

华宝现金添益交易型货币市场基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 3 月 29 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 2024 年 03 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。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
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	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	49

8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 债券回购融资情况.....	50
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	50
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	51
8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	52
8.8 期末按实际利率计算账面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.....	52
8.9 投资组合报告附注.....	52
§9 基金份额持有人信息.....	55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	55
9.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	56
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
9.5 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情况	56
§10 开放式基金份额变动.....	56
§11 重大事件揭示.....	57
11.1 基金份额持有人大会决议.....	57
11.2 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	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4 基金投资策略的改变.....	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	60
11.9 其他重大事件.....	60
§12 影响投资者决策的其他重要信息	61
12.1 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	61
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
§13 备查文件目录.....	61
13.1 备查文件目录.....	61
13.2 存放地点.....	62
13.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝现金添益交易型货币市场基金	
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	
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	93,766,224,358.14 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
下属分级基金的场内简称	华宝添益 ETF	-
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	92,218,719,351.77 份	1,547,505,006.37 份

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	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。

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	周雷	王小飞
	联系电话	021-38505888	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	021-60637228

传真	021-38505777	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	黄孔威	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人	北京市西城区太平桥大街 17 号、中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年		2022 年		2021 年	
	华宝添益	华宝添益 B	华宝添益	华宝添益 B	华宝添益	华宝添益 B
本期已实现收益	1,831,933,183.64	436,130,789.77	2,474,515,211.29	757,720,903.92	3,462,007,823.48	848,416,355.55
本期利润	1,831,933,183.64	436,130,789.77	2,474,515,211.29	757,720,903.92	3,462,007,823.48	848,416,355.55
本期净值收益率	1.6645%	1.9088%	1.6397%	1.8839%	2.0501%	2.2953%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	华宝添益	华宝添益 B	华宝添益	华宝添益 B	华宝添益	华宝添益 B
期末基金资产净值	92,218,719,351.77	1,547,505,006.37	123,965,197,953.20	8,056,097,602.63	144,694,436,289.70	12,908,161,476.00
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	华宝添益	华宝添益 B	华宝添益	华宝添益 B	华宝添益	华宝添益 B
累计净值收	35.0059%	23.4306%	32.7955%	21.1187%	30.6531%	18.8792%

益率						
----	--	--	--	--	--	--

- 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. 净值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）。
4. 期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
5. 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
过去三个月	0.4380%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.0977 %	0.0007 %
过去六个月	0.8406%	0.0005%	0.6805%	0.0000%	0.1601 %	0.0005 %
过去一年	1.6645%	0.0004%	1.3500%	0.0000%	0.3145 %	0.0004 %
过去三年	5.4499%	0.0007%	4.0500%	0.0000%	1.3999 %	0.0007 %
过去五年	10.0570 %	0.0010%	6.7500%	0.0000%	3.3070 %	0.0010 %
自基金合同生效起 至今	35.0059 %	0.0028%	14.8684%	0.0000%	20.137 5%	0.0028 %

华宝添益 B

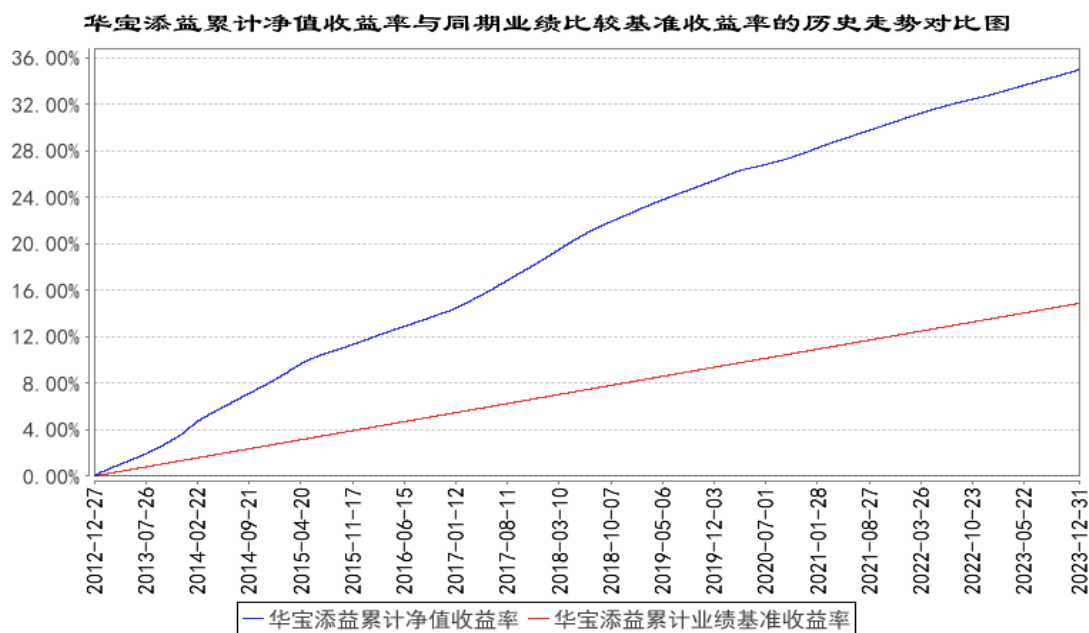
阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①－③	②－④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值收益 率①	收益率标 准差②	准收益率③	收益率标准 差④		
过去三个月	0.4988%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.1585%	0.0007%
过去六个月	0.9626%	0.0005%	0.6805%	0.0000%	0.2821%	0.0005%
过去一年	1.9088%	0.0004%	1.3500%	0.0000%	0.5588%	0.0004%
过去三年	6.2118%	0.0007%	4.0500%	0.0000%	2.1618%	0.0007%
过去五年	11.3853%	0.0010%	6.7500%	0.0000%	4.6353%	0.0010%
自基金合同生效起 至今	23.4306%	0.0021%	10.9923%	0.0000%	12.4383%	0.0021%

