增设基金份额后，本基金将分设 A 级基金份额、B 级基金份额、C 级基金份额和 D 级基金份额。其中 A 级、B 级基金份额可通过场内、场外两种方式交易，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，单一持有人持有 500 万份基金份额以下的为 A 级基金份额，达到或超过 500 万份的为 B 级基金份额；C 级基金份额仅开通场外申赎，注册登记机构为汇添富基金管理股份有限公司，不进行基金份额升降级；D 级基金份额仅开通场外申赎，销售机构为上海浦东发展股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，不进行基金份额升降级。本基金 A 级份额和 B 级份额基金收益为“每日分配，按月支付”，C 级份额和 D 级份额基金收益为“每日分配，按日支付”。各级基金份额单独设置基金代码，并单独公布各级基金每万份基金净收益和七日年化收益率。

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：现金；通知存款；一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；期限在一年以内（含一年）的债券回购；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；短期融资券及中国证监会、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。本基金结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。本基金的业绩比较基准为：税后活期存款利率即（活期存款利率×（1-利息税率））。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基  
金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2019 年 6 月 30 日的财  
务状况以及 2019 年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### 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 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》  
的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金  
融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开  
放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债  
利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券  
取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充  
通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金  
融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管  
理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金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。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

#### 6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业发展费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 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

本报告期内未发生与本基金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。

#### 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
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：以下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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：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	
	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 成交总额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	40,609,008.22	100.00	-	-

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	91,730,900,000.00	100.00	190,000,000.00	100.00



#### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

#### 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 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
当期发生的基金应支付的管理费	23,175,587.77	12,265,341.97
其中：支付销售机构的客户维护费	973,788.84	683,442.64

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费在基金合同生效后每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月第 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	7,725,195.95	4,088,447.32

注：自 2006 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 18 日前，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 年费率计提；于 2017 年 12 月 18 日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费在基金合同生效后每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 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				
	汇添富货币 A	汇添富货币 B	汇添富货币 C	汇添富货币 D	合计
东方证券股份有限公司	10,120.13	0.00	6,708,868.97	0.00	6,718,989.10
上海浦东发展银行股份有限公司	8,837.85	254.94	0.00	2,500,523.10	2,509,615.89
汇添富基金管理股份有限公司	65,201.93	1,009,439.94	0.00	0.00	1,074,641.87
合计	84,159.91	1,009,694.88	6,708,868.97	2,500,523.10	10,303,246.86
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				
	汇添富货币 A	汇添富货币 B	汇添富货币 C	汇添富货币 D	合计
东方证券股份有限公司	14,060.16	787.26	5,072,269.80	0.00	5,087,117.22
上海浦东发展银行股份有限公司	11,623.94	926.17	0.00	3,391,567.61	3,404,117.72
汇添富基金管理股份有限公司	41,933.00	456,064.06	0.00	0.00	497,997.06
合计	67,617.10	457,777.49	5,072,269.80	3,391,567.61	8,989,232.00

注：自 2006 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 17 日止期间，本基金各级基金份额

按照不同的费率计提销售服务费, A 级基金的基金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 级基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率计提; C 级基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提; D 级基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。于 2017 年 12 月 18 日起, 本基金各级基金份额按照不同的费率计提销售服务费, 但各级基金份额的销售服务费率均不超过 0.25% 年费率。各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为各级基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日的该级基金份额的基金资产净值

R 为该级基金份额的销售服务费率

各级基金份额的销售服务费在基金合同生效后每日计提, 按月支付, 由基金托管人于次月首 5 个工作日内从基金财产中一次性划往基金注册登记清算账户。由基金管理人支付给各销售机构, 若遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。

#### 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
上海浦东发展银行股份有限公司	196,909,125.68	-	-	-	59,994,000.00	4,585.84
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
上海浦东发展银行股份有限公司	-	-	202,740,000.00	777,632.88	1,313,915,000.00	285,237.50

#### 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固有资金投资本基金的情况

注:本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 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
上海浦东发展银行股份有限公司	709,753,338.78	29,153,039.54	2,590,049,850.21	17,777,288.30

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本期及上年度可比期间在承销期内未有参与关联方承销证券的情况。

#### 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

注:本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告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 2019 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 449,999,575.00 元，是以如下债券作为质押：

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
180202	18 国开 02	2019 年 7 月 1 日	101.16	2,000,000	202,310,667.35
180410	18 农发 10	2019 年 7 月 1 日	100.05	2,500,000	250,123,224.78
合计				4,500,000	452,433,892.13

