

# 汇添富和聚宝货币市场基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 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         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10        |
| 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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 16        |
| 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.....       | 16        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>17</b> |
| 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....      | 17        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>18</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 18        |
| 6.2 利润表.....                                 | 19        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                    | 20        |
| 6.4 报表附注.....                              | 21        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 40        |
| 7.2 债券回购融资情况.....                          | 40        |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限.....                      | 40        |
| 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.....       | 41        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 41        |
| 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....    | 42        |
| 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....        | 42        |
| 7.8 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..... | 43        |
| 7.9 投资组合报告附注.....                          | 43        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>44</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 44        |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....                | 44        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 44        |
| 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的情况.....     | 44        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>46</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>47</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 47        |
| 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.....      | 47        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 48        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 48        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 48        |
| 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.....                           | 50        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>51</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.....   | 51        |

|                          |           |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 51        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>   | <b>52</b> |
| 12.1 备查文件目录.....         | 52        |
| 12.2 存放地点.....           | 52        |
| 12.3 查阅方式.....           | 52        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 汇添富和聚宝货币市场基金        |
| 基金简称       | 汇添富和聚宝货币            |
| 基金主代码      | 000600              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2014 年 5 月 28 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 | 11,332,775,543.91 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。                         |
| 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 | 活期存款利率(税后)  |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场证券投资基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期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      |      | 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     |
| 注册地址    |      | 上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区(东座)6 楼 H686 室 | 上海市中山东一路 12 号    |
| 办公地址    |      | 上海市富城路 99 号震旦国                     | 上海市北京东路 689 号    |

|       |             |        |
|-------|-------------|--------|
|       | 际大楼 19-22 层 |        |
| 邮政编码  | 200120      | 200001 |
| 法定代表人 | 李文          | 高国富    |

## 2.4 信息披露方式

|                      |  |
|----------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《中国证券报》、《上海证券报》<br>和《证券时报》                     |
| 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<br>19-22 层 汇添富基金管理股份有<br>限公司 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称            | 办公地址                         |
|--------|---------------|------------------------------|
| 注册登记机构 | 汇添富基金管理股份有限公司 | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼<br>19-22 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

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 175,448,285.69              |
| 本期利润          | 175,448,285.69              |
| 本期净值收益率       | 2.1532%                     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日)            |
| 期末基金资产净值      | 11,332,775,543.91           |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                      |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2018年6月30日)            |
| 累计净值收益率       | 17.4993%                    |

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。

2、上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、本基金收益分配为按日结转份额。

#### 3.2 基金净值表现

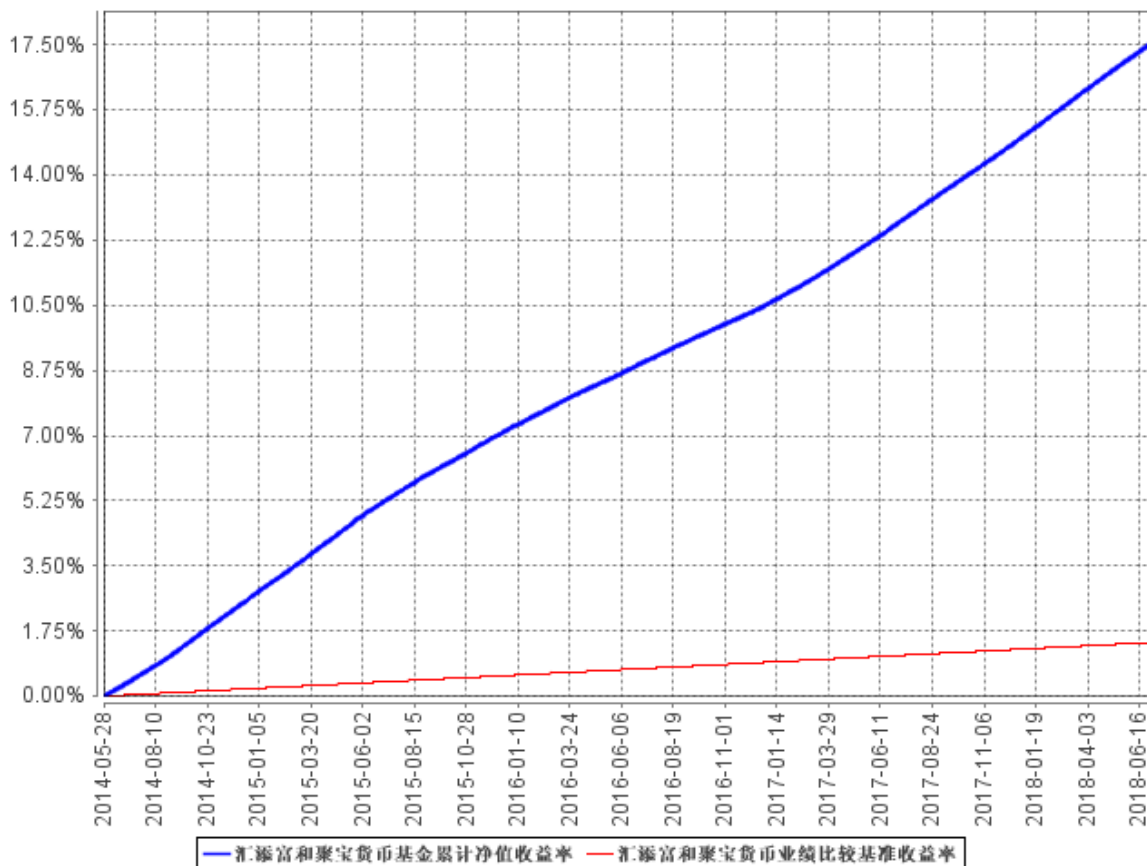
##### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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       | 0.3418%  | 0.0003%     | 0.0288%    | 0.0000%       | 0.3130%  | 0.0003% |
| 过去三个月       | 1.0553%  | 0.0005%     | 0.0873%    | 0.0000%       | 0.9680%  | 0.0005% |
| 过去六个月       | 2.1532%  | 0.0007%     | 0.1736%    | 0.0000%       | 1.9796%  | 0.0007% |
| 过去一年        | 4.3281%  | 0.0007%     | 0.3503%    | 0.0000%       | 3.9778%  | 0.0007% |
| 过去三年        | 11.6992% | 0.0021%     | 1.0540%    | 0.0000%       | 10.6452% | 0.0021% |
| 自基金合同生效日起至今 | 17.4993% | 0.0024%     | 1.4407%    | 0.0000%       | 16.0586% | 0.0024% |