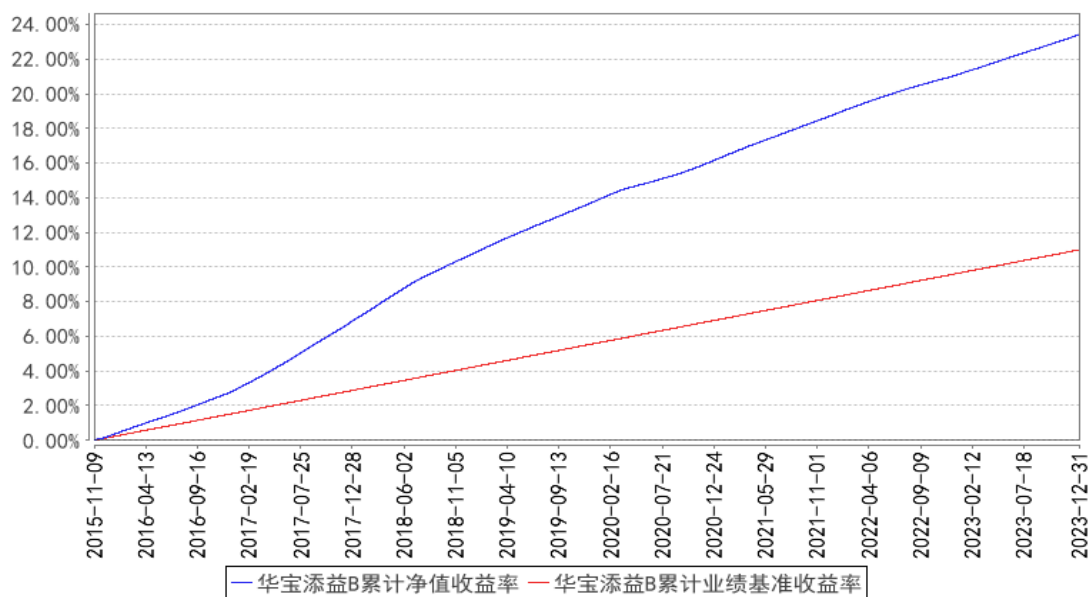
注：1、本基金业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）；

2、基金收益分配是按日结转份额。

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



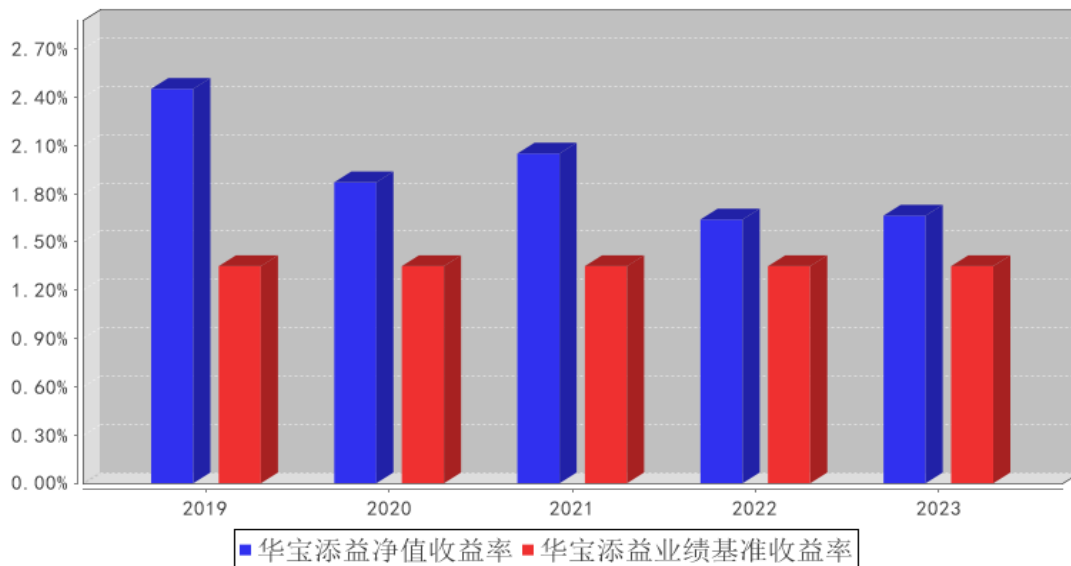
华宝添益B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

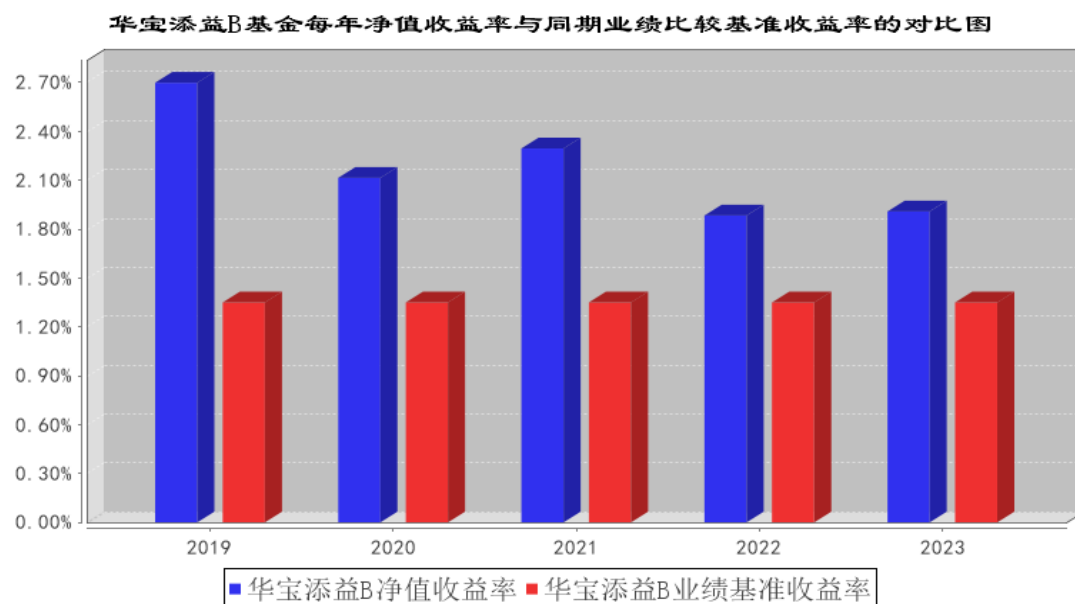


注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2013 年 06 月 27 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝添益基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图