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

### 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	10,168,673,064.50	37.66
	其中：债券	10,168,673,064.50	37.66
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	5,504,099,151.15	20.38
	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	11,042,804,338.78	40.89
4	其他各项资产	288,901,167.57	1.07
5	合计	27,004,477,722.00	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	0.61	
	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	449,999,575.00	1.70
	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。

## 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	57

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金合同约定：“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”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

### 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	34.25	1.70
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	22.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	14.65	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	3.95	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	25.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

合计	101.21	1.70
----	--------	------

#### 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

注:报告期内投资组合平均剩余存续期无超过 240 天情况

#### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,702,645,994.12	6.41
	其中:政策性金融债	1,702,645,994.12	6.41
4	企业债券	40,176,786.66	0.15
5	企业短期融资券	1,051,620,200.85	3.96
6	中期票据	50,058,999.80	0.19
7	同业存单	7,324,171,083.07	27.59
8	其他	-	-
9	合计	10,168,673,064.50	38.31
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	111808292	18 中信银行 CD292	5,000,000	498,243,816.10	1.88
2	180209	18 国开 09	4,600,000	460,051,386.12	1.73
3	180410	18 农发 10	4,000,000	400,197,159.65	1.51
4	111808278	18 中信银行 CD278	4,000,000	398,735,480.52	1.50
5	111907068	19 招商银行 CD068	3,000,000	299,530,206.63	1.13
6	111811206	18 平安银行 CD206	3,000,000	299,453,622.88	1.13
7	111810369	18 兴业银行 CD369	3,000,000	299,226,017.30	1.13

8	190402	19 农发 02	3,000,000	298,956,904.40	1.13
9	111903066	19 农业银行 CD066	3,000,000	295,879,367.70	1.11
10	111991656	19 汇丰银行 CD004	3,000,000	294,095,546.38	1.11

### 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	0.0804%
报告期内偏离度的最低值	0.0062%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0423%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内偏离度的绝对值无达到 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

注：本基金本报告期内偏离度的绝对值无达到 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

注：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计价，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，在其剩余期限内平均摊销。

#### 7.9.2

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，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	5,141.87
2	应收证券清算款	151,121,250.00
3	应收利息	129,188,403.72
4	应收申购款	8,586,371.98



5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	288,901,167.57

## § 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(%)
汇添富货币 A	12,862	23,063.29	71,250,613.68	24.02	225,389,382.25	75.98
汇添富货币 B	125	150,727,379.02	18,789,890,689.24	99.73	51,031,688.66	0.27
汇添富货币 C	32,637	176,471.87	919,038,236.46	15.96	4,840,474,294.33	84.04
汇添富货币 D	526,458	3,131.93	1,505.04	0.00	1,648,828,256.64	100.00
合计	572,082	46,402.27	19,780,181,044.42	74.51	6,765,723,621.88	25.49

### 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	银行类机构	1,318,419,182.18	4.97
2	其他机构	1,068,279,874.07	4.02
3	银行类机构	1,019,802,522.57	3.84
4	银行类机构	992,300,792.22	3.74
5	银行类机构	862,878,468.63	3.25
6	银行类机构	513,495,132.37	1.93
7	银行类机构	511,894,010.65	1.93
8	银行类机构	511,805,098.26	1.93
9	银行类机构	508,684,025.25	1.92
10	银行类机构	507,467,271.25	1.91

### 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	汇添富货币 A	45,405.95	0.02
	汇添富货币 B	-	-
	汇添富货币 C	-	-
	汇添富货币 D	6,812.34	0.00

金			
	合计	52,218.29	0.00

#### 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	汇添富货币 A	0
	汇添富货币 B	0
	汇添富货币 C	0
	汇添富货币 D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富货币 A	0
	汇添富货币 B	0
	汇添富货币 C	0
	汇添富货币 D	0
	合计	0

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富货币 A	汇添富货币 B	汇添富货币 C	汇添富货币 D
基金合同生效日 (2006年3月23日) 基金份额总额	4,101,914,022.13	-	-	-
本报告期期初基金份额总额	267,894,137.47	23,538,815,502.04	2,515,576,700.02	2,401,628,087.37
本报告期基金总申购份额	400,242,080.99	16,384,214,459.73	52,472,894,504.55	2,098,043,318.51
减：本报告期基金总赎回份额	371,496,222.53	21,082,107,583.87	49,228,958,673.78	2,850,841,644.20
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	296,639,995.93	18,840,922,377.9 0	5,759,512,530.79	1,648,829,761.68
----------------------	----------------	-----------------------	------------------	------------------

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 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

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	

东方证券	2	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

### 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
东方证券	40,609,008.22	100.00%	91,730,900,000.00	100.00%	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。
- (8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注:本基金本报告期未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

注:无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

汇添富基金管理股份有限公司

2019 年 8 月 29 日