### 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

汇添富和聚宝货币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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2014年5月28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。

## § 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由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，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，注册资本金为 132,724,224 元人民币。截止到 2018 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 4213.15 亿元，有效客户数约 1988 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 110 只开放式证券投资基金，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，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长混合型证券投资基金、汇添富成长焦点混合型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报混合型证券投资基金、汇添富民营活力混合型证券投资基金、汇添富香港优势混合型证券投资基金、汇添富医疗保健混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任混合型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富优选回报混合型证券投资基金、汇添富消费行业混合型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽 30 混合型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富添富通货币市场基金、汇添富全额宝货币市场基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇

添富和聚宝货币市场基金、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富成长多因子量化策略股票基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富医疗服务混合型证券投资基金、汇添富国企创新增长股票型证券投资基金、汇添富民营新动力股票型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富新兴消费股票型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金、汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富盈安保本混合型证券投资基金、汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金、汇添富盈稳保本混合型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫保本混合型证券投资基金、汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金、汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）、汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金、汇添富鑫利债券型证券投资基金、汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、汇添富中国高端制造股票型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富精选美元债债券型证券投资基金、汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金、汇添富添福吉祥混合型证券投资基金、汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金、汇添富盈润混合型证券投资基金、汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富民丰回报混合型证券投资基金、汇添富睿丰混合型证券投资基金、汇添富弘安混合型证券投资基金、汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金、汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）、上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金、汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金、汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金、汇添富行业整合主题混合型证券投资基金、汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金、汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富智能制造股票型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发

起式证券投资基金、汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金。

#### 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 天债券基金的基金经理。 | 2014 年 11 月 26 日 | -    | 10 年   | 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 日任汇添富收益快线货币基金基金经理，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 天债券基金的基金经理。 |
| 陶然  | 汇添富现金宝货币、汇添富添富通货币、汇添富全额宝货币、   | 2016 年 9 月 9 日   | -    | 8 年    | 国籍：中国，学历：法国图卢兹国立综合理工学院信息系统与软件开发硕士、法国图卢兹第一大学金融工程硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格、CFA。从业经历：曾任海富通基金、华安基金债券交易员，2016 年 9 月加入汇添富基金管理股份有限公司，2016 年 9 月 9 日  |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  | 汇添富收益快线货币、汇添富收益快钱货币基金的基金经理，汇添富和聚宝货币基金、汇添富理财 7 天债券基金的基金经理助理 |  |  | 至今任汇添富和聚宝货币基金、汇添富理财 7 天债券基金的基金经理助理，2016 年 9 月 9 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富收益快线货币基金、汇添富全额宝货币基金的基金经理助理，2016 年 9 月 13 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富收益快钱货币基金的基金经理助理，2017 年 9 月 7 日至今任汇添富现金宝货币、汇添富添富通货币基金的基金经理，2018 年 5 月 4 日至今任汇添富全额宝货币基金、汇添富收益快线货币基金、汇添富收益快钱货币基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|

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 4 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

上半年美联储主席完成换届，鲍威尔接替耶伦成为新一届美联储主席，美联储如市场所预期地在 3 月和 6 月执行两次加息操作，并继续发表鹰派加息计划，显示其对未来经济稳定增长的信心。欧洲经济复苏延续，但进度略低于预期，伴随来自意大利、西班牙等国的政治不确定性使得欧洲央行的货币政策继续维持鸽派。日本央行则认为当前仍未到需要重新考虑货币政策的时点，继续实施宽松的货币政策有助于维持通胀动能。