3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

华宝添益

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2023 年	1,825,886,509.06	-	6,046,674.58	1,831,933,183.64	-
2022 年	2,470,830,497.45	-	3,684,713.84	2,474,515,211.29	-
2021 年	3,462,800,717.52	-	-792,894.04	3,462,007,823.48	-
合计	7,759,517,724.03	-	8,938,494.38	7,768,456,218.41	-

华宝添益 B

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2023 年	436,665,812.95	-	-535,023.18	436,130,789.77	-
2022 年	757,654,358.38	-	66,545.54	757,720,903.92	-
2021 年	848,450,006.23	-	-33,650.68	848,416,355.55	-
合计	2,042,770,177.56	-	-502,128.32	2,042,268,049.24	-

§ 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

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为人民币 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京、深圳等地设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理（香港）有限公司。

截至本报告期末（2023 年 12 月 31 日），本公司管理运作共计 138 只基金，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

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	本基金基金经理、固定收益投资总监、固定收益部总经理	2012-12-27	—	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、固定收益部总经理。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 月起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 月起任华宝浮动净值型发起式货币市场基金基金经理。
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。
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经理。
付婷	本基金基金经理助理	2023-12-06	-	8 年	硕士。曾在上海新世纪资信评估投资服务有限公司担任分析师。2016 年 1 月加入华宝基金管理有限公司，历任信用分析师、高级信用分析师、投资经理等职务。2023 年 12 月起任华宝现金宝货币市场基金、华宝现金添益交易型货币市场基金经理助理。2023 年 4 月起任华宝宝泓纯债债券型证券投资基金基金经理。
王慧	本基金基金经理助理	2023-12-06	-	20 年	硕士。曾在中国银行、南洋商业银行和苏州银行从事债券投资交易工作。2016 年 10 月加入华宝基金管理有限公司担任投资经理。2023 年 12 月起任华宝现金宝货币市场基金、华宝现金添益交易型货币市场基金经理助理。2018 年 8 月起任华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 3 月起任华宝宝裕纯债债券型证券投资基金基金经理，2019 年 4 月起任华宝宝盛纯债债券型证券投资基金基金经理，2019 年 10 月起任华宝宝润纯债债券型证券投资基金基金经理，2021 年 2 月起任华宝宝泓纯债债券型证券投资基金基金经理，2021 年 6 月起任华宝宝瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 11 月起任华宝宝隆债券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《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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面，公司使用统一的投资研究管理系统，并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时，该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5

日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 4 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

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

2023 年我国全年 GDP 约 126 万亿，按不变价同比增速 5.2%，分季度看，Q1 增长 4.5%，Q2 增长 6.3%，Q3 增长 4.9%，Q4 增长 5.2%。2023 年全国规模以上工业增加值比上年增长 4.6%，服务业增加值比上年增长 5.8%，工业生产动力偏弱，服务业低基数下保持较快增长。固定资产投资稳健增长，全年固定资产投资（不含农户）同比增长 3.0%。结构上，基建投资同比增长 8.24%；制造业投资同比 6.5%，汽车、食品、通用设备和有色金属为主要拉动项；地产投资同比为-9.6%，楼市销售偏弱。消费动能修复，2023 年社会消费品零售总额全年累计增速 7.2%。金融数据方面，2023 年全年社会融资规模增量累计为 35.59 万亿元，比上年多 3.41 万亿元。通胀方面，CPI 全年同比 0.2%，PPI 同比-3%。外贸方面，全年实现贸易差额 8232 亿美元，全年进口同比-5.5%，出口同比

-4.6%。2023 年末社会融资规模存量为 378.09 万亿元，同比增长 9.5%。政府信用对社融的支撑力度较大，居民中长期贷款需求仍然偏弱。12 月，M2 和 M1 同比增速分别为 9.7%和 1.3%。资金方面，2023 年 8 月之前整体宽松，8 月中下旬由于政府债开启发行使得资金面趋紧、债市持续调整。货币政策方面，23 年央行实施了两次降准和两次降息。全年呈现债强股弱的格局，债券收益率持续下行，收益率曲线呈现牛平。受城投化债等影响，信用中低等级表现强于高等级，信用利差显著压缩。

本基金在报告期内运行平稳，根据市场情况灵活调整组合久期和结构，在短端资产收益率上行阶段增加了同业存款、同业存单等资产的配置。本基金一如既往秉承谨慎、稳健的原则，在保持组合高流动性的同时严格控制风险，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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为 1.6645%，本报告期基金份额 B 类净值增长率为 1.9088%；同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

春节后市场资金面延续节前宽松，长端国债收益率创新低，10Y、30Y 国债收益率连续向下突破。后续两会在即，预计将释放一定的积极财政信号，政府债净供给可能加码。考虑到货币政策和财政政策的配合有所增强，有望缓释政府债发行对资金面和市场的冲击。展望后市，预计经济增长动能偏弱和债市资产荒的格局短期难改，在稳增长政策未有超预期变化和经济基本面未有明显变化的情境下，债市调整幅度预计有限，债券收益率或呈现低位震荡走势。本基金管理人将继续本着谨慎、稳健的原则，兼顾组合的安全性和流动性。结合对宏观经济、货币市场和基金负债端的变化分析，本基金将灵活调整组合久期和资产配置结构，积极为投资者获取稳健回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。并在具体工作中坚持

加强法规培训，努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据法律法规的变化、监管要求和业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）有重点地全面开展内部审计稽核工作。2023 年，合规审计部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计、依据各项监管规定对公司相关内部流程进行了评估、根据监管要求开展了涉及投研、运营、销售等方面的专项自查；并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

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账务处理；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。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 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 1,831,933,183.64 元,其中以红利再投资方式结转入实收基金 1,825,886,509.06 元,计入应付利润科目 6,046,674.58 元;本基金 B 类份额在本年度累计分配收益 436,130,789.77 元,其中以红利再投资方式结转入实收基金 436,665,812.95 元,计入应付利润科目-535,023.18 元。

4.9 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,本基金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。

报告期内,本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 23556 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华宝现金添益交易型货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了华宝现金添益交易型货币市场基金(以下简称“华

	宝添益基金”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了华宝添益基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华宝添益基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	华宝添益基金的基金管理人华宝基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华宝添益基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华宝添益基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督华宝添益基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉

	及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华宝添益基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华宝添益基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	叶尔甸	林佳璐
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2024 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	32,366,105,861.25	84,737,191,676.04
结算备付金		609,920,562.25	2,001,447,821.39
存出保证金		30,655.28	18,720.20
交易性金融资产	7.4.7.2	36,071,775,803.72	25,989,992,249.53
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		36,071,775,803.72	25,989,992,249.53
资产支持证券投资		—	—

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	28,749,474,465.29	22,695,763,986.82
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		10,296,786.49	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	107,451,691.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	1,155.73	1,155.73
资产总计		97,807,605,290.01	135,531,867,301.12
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,960,420,672.50	3,328,512,953.05
应付清算款		-	78,421,342.18
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		31,474,347.26	48,614,429.31
应付托管费		8,093,403.60	12,500,853.23
应付销售服务费		21,157,686.31	29,003,383.88
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,089,368.13	-
应付利润		18,050,949.93	12,539,298.53
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	1,094,504.14	979,485.11
负债合计		4,041,380,931.87	3,510,571,745.29
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	93,766,224,358.14	132,021,295,555.83
未分配利润	7.4.7.11	-	-
净资产合计		93,766,224,358.14	132,021,295,555.83
负债和净资产总计		97,807,605,290.01	135,531,867,301.12

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 93,766,224,358.14 份，其中华宝添益基金份额总额 92,218,719,351.77 份，基金份额净值 1.00 元；华宝添益 B 基金份额总额 1,547,505,006.37 份，基金份额净值 1.00 元。

7.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		3,255,235,634.81	4,636,378,713.44
1. 利息收入		2,150,146,895.05	3,853,597,566.76
其中：存款利息收入	7.4.7.12	1,392,417,344.83	2,875,975,371.52
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		757,729,550.22	977,622,195.24
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		1,105,088,739.76	782,780,970.28
其中：股票投资收益	7.4.7.13	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.14	1,105,088,739.76	782,780,970.28
资产支持证券投资 收益	7.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.16	-	-
衍生工具收益	7.4.7.17	-	-
股利收益	7.4.7.18	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.19	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.20	-	176.40
减：二、营业总支出		987,171,661.40	1,404,142,598.23
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	471,500,306.06	678,503,306.56
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	121,242,935.76	174,472,278.96
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	280,508,906.10	385,419,048.05
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		113,280,401.38	165,301,000.19
其中：卖出回购金融资产 支出		113,280,401.38	165,301,000.19
6. 信用减值损失	7.4.7.21	-	-

7. 税金及附加		239,260.59	14,581.45
8. 其他费用	7.4.7.22	399,851.51	432,383.02
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,268,063,973.41	3,232,236,115.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,268,063,973.41	3,232,236,115.21
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,268,063,973.41	3,232,236,115.21

7.3 净资产变动表

会计主体：华宝现金添益交易型货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	132,021,295,555.83	-	-	132,021,295,555.83
二、本期期初净资产	132,021,295,555.83	-	-	132,021,295,555.83
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-38,255,071,197.69	-	-	-38,255,071,197.69
(一)、综合收益总额	-	-	2,268,063,973.41	2,268,063,973.41
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-38,255,071,197.69	-	-	-38,255,071,197.69
其中：1. 基金申购款	310,879,775,456.03	-	-	310,879,775,456.03
2. 基金赎回款	-349,134,846,653.72	-	-	-349,134,846,653.72
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-2,268,063,973.41	-2,268,063,973.41

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产	93,766,224,358.14	-	-	93,766,224,358.14
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	157,602,597,765.70	-	-	157,602,597,765.70
二、本期期初净资产	157,602,597,765.70	-	-	157,602,597,765.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-25,581,302,209.87	-	-	-25,581,302,209.87
（一）、综合收益总额	-	-	3,232,236,115.21	3,232,236,115.21
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-25,581,302,209.87	-	-	-25,581,302,209.87
其中：1. 基金申购款	500,586,433,147.24	-	-	500,586,433,147.24
2. 基金赎回款	-526,167,735,357.11	-	-	-526,167,735,357.11
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-3,232,236,115.21	-3,232,236,115.21
四、本期期末净资产	132,021,295,555.83	-	-	132,021,295,555.83

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

向辉向辉张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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。为便于投资者理解,本财务报表中A类基金份额按份额净值1.00元折算后进行披露及汇总统计。

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,本基金主要投资于货币市场工具,包括现金,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)的非金融企业债务融资工具、债券、资产支持证券,经中国证监会、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)。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2024 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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 7.4.4 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的金融资产主要为债务工具,是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。

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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时，以公允价值计量。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率每日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征:(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利,这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产;这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位,并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量;(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别,即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具,且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权;(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别),所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征,并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同);(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外,该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征;(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额,应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具,是指根据合同约定,持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利,或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时,自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同:(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响);(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具,列报于净资产。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。买入的基金份额享有买入当日的分红权益，而卖出的基金不享有卖出当日的分红权益。

A 类基金份额收益分配方式为红利再投资，以每百份基金已实现收益为基准，每日计算当日收益并全部分配结转至投资人基金账户。投资人赎回 A 类基金份额时，其对应比例的累计收益将立即结清，以现金支付给投资人。投资人卖出部分 A 类基金份额时，不支付对应的收益；投资人全部卖出 A 类基金份额时，以现金方式支付全部累计收益。