我国经济上半年基本面良好，宏观数据显示经济增长保持韧性，供需总体平衡，CPI 表现温和，PPI 趋于回落。但也需要观察到全球经济复苏态势持续分化、中美贸易争端升级、结构性去杠杆、防范化解金融风险、房地产市场发展、投资增速下滑过快等宏观经济领域面临的突出问题对稳增长形成较大幅度的扰动，也使得市场对经济运行情况的判断和预期的分歧加大。

今年 3 月份全国两会期间，易纲接替任职长达 16 年之久的周小川出任央行行长，郭树清任职新合并成立的中国银行保险监督管理委员会的首任主席。随着人事布局的尘埃落定，金融体系的重大改革措施也继续向纵深推进。在央行公开市场操作、春节临时准备金动用、MLF、多次定向降

准等一系列货币市场政策工具的实施下，上半年流动性虽在个别时点存在一定的扰动，但总体保持合理充裕状态，资金供需平衡。3M Shibor 利率震荡下行，带动短端利率中枢有所下行。

操作上，本基金采取相对灵活的投资策略，适时拉长组合剩余期限并提高组合现券持仓占比，根据资金面变化情况配置足额到期资产应对关键时点的流动性需求。同时，通过适度的杠杆操作提升组合收益，主动把握短期利率高位震荡的机会，在控制组合风险的前提下为持有人获取稳定回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 2.1532%，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

今年上半年国内的政策组合主要为“紧信用+宽货币”，紧信用体现在影子银行规模的明显收缩，而宽货币则体现在货币市场流动性的大幅改善。从政策的实际效果来看，宽货币向宽信贷的传导并不顺畅，使得银行表内扩张不足以对表外的信用收缩形成对冲，从而导致实体融资难成为普遍现象。未来在经济下行压力加大的情况下，为了扩大内需以对冲外部风险，政府有望通过宽财政的方式来解决有效融资需求不足的问题，使得货币宽松能够带动银行表内信贷实现真正扩张。政策组合上，此前“宽货币+紧信用+紧财政”的模式有望转向“宽货币+稳信用+宽财政”的组合。

从流动性管理角度分析，预计央行下半年仍将延续货币政策稳健中性基调不变，灵活运用多种货币政策工具组合，维持流动性合理充裕。但是需要关注到，货币政策的边际宽松不代表政策的根本转向，也并不意味着全面宽松，而是在防风险和稳杠杆大方向不变的情况下适度宽松。在货币政策和宏观审慎政策双支柱调控框架下，仍应警惕关键时点流动性边际收紧的风险。

我们将在密切跟踪基本面、政策面和资金面的前提下，做好同业存单、定期存款、债券、回购和资产支持证券之间的大类资产配置以及比例的动态调整。同时，严防信用风险，规避高风险个券。组合将延续积极的投资策略，保持投资收益吸引力，为持有人在管理好流动性的前提下获取持续稳定的投资回报。

#### 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《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《关于证

券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止)等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金经理人同本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金经理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金经理人对外公布。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。

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。

#### 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:本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并全部分配,当日所得收益结转为基金份额参与下一日收益分配。

2018年1月1日至2018年6月30日期间累计分配收益175,448,285.69元,均以红利再投资方式结转入实收基金。

#### 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”）在对汇添富和聚宝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，对汇添富和聚宝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：汇添富和聚宝货币市场基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 7,019,534,068.98               | 3,887,905,793.47                 |
| 结算备付金           |            | -                              | -                                |
| 存出保证金           |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 5,247,868,123.81               | 2,030,041,279.60                 |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 5,247,868,123.81               | 2,030,041,279.60                 |
| 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    | 390,001,460.00                 | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 81,295,872.00                  | 38,546,759.29                    |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 75,014,852.36                  | 271,508,627.76                   |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 12,813,714,377.15              | 6,228,002,460.12                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 1,474,947,162.57               | 604,963,972.54                   |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 2,475,650.62                   | 1,239,529.90                     |
| 应付托管费           |            | 366,763.07                     | 183,634.04                       |
| 应付销售服务费         |            | 2,292,269.11                   | 1,147,712.90                     |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 112,417.59                     | 72,053.17                        |

|               |          |                   |                  |
|---------------|----------|-------------------|------------------|
| 应交税费          |          | 42,506.72         | -                |
| 应付利息          |          | 478,953.63        | 365,426.06       |
| 应付利润          |          | -                 | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                 | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 223,109.93        | 269,300.00       |
| 负债合计          |          | 1,480,938,833.24  | 608,241,628.61   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                   |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 11,332,775,543.91 | 5,619,760,831.51 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | -                 | -                |
| 所有者权益合计       |          | 11,332,775,543.91 | 5,619,760,831.51 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 12,813,714,377.15 | 6,228,002,460.12 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 11,332,775,543.91 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富和聚宝货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号        | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |            | 210,050,117.37                           | 58,389,099.32                                 |
| 1.利息收入                |            | 209,190,147.24                           | 59,155,462.51                                 |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 132,182,799.76                           | 41,184,459.04                                 |
| 债券利息收入                |            | 75,523,299.13                            | 14,570,615.74                                 |
| 资产支持证券利息收入            |            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            |            | 1,484,048.35                             | 3,400,387.73                                  |
| 其他利息收入                |            | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 859,970.13                               | -766,363.19                                   |
| 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   | 859,970.13                               | -766,363.19                                   |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.3 | -  | -   |
| 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>         |            | 34,601,831.68                            | 9,879,605.14                                  |