B 类基金份额以每万份基金已实现收益为基准，每日计算当日收益并分配，每日分配所得收益参与下一日的收益分配，每月集中支付。每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资方式，投资人可通过赎回 B 类基金份额获得现金收益。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足

一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳

增值税。

对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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	1,504,424,755.68	1,210,712.58
等于：本金	1,502,857,375.80	1,207,493.36
加：应计利息	1,567,379.88	3,219.22
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	30,861,681,105.57	84,735,980,963.46
等于：本金	30,670,000,000.00	84,277,000,000.00
加：应计利息	191,681,105.57	458,980,963.46
减：坏账准备	-	-
合计	32,366,105,861.25	84,737,191,676.04

注：其他存款为有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
----	-------------------------

		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	1,009,592,126.24	1,009,797,928.75	205,802.51	0.0002
	银行间市场	35,062,183,677.48	35,081,717,202.20	19,533,524.72	0.0208
	合计	36,071,775,803.72	36,091,515,130.95	19,739,327.23	0.0211
资产支持证券		-	-	-	-
合计		36,071,775,803.72	36,091,515,130.95	19,739,327.23	0.0211
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	774,471,701.92	771,768,701.92	-2,703,000.00	-0.0020
	银行间市场	25,215,520,547.61	25,194,329,492.71	-21,191,054.90	-0.0161
	合计	25,989,992,249.53	25,966,098,194.63	-23,894,054.90	-0.0181
资产支持证券		-	-	-	-
合计		25,989,992,249.53	25,966,098,194.63	-23,894,054.90	-0.0181

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	9,801,083,544.31	-
银行间市场	18,948,390,920.98	-
合计	28,749,474,465.29	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,287,379,371.98	-
银行间市场	14,408,384,614.84	-
合计	22,695,763,986.82	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	1,155.73	1,155.73
待摊费用	-	-
合计	1,155.73	1,155.73

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	869,504.14	754,485.11
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	869,504.14	754,485.11
应付利息	-	-
预提费用	225,000.00	225,000.00
合计	1,094,504.14	979,485.11

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华宝添益

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	123,965,197,953.20	123,965,197,953.20
本期申购	89,396,689,509.06	89,396,689,509.06
本期赎回（以“-”号填列）	-121,143,168,110.49	-121,143,168,110.49
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	92,218,719,351.77	92,218,719,351.77

华宝添益 B

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,056,097,602.63	8,056,097,602.63
本期申购	221,483,085,946.97	221,483,085,946.97
本期赎回（以“-”号填列）	-227,991,678,543.23	-227,991,678,543.23
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,547,505,006.37	1,547,505,006.37

注：申购含红利再投以及转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.11 未分配利润

单位：人民币元

华宝添益

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,831,933,183.64	-	1,831,933,183.64
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	-1,831,933,183.64	-	-1,831,933,183.64
本期末	-	-	-

华宝添益 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	436,130,789.77	-	436,130,789.77
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	-436,130,789.77	-	-436,130,789.77
本期末	-	-	-

7.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	5,169,181.33	26,019.87
定期存款利息收入	-	-

其他存款利息收入	1,355,422,619.00	2,800,426,378.02
结算备付金利息收入	31,825,185.83	75,522,752.93
其他	358.67	220.70
合计	1,392,417,344.83	2,875,975,371.52

7.4.7.13 股票投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	1,103,781,711.38	784,136,428.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,307,028.38	-1,355,458.06
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	1,105,088,739.76	782,780,970.28

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	140,501,315,818.88	121,575,691,860.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	139,876,563,075.35	120,928,660,831.52
减：应计利息总额	623,445,715.15	648,386,487.25
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	1,307,028.38	-1,355,458.06

7.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.18 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.19 公允价值变动收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无公允价值变动收益。

7.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
其他	-	176.40
合计	-	176.40

7.4.7.21 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	96,000.00	96,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
回购交易手续费	1,000.00	-
银行费用	145,651.51	179,183.02
账户维护费	36,000.00	36,000.00
上清所 CFCA 证书服务 费	1,200.00	1,200.00
合计	399,851.51	432,383.02

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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 类基金份额注册登记机构, 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, 基金销售机构
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
江苏省铁路集团有限公司(“江苏铁集”)	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
华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司, 基金销售机构
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司
华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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 (%)
华宝证券	52,536,025.64	3.94	—	—

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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 (%)
华宝证券	139,985,350,000.00	9.58	—	—

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	471,500,306.06	678,503,306.56
其中：应支付销售机构的客户维护费	60,605,406.53	86,928,338.73
应支付基金管理人的净管理费	410,894,899.53	591,574,967.83

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	121,242,935.76	174,472,278.96

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司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。

7.4.10.2.3 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	73,888,193.18	2,344,876.15	76,233,069.33
华宝证券	667,509.05	-	667,509.05
合计	74,555,702.23	2,344,876.15	76,900,578.38
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	93,589,450.62	4,134,423.75	97,723,874.37

华宝证券	422,110.61	-	422,110.61
合计	94,011,561.23	4,134,423.75	98,145,984.98

注：销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额的销售服务费按前一日 A 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。B 类基金份额的销售服务费按前一日 B 类基金份额的基金资产净值的 0.01% 年费率计提。本基金各类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

A 类基金份额： $H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

B 类基金份额： $H=E \times 0.01\% \div \text{当年天数}$

H 为各类基金份额每日应计提的基金销售服务费；E 为各类基金份额前一日基金资产净值。

7.4.10.3 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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
建设银行	-	-	-	-	295,718,088,000.00	25,967,819.98
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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
建设银行	-	149,962,338.46	-	-	692,709,870,000.00	37,540,199.14

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	-	-
报告期初持有的基金份额	307,645,300.00	212,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	13,999,688,200.00	220,579,924.12
报告期间因拆分变动份额	-	0.00

减：报告期间赎回/卖出总份额	13,843,571,700.00	432,579,924.12
报告期末持有的基金份额	463,761,800.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.50%	0.00%
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	—	—
报告期初持有的基金份额	402,392,100.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	9,156,439,100.00	212,000,000.00
报告期间因拆分变动份额	—	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	9,251,185,900.00	0.00
报告期末持有的基金份额	307,645,300.00	212,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.25%	2.63%