|                            |            |                |               |
|----------------------------|------------|----------------|---------------|
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 11,045,725.01  | 3,404,028.19  |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 1,636,403.78   | 504,300.47    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 10,227,523.13  | 3,151,877.97  |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | -              | -             |
| 5. 利息支出                    |            | 11,451,030.88  | 2,593,532.33  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 11,451,030.88  | 2,593,532.33  |
| 6. 税金及附加                   |            | 15,512.12      | -             |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 225,636.76     | 225,866.18    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 175,448,285.69 | 48,509,494.18 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富和聚宝货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>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）                        | 5,619,760,831.51                           | -               | 5,619,760,831.51   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 175,448,285.69  | 175,448,285.69     |
| 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）      | 5,713,014,712.40                           | -               | 5,713,014,712.40   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 23,389,497,937.06                          | -               | 23,389,497,937.06  |
| 2. 基金赎回款                               | -17,676,483,224.66                         | -               | -17,676,483,224.66 |
| 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） | -  | -175,448,285.69 | -175,448,285.69    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 11,332,775,543.91                          | -               | 11,332,775,543.91  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 2,266,152,958.28   | -              | 2,266,152,958.28   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                  | 48,509,494.18  | 48,509,494.18      |
| 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）      | 2,188,862,482.17   | -              | 2,188,862,482.17   |
| 其中：1.基金申购款                             | 16,189,035,505.79  | -              | 16,189,035,505.79  |
| 2.基金赎回款                                | -14,000,173,023.62 | -              | -14,000,173,023.62 |
| 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） | -                  | -48,509,494.18 | -48,509,494.18     |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 4,455,015,440.45   | -              | 4,455,015,440.45   |

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：

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

汇添富和聚宝货币市场基金(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[2014]293号文《关于核准汇添富和聚宝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股份有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2014年05月28日正式生效，首次设立募集规模为510,539,019.63基金份额。本基金为契约型开放式货币市场基金，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。

本基金主要投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单，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，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据，以及中国证监会及/或中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。本基金的投资目标为在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

#### 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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，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；

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，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 6.4.6.2 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。

#### 6.4.6.3 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 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<br>2018 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 2,534,068.98           |
| 定期存款           | 7,017,000,000.00       |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | 520,000,000.00         |
| 存款期限 3 个月以上    | 6,497,000,000.00       |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 7,019,534,068.98       |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2018 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                  | 5,247,868,123.81 | 5,257,681,000.00 | 9,812,876.19 | 0.0866% |
|        | 合计                     | 5,247,868,123.81 | 5,257,681,000.00 | 9,812,876.19 | 0.0866% |
| 资产支持证券 | -                      | -                | -                | -            |         |
| 合计     | 5,247,868,123.81       | 5,257,681,000.00 | 9,812,876.19     | 0.0866%      |         |

注：偏离金额=影子定价-摊余成本；偏离度=偏离金额/基金资产净值。



### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 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<br>2018年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 30,000,000.00     | -         |
| 银行间市场 | 360,001,460.00    | -         |
| 合计    | 390,001,460.00    | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2018年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,139.72          |
| 应收定期存款利息   | 61,218,874.52     |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | -                 |
| 应收债券利息     | 19,606,514.61     |
| 应收资产支持证券利息 | -                 |
| 应收买入返售证券利息 | 469,343.15        |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | -                 |
| 合计         | 81,295,872.00     |

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018 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 | 112,417.59             |
| 合计          | 112,417.59             |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付信息披露费     | 189,014.74             |
| 应付审计费       | 24,795.19              |
| 应付账户维护费     | 9,300.00               |
| 合计          | 223,109.93             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |                    |
|---------------|---------------------------------------|--------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额               |
| 上年度末          | 5,619,760,831.51                      | 5,619,760,831.51   |
| 本期申购          | 23,389,497,937.06                     | 23,389,497,937.06  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -17,676,483,224.66                    | -17,676,483,224.66 |
| - 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           | 11,332,775,543.91                     | 11,332,775,543.91  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 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     | 175,448,285.69 | -     | 175,448,285.69 |
| 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  | -175,448,285.69 | - | -175,448,285.69 |
| 本期末      | -               | - | -               |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 36,472.60                  |
| 定期存款利息收入  | 132,146,327.16             |
| 其他存款利息收入  | -                          |
| 结算备付金利息收入 | -                          |
| 其他        | -                          |
| 合计        | 132,182,799.76             |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期末有股票投资收益。

#### 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<br>2018年1月1日至2018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 | 859,970.13                 |
| 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                           | 859,970.13                 |

##### 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<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|----------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 11,356,687,039.54          |

|                        |                   |
|------------------------|-------------------|
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 11,339,498,138.37 |
| 减：应收利息总额               | 16,328,931.04     |
| 买卖债券差价收入               | 859,970.13        |

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期未有股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期未有公允价值变动收益。