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。

3. 为便于投资者理解，基金管理人运用固有资金投资 A 类基金份额按份额净值 1.00 元折算后进行披露及汇总统计。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

华宝添益 B

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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（%）
宝武集团财务有限责任公司	—	—	170,000,000.00	2.11

注：为便于投资者理解，A 类基金份额按份额净值 1.00 元折算后进行披露及汇总统计。

7.4.10.5 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	1,504,424,755.68	11,548,070.22	1,210,712.58	26,019.87

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率或协议利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有 9,100,000.00 张建设银行同业存单，成本总额为人民币 897,571,168.29 元，占基金资产净值的比例为 0.96%。本报告期间因投资托管人建设银行的同业存单而取得的利息收入为人民币 5,708,018.25 元（上年度可比期间：本基金因投资托管人建设银行的同业存单而取得的利息收入为人民币 3,578,729.96 元）。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

华宝添益				
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
1,825,886,509.06	-	6,046,674.58	1,831,933,183.64	-
华宝添益 B				
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
436,665,812.95	-	-535,023.18	436,130,789.77	-

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

至本报告期末 2023 年 12 月 31 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 3,960,420,672.50 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	数量（张）	期末估值总额
------	------	-------	-------	-------	--------

			价		
220302	22 进出 02	2024 年 1 月 2 日	102.07	700,000	71,446,586.44
230301	23 进出 01	2024 年 1 月 2 日	101.93	4,622,000	471,110,918.44
230401	23 农发 01	2024 年 1 月 2 日	102.04	5,900,000	602,046,528.71
239941	23 贴现国 债 41	2024 年 1 月 2 日	99.93	3,800,000	379,741,078.80
239945	23 贴现国 债 45	2024 年 1 月 2 日	99.83	10,101,000	1,008,358,597.98
239963	23 贴现国 债 63	2024 年 1 月 2 日	99.92	8,367,000	836,005,272.31
239965	23 贴现国 债 65	2024 年 1 月 2 日	99.87	7,200,000	719,042,659.29
合计				40,690,000	4,087,751,641.97

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险稳定收益品种。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险和高流动性”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监

督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是结合定性分析和定量分析方法，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的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，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。

7.4.13.2 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。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，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并对证券交割方式进行限制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。本基金投资于单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的 10%。

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。

7.4.13.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	502,523,357.87	653,704,438.36
A-1 以下	—	—
未评级	6,717,944,422.52	8,486,167,776.10
合计	7,220,467,780.39	9,139,872,214.46

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	27,985,522,437.24	14,401,378,093.32
合计	27,985,522,437.24	14,401,378,093.32

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.4 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	794,338,999.65	-
AAA 以下	-	-
未评级	71,446,586.44	2,448,741,941.75
合计	865,785,586.09	2,448,741,941.75

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 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。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%。

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款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。可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，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；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，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 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易

的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
货币资金	29,260,619,694.61	3,105,486,166.64	-	-	32,366,105,861.25
结算备付金	609,920,562.25	-	-	-	609,920,562.25
存出保证金	30,655.28	-	-	-	30,655.28
交易性金融资产	28,929,839,812.76	7,141,935,990.96	-	-	36,071,775,803.72
买入返售金融资产	28,749,474,465.29	-	-	-	28,749,474,465.29
应收清算款	-	-	-	10,296,786.49	10,296,786.49
其他资产	-	-	-	1,155.73	1,155.73
资产总计	87,549,885,190.19	10,247,422,157.60	-	10,297,942.22	97,807,605,290.01
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	31,474,347.26	31,474,347.26
应付托管费	-	-	-	8,093,403.60	8,093,403.60
卖出回购金融资产款	3,960,420,672.50	-	-	-	3,960,420,672.50
应付销售服务费	-	-	-	21,157,686.31	21,157,686.31

应付利润	-	-	-	18,050,949.93	18,050,949.93
应交税费	-	-	-	1,089,368.13	1,089,368.13
其他负债	-	-	-	1,094,504.14	1,094,504.14
负债总计	3,960,420,672.50	-	-	80,960,259.37	4,041,380,931.87
利率敏感度缺口	83,589,464,517.69	10,247,422,157.60	-	-70,662,317.15	93,766,224,358.14
上年度末 2022 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月 -1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
货币资金	69,562,169,850.39	15,175,021,825.65	-	-	84,737,191,676.04
结算备付金	2,001,447,821.39	-	-	-	2,001,447,821.39
存出保证金	18,720.20	-	-	-	18,720.20
交易性金融资产	18,311,725,867.16	7,678,266,382.37	-	-	25,989,992,249.53
买入返售金融资产	22,695,763,986.82	-	-	-	22,695,763,986.82
应收申购款	-	-	-	107,451,691.41	107,451,691.41
其他资产	-	-	-	1,155.73	1,155.73
资产总计	112,571,126,245.96	22,853,288,208.02	-	-107,452,847.14	135,531,867,301.12
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	48,614,429.31	48,614,429.31
应付托管费	-	-	-	12,500,853.23	12,500,853.23
应付清算款	-	-	-	78,421,342.18	78,421,342.18
卖出回购金融资产款	3,328,512,953.05	-	-	-	3,328,512,953.05
应付销售服务费	-	-	-	29,003,383.88	29,003,383.88
应付利润	-	-	-	12,539,298.53	12,539,298.53
其他负债	-	-	-	979,485.11	979,485.11
负债总计	3,328,512,953.05	-	-	-182,058,792.24	3,510,571,745.29
利率敏感度缺口	109,242,613,292.91	22,853,288,208.02	-	-74,605,945.10	132,021,295,555.83

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	25,900,890.91	21,332,737.58
	2. 市场利率上升 25 个基点	-25,843,802.26	-21,292,836.24

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有交易性权益类投资(上年度末：同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	—	—
第二层次	36,071,775,803.72	25,989,992,249.53