#### 6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

注：本基金本报告期未有交易费用。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| 审计费用  | 24,795.19                  |
| 信息披露费 | 119,014.74                 |
| 账户维护费 | 18,600.00                  |
| 银行划款费 | 63,226.83                  |
| 合计    | 225,636.76                 |

## 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的日后事项。

## 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。

### 6.4.9.2 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               |
|------------------------|-----------------------|
| 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。

## 6.4.10 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。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                    | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |                    |
|------------|----------------------------|--------------------|---------------------------------|--------------------|
|            | 回购成交金额                     | 占当期债券回购<br>成交总额的比例 | 回购成交金额                          | 占当期债券回购<br>成交总额的比例 |
| 东方证券股份有限公司 | 30,000,000.00              | 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回购交易。

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 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<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30<br>日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 11,045,725.01                            | 3,404,028.19                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,955,332.57                             | 21,446.24                                     |

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.27% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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前 3 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、公休假等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30<br>日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,636,403.78                             | 504,300.47                                    |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.04% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.04\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

| 获得销售服务费各关联方名称 | 本期                              |
|---------------|---------------------------------|
|               | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|               | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |
| 汇添富基金管理股份有限公司 | 6,217,349.57                    |
| 民生银行股份有限公司    | 34,063.16                       |
| 合计            | 6,251,412.73                    |
| 获得销售服务费各关联方名称 | 上年度可比期间                         |
|               | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|               | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |
| 汇添富基金管理股份有限公司 | 3,112,156.56                    |
| 合计            | 3,112,156.56                    |

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金的年销售服务费率为 0.25%，销售服务费的计算公式具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起

3 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至

最近可支付日支付。E 为前一日基金资产净值

### 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

单位：人民币元

| 本期                              |        |       |       |
|---------------------------------|--------|-------|-------|
| 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |        |       |       |
| 银行间市场                           | 债券交易金额 | 基金逆回购 | 基金正回购 |
|                                 |        |       |       |

| 交易的各关联方名称      | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额             | 利息支出       |
|----------------|---------------|------|------|------|------------------|------------|
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 99,115,653.33 | -    | -    | -    | 4,040,548,000.00 | 772,990.64 |

注：本基金上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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                   | 上年度可比期间              |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
|                            | 2018年1月1日至2018年6月30日 | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 基金合同生效日（2014年5月28日）持有的基金份额 | -                    | -                    |
| 期初持有的基金份额                  | 427,712,974.68       | 410,662,135.27       |
| 期间申购/买入总份额                 | 9,208,554.06         | 7,796,996.97         |
| 期间因拆分变动份额                  | -                    | -                    |
| 减：期间赎回/卖出总份额               | -                    | -                    |
| 期末持有的基金份额                  | 436,921,528.74       | 418,459,132.24       |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例          | 3.86%                | 9.39%                |

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2. 基金管理人于本报告期因红利再投获得本基金共 9,208,554.06 份。

##### 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

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未投资本基金。

##### 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                   |              | 上年度可比期间              |          |
|----------------|----------------------|--------------|----------------------|----------|
|                | 2018年1月1日至2018年6月30日 |              | 2017年1月1日至2017年6月30日 |          |
|                | 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 | 562,534,068.98       | 7,951,652.72 | 487,495.73           | 7,219.52 |



#### 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：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

| 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 |
|----------------|---------------|----------|----------------|----|
| 175,448,285.69 | -             | -        | 175,448,285.69 | -  |

#### 6.4.12 期末（2018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：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌股票。

##### 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 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,474,947,162.57 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         |
|-----------|---------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 180404    | 18 农发 04      | 2018 年 7 月 2 日 | 100.18 | 50,000    | 5,009,218.77   |
| 180407    | 18 农发 07      | 2018 年 7 月 2 日 | 99.92  | 1,000,000 | 99,923,073.56  |
| 170207    | 17 国开 07      | 2018 年 7 月 2 日 | 99.99  | 2,000,000 | 199,976,532.62 |
| 180404    | 18 农发 04      | 2018 年 7 月 2 日 | 100.18 | 770,000   | 77,141,969.05  |
| 111808154 | 18 中信银行 CD154 | 2018 年 7 月 4 日 | 99.27  | 1,000,000 | 99,267,153.17  |
| 111809148 | 18 浦发银行 CD148 | 2018 年 7 月 4 日 | 99.39  | 126,000   | 12,523,233.56  |
| 111810255 | 18 兴业银        | 2018 年 7 月     | 99.25  | 2,000,000 | 198,493,993.58 |

|           |               |                |       |            |                  |
|-----------|---------------|----------------|-------|------------|------------------|
|           | 行 CD255       | 4 日            |       |            |                  |
| 111817127 | 18 光大银行 CD127 | 2018 年 7 月 4 日 | 97.94 | 2,000,000  | 195,874,419.65   |
| 120227    | 12 国开 27      | 2018 年 7 月 5 日 | 99.70 | 300,000    | 29,910,659.31    |
| 170207    | 17 国开 07      | 2018 年 7 月 5 日 | 99.99 | 100,000    | 9,998,826.63     |
| 170410    | 17 农发 10      | 2018 年 7 月 5 日 | 99.96 | 1,680,000  | 167,940,806.80   |
| 111805142 | 18 建设银行 CD142 | 2018 年 7 月 5 日 | 99.03 | 2,000,000  | 198,067,925.34   |
| 111808169 | 18 中信银行 CD169 | 2018 年 7 月 5 日 | 99.04 | 2,000,000  | 198,083,130.94   |
| 111809148 | 18 浦发银行 CD148 | 2018 年 7 月 5 日 | 99.39 | 500,000    | 49,695,371.28    |
| 合计        |               |                |       | 15,526,000 | 1,541,906,314.26 |

-

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

#### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，

因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场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。

根据本基金的信用风险控制要求，本基金投资的短期融资券的信用评级，不低于以下标准：

- 1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别。
- 2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：
  - i) 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；
  - ii) 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。（例如，若中国主权评级为 A-级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+级）。
- 3) 同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。
- 4) 本基金持有短期融资券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 20 个交易日内予以全部减持。

#### 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<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 69,801,514.36          | 99,913,889.76            |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 1,110,134,843.54       | 1,850,102,290.16         |
| 合计     | 1,179,936,357.90       | 1,950,016,179.92         |

#### 6.4.13.2.2 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<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 4,038,021,106.60       | 1,251,259,094.29         |
| 合计     | 4,038,021,106.60       | 1,251,259,094.29         |

### 6.4.13.2.3 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<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | -                      | -                        |
| AAA 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 29,910,659.31          | 80,025,099.68            |
| 合计     | 29,910,659.31          | 80,025,099.68            |

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

#### 6.4.13.3.1 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》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国家政策性金融债及短期融资券等，均在银行间同业市场交易；因此，本报告期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2018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                | 672,534,068.98   | 3,497,000,000.00 | 2,850,000,000.00 | -    | -    | -               | 7,019,534,068.98  |
| 交易性金融资产             | 439,776,456.95   | 2,529,265,933.33 | 2,278,825,733.53 | -    | -    | -               | 5,247,868,123.81  |
| 买入返售金融资产            | 390,001,460.00   | -                | -                | -    | -    | -               | 390,001,460.00    |
| 应收利息                | -                | -                | -                | -    | -    | 81,295,872.00   | 81,295,872.00     |
| 应收申购款               | -                | -                | -                | -    | -    | 75,014,852.36   | 75,014,852.36     |
| 资产总计                | 1,502,311,985.93 | 6,026,265,933.33 | 5,128,825,733.53 | -    | -    | 156,310,724.36  | 12,813,714,377.15 |
| 负债                  |                  |                  |                  |      |      |                 |                   |
| 卖出回购金融资产款           | 1,474,947,162.57 | -                | -                | -    | -    | -               | 1,474,947,162.57  |
| 应付管理人报酬             | -                | -                | -                | -    | -    | 2,475,650.62    | 2,475,650.62      |
| 应付托管费               | -                | -                | -                | -    | -    | 366,763.07      | 366,763.07        |
| 应付销售服务费             | -                | -                | -                | -    | -    | 2,292,269.11    | 2,292,269.11      |
| 应付交易费用              | -                | -                | -                | -    | -    | 112,417.59      | 112,417.59        |
| 应付利息                | -                | -                | -                | -    | -    | 478,953.63      | 478,953.63        |
| 应交税费                | -                | -                | -                | -    | -    | 42,506.72       | 42,506.72         |
| 其他负债                | -                | -                | -                | -    | -    | 223,109.93      | 223,109.93        |
| 负债总计                | 1,474,947,162.57 | -                | -                | -    | -    | 5,991,670.67    | 1,480,938,833.24  |
| 利率敏感度缺口             | 27,364,823.36    | 6,026,265,933.33 | 5,128,825,733.53 | -    | -    | -150,319,053.69 | 11,332,775,543.91 |
| 上年度末<br>2017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                | 650,905,793.47   | 2,230,000,000.00 | 1,007,000,000.00 | -    | -    | -               | 3,887,905,793.47  |
| 交易性金融资产             | 229,346,791.56   | 576,019,167.89   | 1,224,675,320.15 | -    | -    | -               | 2,030,041,279.60  |
| 应收利息                | -                | -                | -                | -    | -    | 38,546,759.29   | 38,546,759.29     |
| 应收申购款               | -                | -                | -                | -    | -    | -271,508,627.76 | 271,508,627.76    |

|           |                |                  |                  |   |   |                 |                  |
|-----------|----------------|------------------|------------------|---|---|-----------------|------------------|
| 资产总计      | 880,252,585.03 | 2,806,019,167.89 | 2,231,675,320.15 | - | - | -310,055,387.05 | 6,228,002,460.12 |
| 负债        |                |                  |                  |   |   |                 |                  |
| 卖出回购金融资产款 | 604,963,972.54 | -                | -                | - | - | -               | 604,963,972.54   |
| 应付管理人报酬   | -              | -                | -                | - | - | 1,239,529.90    | 1,239,529.90     |
| 应付托管费     | -              | -                | -                | - | - | 183,634.04      | 183,634.04       |
| 应付销售服务费   | -              | -                | -                | - | - | 1,147,712.90    | 1,147,712.90     |
| 应付交易费用    | -              | -                | -                | - | - | 72,053.17       | 72,053.17        |
| 应付利息      | -              | -                | -                | - | - | 365,426.06      | 365,426.06       |
| 其他负债      | -              | -                | -                | - | - | 269,300.00      | 269,300.00       |
| 负债总计      | 604,963,972.54 | -                | -                | - | - | 3,277,656.07    | 608,241,628.61   |
| 利率敏感度缺口   | 275,288,612.49 | 2,806,019,167.89 | 2,231,675,320.15 | - | - | -306,777,730.98 | 5,619,760,831.51 |