第三层次	—	—
合计	36,071,775,803.72	25,989,992,249.53

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。（上年度末：同）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	36,071,775,803.72	36.88
	其中：债券	36,071,775,803.72	36.88
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	28,749,474,465.29	29.39
	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	32,976,026,423.50	33.72
4	其他各项资产	10,328,597.50	0.01
5	合计	97,807,605,290.01	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），“其他各项资产”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）。

8.2 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	4.83	
	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	3,960,420,672.50	4.22
	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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	95
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

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。

8.3.2 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	36.63	4.22
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天（含）—60 天	13.14	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
3	60 天（含）—90 天	25.98	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
4	90 天（含）—120 天	9.42	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—

5	120 天（含）—397 天（含）	18.85	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	—	—
合计		104.02	4.22

8.4 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。

8.5 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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,515,585,784.33	3.75
2	央行票据	—	—
3	金融债券	2,713,293,008.15	2.89
	其中：政策性 金融债	1,336,024,696.68	1.42
4	企业债券	—	—
5	企业短期融 资券	1,847,230,001.60	1.97
6	中期票据	10,144,572.40	0.01
7	同业存单	27,985,522,437.24	29.85
8	其他	—	—
9	合计	36,071,775,803.72	38.47
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	—	—

8.6 期末按实际利率计算账面价值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）	按实际利率计算的 账面价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112387541	23 重庆农村 商行 CD129	14,000,000	1,392,228,751.96	1.48
2	239945	23 贴现国债 45	13,300,000	1,327,707,093.67	1.42
3	239963	23 贴现国债 63	10,900,000	1,089,094,952.57	1.16
4	112316123	23 上海银行 CD123	10,000,000	998,341,149.00	1.06
5	112385279	23 深圳农商 银行 CD092	10,000,000	997,228,082.38	1.06
6	112385365	23 深圳农商	10,000,000	997,052,028.60	1.06

		银行 CD094			
7	112303205	23 农业银行 CD205	9,000,000	884,716,457.54	0.94
8	112316160	23 上海银行 CD160	8,500,000	845,364,983.34	0.90
9	112315434	23 民生银行 CD434	7,500,000	748,515,110.45	0.80
10	239965	23 贴现国债 65	7,200,000	719,042,659.29	0.77

8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0327%
报告期内偏离度的最低值	-0.0310%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0159%

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。

8.8 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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 2023 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的中国民生银行股份有限公司因信贷业务违规, 票据业务违规, 存款业务违规, 违规销售或推介, 违规授信, 贷后资金流向、用途及项目进度等管理、监督、执行不到位, 违规收费, 内部管理与控制制度不健全或执行监督不力, 未经任职资格审查或核准任命董事、高级管理人员、首席代表, 编制或者提供虚假资料; 于 2023 年 02 月 16 日收到银保监会罚款, 没收违法所得的处罚措施。

华宝添益截止 2023 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的重庆农村商业银行股份有限公司因违规经营；于 2023 年 03 月 10 日收到重庆证监局警示的处罚措施。

华宝添益截止 2023 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的上海银行股份有限公司因违规经营,涉嫌违反法律法规,未依法履行职责,违反结汇、售汇及付汇管理规定;于 2023 年 04 月 21 日收到国家外汇管理局上海市分局警告、罚款、没收违法所得;给予警告,处罚款 9834.5 万元人民币,没收违法所得 19.9 万元人民币,罚没款合计 9854.4 万元人民币的处罚措施。

华宝添益截止 2023 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的中国民生银行股份有限公司因承销业务涉嫌违规;于 2023 年 05 月 09 日收到中国银行间市场交易商协会立案调查的处罚措施。

华宝添益截止 2023 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的中国民生银行股份有限公司因信贷业务违规,存款业务违规,违规销售或推介,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,提供服务质价不符;于 2023 年 08 月 02 日收到国家金融监督管理总局罚款的处罚措施。

华宝添益截止 2023 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的中国农业银行股份有限公司因信贷业务违规,票据业务违规,存款业务违规,违反审慎经营规则,违规授信,贷后资金流向、用途及项目进度等管理、监督、执行不到位,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 08 月 15 日收到国家金融监督管理总局罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝添益截止 2023 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的中国民生银行股份有限公司因:“一是推荐撮合资产管理计划投资业务,客观上协助了相关企业债券的非市场化发行和规避交易监管。二是个别债项按照发行人预期或要求的利率执行包销,发行定价市场化程度不足。三是部分债项发行工作程序执行不规范。四是作为相关债项发行文件约定的持有人会议召集人,未及时召集持有人会议。”;于 2023 年 08 月 16 日收到中国银行间市场交易商协会警告,责令改正的处罚措施。

华宝添益截止 2023 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的上海银行股份有限公司因信贷业务违规,违规销售或推介,违规授信,内部管理与控制制度不健全或执行监督不力,未按规定报送有关报告、报表、文件和资料,内控管理未形成有效风险控制;于 2023 年 11 月 17 日收到国家金融监督管理

总局上海监管局罚款, 责令改正的处罚措施。

华宝添益截止 2023 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的中国农业银行股份有限公司因违规经营, 涉嫌违反法律法规, 未依法履行职责, 违反结汇、售汇及付汇管理规定; 于 2023 年 11 月 17 日收到国家外汇管理局北京市分局警告, 罚款, 没收违法所得的处罚措施。

华宝添益截止 2023 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的上海银行股份有限公司因违规经营, 未依法履行职责, 违反结汇、售汇及付汇管理规定; 于 2023 年 11 月 27 日收到国家外汇管理局上海市分局罚款, 没收违法所得的处罚措施。

华宝添益截止 2023 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的中国农业银行股份有限公司因信贷业务违规, 票据业务违规, 存款业务违规, 内部管理与控制制度不健全或执行监督不力, 未按规定报送有关报告、报表、文件和资料, 内控管理未形成有效风险控制, 提供服务质价不符; 于 2023 年 12 月 01 日收到国家金融监督管理总局罚款, 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他分析, 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。