注：上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|               |  |                             |                        |
|---------------|--|-----------------------------|------------------------|
| 假设            | 1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；  |                             |                        |
|               | 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；  |                             |                        |
|               | 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；   |                             |                        |
|               | 4. 银行存款以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。 |                             |                        |
| 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（2018 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2017 年 12 月 31 日） |
|               | 基准利率增加 25 个基点  | -4,429,936.41               | -1,828,417.30          |
| 基准利率减少 25 个基点 | 4,440,837.60   | 1,832,939.69                |                        |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金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

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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和证券交易所的债券回购产品，且以摊余

成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

#### **6.4.14 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            | 5,247,868,123.81  | 40.96         |
|    | 其中:债券             | 5,247,868,123.81  | 40.96         |
|    | 资产支持证券            | -                 | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 390,001,460.00    | 3.04          |
|    | 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      | 7,019,534,068.98  | 54.78         |
| 4  | 其他各项资产            | 156,310,724.36    | 1.22          |
| 5  | 合计                | 12,813,714,377.15 | 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 | 8.36             |                |
|    | 其中:买断式回购融资   | -                |                |
| 序号 | 项目           | 金额               | 占基金资产净值的比例 (%) |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 1,474,947,162.57 | 13.01          |
|    | 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

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数  |
|-------------------|-----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 110 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 114 |



|                   |    |
|-------------------|----|
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 70 |
|-------------------|----|

### 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                 | 11.93               | 13.01               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.00                | -                   |
| 2  | 30 天(含)—60 天           | 12.67               | 0.00                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.00                | -                   |
| 3  | 60 天(含)—90 天           | 40.09               | 0.00                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.00                | -                   |
| 4  | 90 天(含)—120 天          | 4.30                | 0.00                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.00                | -                   |
| 5  | 120 天(含)—397 天 (含)     | 42.70               | 0.00                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.00                | -                   |
| 合计 |                        | 111.69              | 13.01               |

### 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：本报告期内本货币基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------|----------------|---------------|
| 1  | 国家债券 | -              | -             |
| 2  | 央行票据 | -              | -             |
| 3  | 金融债券 | 750,019,522.50 | 6.62          |

|    |                      |                  |       |
|----|----------------------|------------------|-------|
|    | 其中：政策性金融债            | 750,019,522.50   | 6.62  |
| 4  | 企业债券                 | -                | -     |
| 5  | 企业短期融资券              | 459,827,494.71   | 4.06  |
| 6  | 中期票据                 | -                | -     |
| 7  | 同业存单                 | 4,038,021,106.60 | 35.63 |
| 8  | 其他                   | -                | -     |
| 9  | 合计                   | 5,247,868,123.81 | 46.31 |
| 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  | 170207    | 17 国开 07      | 2,100,000 | 209,975,359.25 | 1.85         |
| 2  | 111810255 | 18 兴业银行 CD255 | 2,000,000 | 198,493,993.58 | 1.75         |
| 3  | 111899291 | 18 盛京银行 CD226 | 2,000,000 | 198,129,861.48 | 1.75         |
| 4  | 111808169 | 18 中信银行 CD169 | 2,000,000 | 198,083,130.94 | 1.75         |
| 5  | 111805142 | 18 建设银行 CD142 | 2,000,000 | 198,067,925.34 | 1.75         |
| 6  | 111821115 | 18 渤海银行 CD115 | 2,000,000 | 197,889,193.15 | 1.75         |
| 7  | 111898550 | 18 成都银行 CD141 | 2,000,000 | 196,102,091.41 | 1.73         |
| 8  | 111817127 | 18 光大银行 CD127 | 2,000,000 | 195,874,419.65 | 1.73         |
| 9  | 111814044 | 18 江苏银行 CD044 | 2,000,000 | 195,582,614.45 | 1.73         |
| 10 | 170410    | 17 农发 10      | 1,800,000 | 179,936,578.71 | 1.59         |

### 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                   | 0.1035% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0037% |

|                        |         |
|------------------------|---------|
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0420% |
|------------------------|---------|

**报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明**

注：本基金本报告期内无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**

注：本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

**7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

**7.9 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每日计提利息，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的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

**7.9.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额             |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | -              |
| 2  | 应收证券清算款 | -              |
| 3  | 应收利息    | 81,295,872.00  |
| 4  | 应收申购款   | 75,014,852.36  |
| 5  | 其他应收款   | -              |
| 6  | 待摊费用    | -              |
| 7  | 其他      | -              |
| 8  | 合计      | 156,310,724.36 |

## § 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

| 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 |
| 780,810  | 14,514.13 | 1,741,093,119.35 | 15.36% | 9,591,682,424.56 | 84.64% |

### 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  | 基金类机构 | 436,921,528.74 | 3.86%  |
| 2  | 其他机构  | 27,796,174.36  | 0.25%  |
| 3  | 个人    | 3,617,419.26   | 0.03%  |
| 4  | 个人    | 3,375,775.47   | 0.03%  |
| 5  | 个人    | 3,288,411.41   | 0.03%  |
| 6  | 个人    | 2,970,625.99   | 0.03%  |
| 7  | 个人    | 2,878,416.30   | 0.03%  |
| 8  | 个人    | 2,749,015.24   | 0.02%  |
| 9  | 个人    | 2,712,306.57   | 0.02%  |
| 10 | 个人    | 2,612,419.14   | 0.02%  |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 1,080,230.95 | 0.01%    |

### 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的情况

| 项目 | 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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0    |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                |                   |
|--------------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2014 年 5 月 28 日）基金份额总额 | 510,539,019.63    |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 5,619,760,831.51  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 23,389,497,937.06 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 17,676,483,224.66 |
| 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                   | 11,332,775,543.91 |

注：总申购份额含红利再投份额。

## § 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

1. 《汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 19 日正式生效，胡昕炜先生任该基金的基金经理。
2. 《汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 25 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。
3. 《汇添富熙和精选混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 11 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。
4. 《汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
5. 《汇添富行业整合主题混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，赵鹏程先生任该基金的基金经理。
6. 《汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，陈健玮先生和劳杰男先生任该基金的基金经理。
7. 基金管理人于 2018 年 2 月 14 日公告，增聘胡娜女士担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。
8. 基金管理人 2018 年 3 月 2 日公告，劳杰男先生不再担任汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的基金经理，由李威先生单独管理该基金。
9. 基金管理人于 2018 年 3 月 2 日公告，增聘郑慧莲女士担任汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。
10. 《汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 8 日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。
11. 基金管理人于 2018 年 3 月 20 日公告，增聘赵鹏飞先生担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生、胡娜女士共同管理该基金。
12. 《汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 23 日正式生效，吴振翔先生和许一尊先生任该基金的基金经理。
13. 基金管理人于 2018 年 4 月 3 日公告，增聘郑慧莲女士担任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。
14. 《汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 16 日正式生效，吴江宏先生和胡娜女士任该基金的基金经理。
15. 《汇添富智能制造股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 23 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。
16. 《汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 26 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
17. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。
18. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 30 天债券型证券

投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

19. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

20. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，徐寅喆女士不再担任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理，增聘陶然先生担任该基金的基金经理，由陶然先生单独管理该基金。

21. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，陆文磊先生和徐寅喆女士不再担任汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理，增聘陶然先生担任该基金的基金经理，由陶然先生单独管理该基金。

22. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，徐寅喆女士不再担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，增聘陶然先生担任该基金的基金经理，由陶然先生单独管理该基金。

23. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，增聘徐寅喆女士担任汇添富货币市场基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理该基金。

24. 基金管理人 2018 年 5 月 17 日公告，韩贤旺先生和欧阳沁春先生不再担任汇添富全球移动互联网灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，由杨璠先生单独管理该基金。

25. 《汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2018 年 5 月 23 日正式生效，过蓓蓓女士任该基金的基金经理。

26. 基金管理人 2018 年 5 月 29 日公告，聘任茹奕菡为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

27. 《汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 6 月 21 日正式生效，杨璠先生任该基金的基金经理。

28. 本报告期，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）根据工作需要，任命孔建先生担任公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。孔建先生的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

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 | -    | -            | 30,000,000.00 | 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：

本基金本报告期末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：本基金本报告期末发生偏离度绝对值超过 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  | 汇添富和聚宝货币市场基金更新招募说明书(2017年第2号) | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2018年1月6日  |
| 2  | 关于汇添富和聚宝货币市场基金增加建设银行为代销机构的公告  | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2018年1月30日 |
| 3  | 关于汇添富和聚宝货币市场基金增加浦发银行为代销机构的公告  | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2018年3月19日 |
| 4  | 关于汇添富和聚宝货币市场基金增加东亚银行为代销机构的公告  | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2018年3月27日 |
| 5  | 关于汇添富和聚宝货币市场基金增加招商银行为代销机构的公告  | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2018年5月30日 |
| 6  | 关于汇添富和聚宝货币市场基金增加平安银行为代销机构的公告  | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2018年6月1日  |
| 7  | 关于汇添富和聚宝货币市场基金暂停大额申购业务的公告     | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2018年6月14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

注：无。

### 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、中国证监会批准汇添富和聚宝货币市场基金募集的文件；
- 2、《汇添富和聚宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《汇添富和聚宝货币市场基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富和聚宝货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 19-22 层 汇添富基金管理股份有限公司

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2018 年 8 月 25 日