8.9.3 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	30,655.28
2	应收清算款	10,296,786.49
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	1,155.73
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	10,328,597.50

8.9.4 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	36,502	2,526,401.82	78,442,613,043.41	85.06	13,776,106,308.36	14.94
华宝添益B	32	48,359,531.45	1,547,484,904.02	100.00	20,102.35	0.00
合计	36,534	2,566,546.90	79,990,097,947.43	85.31	13,776,126,410.71	14.69

9.2 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	BARCLAYS BANK PLC	21,771,598.00	2.36
2	中信里昂资产管理有限公司—客户资金	17,553,288.00	1.90
3	中信里昂资产管理有限公司—客户资金—人民币资金汇入	12,088,865.00	1.31
4	大家人寿保险股份有限公司—万能产品	11,718,076.00	1.27
5	华融国际信托有限责任公司—华融·豪山一期可交换债投资集合资金信托计划	6,082,076.00	0.66
6	MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC.	5,845,197.00	0.63
7	华宝基金管理有限公司	4,637,618.00	0.50
8	国开证券股份有限公司	4,379,010.00	0.47
9	上海金锝私募基金管理有限公司—金锝尧典5号证券投资私募基金	4,293,272.00	0.47
10	高盛公司有限责任公司	4,231,088.00	0.46

注：1、华宝添益 B 类基金份额不上市交易。2、此表中的基金份额数量按份额净值为 100.00 元进行披露。

9.3 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	2,177,159,800.00	2.32
2	其他机构	1,755,328,800.00	1.87
3	其他机构	1,208,886,500.00	1.29
4	保险类机构	1,171,807,600.00	1.25
5	银行类机构	720,938,454.12	1.21
6	信托类机构	608,207,600.00	0.77
7	其他机构	584,519,700.00	0.65
8	基金类机构	463,761,800.00	0.55
9	券商类机构	437,901,000.00	0.49
10	其他机构	429,327,200.00	0.47

注：1、持有份额由 1~10 依次按照市值由大到小排列；2、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）。

9.4 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	31,862.75	0.0000
	华宝添益 B	20,102.35	0.0013
	合计	51,965.10	0.0001

9.5 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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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	—
本报告期期初基金份额总额	123,965,197,953.20	8,056,097,602.63
本报告期基金总申购份额	89,396,681,709.06	221,483,085,946.97
减: 本报告期基金总赎回份额	121,143,168,110.49	227,991,678,543.23
本报告期基金拆分变动份额	7,800.00	—
本报告期期末基金份额总额	92,218,719,351.77	1,547,505,006.37

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

无。

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根据工作需要,任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

11.3 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管理业务、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 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在本报告期的审计报酬为 96,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为:自本基金合同生效之日起至本报告期末。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

根据我行审计报告，本行不存在涉嫌犯罪被依法立案调查的情况，本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施、涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情况；本行或者本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有权机关重大行政处罚，或者被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况；本行董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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(%)	
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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，能为本基金提供全面的信息服；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、本报告期租用的证券公司交易单元退租的有：东方证券。

11.7.2 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(%)
长江证券	386,968,859.13	29.02	616,398,163,000.00	42.18	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	5,964,610,000.00	0.41	-	-
东方证券	-	-	6,500,000,000.00	0.44	-	-
光大证券	-	-	100,120,000.00	0.01	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	171,234,063,000.00	11.72	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	160,660,491.23	12.05	-	-	-	-
国投证券	-	-	12,375,238,000.00	0.85	-	-
国信证	-	-	39,021,411,0	2.67	-	-

券			00.00			
华宝证 券	52,536,025. 64	3.94	139,985,350, 000.00	9.58	-	-
华创证 券	-	-	3,400,700,00 0.00	0.23	-	-
华泰证 券	114,738,987 .58	8.60	447,134,972, 000.00	30.60	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	618,613,334 .24	46.39	6,483,254,00 0.00	0.44	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	12,747,579,0 00.00	0.87	-	-

11.8 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。

11.9 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	华宝现金添益交易型货币市场基金暂停及恢复申购（含转换转入）业务的公告	基金管理人网站, 证券时报	2023-01-16
2	华宝现金添益交易型货币市场基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2023-01-19
3	华宝现金添益交易型货币市场基金 2022 年年度报告	基金管理人网站	2023-03-31
4	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-22
5	华宝现金添益交易型货币市场基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2023-04-23
6	华宝现金添益交易型货币市场基金暂停及恢复申购（含转换转入）业务的公告	基金管理人网站, 证券时报	2023-04-25
7	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-07-21
8	华宝现金添益交易型货币市场基金 2023 年第 2 季度报告	基金管理人网站	2023-07-21
9	华宝基金管理有限公司旗下部分基金	上海证券报, 证券日报,	2023-08-31

	中期报告提示性公告	证券时报，中国证券报	
10	华宝现金添益交易型货币市场基金 2023 年中期报告	基金管理人网站	2023-08-31
11	华宝现金添益交易型货币市场基金暂停及恢复申购（含转换转入）业务的公告	基金管理人网站, 证券时报	2023-09-23
12	华宝现金添益交易型货币市场基金基金经理变更公告	基金管理人网站, 证券时报	2023-10-21
13	华宝现金添益交易型货币市场基金 2023 年第 3 季度报告	基金管理人网站	2023-10-25
14	华宝现金添益交易型货币市场基金（A 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2023-10-25
15	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报，证券日报，证券时报，中国证券报	2023-10-25
16	华宝现金添益交易型货币市场基金（B 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2023-10-25
17	华宝现金添益交易型货币市场基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2023-10-25
18	华宝现金添益交易型货币市场基金（A 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2023-11-29
19	华宝现金添益交易型货币市场基金（B 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2023-11-29
20	华宝现金添益交易型货币市场基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2023-11-29
21	关于华宝现金添益交易型货币市场基金 B 类基金份额调整最低申购金额、最低赎回份额、最低持有份额、最低转换份额并在网上直销平台开通申购、赎回及转换和定投业务的公告	基金管理人网站, 证券时报	2023-12-20

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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 3 月 29 日