

汇添富全额宝货币市场基金 2020 年中期报告

2020 年 06 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2020 年 08 月 28 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。本中期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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 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 2020 年 01 月 01 日起至 6 月 30 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	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 债券回购融资情况	48
7.3 基金投资组合平均剩余期限	49
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	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	51
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	51
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	52
7.9 投资组合报告附注	52

§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	57
10.9 其他重大事件.....	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富全额宝货币市场基金
基金简称	汇添富全额宝货币
基金主代码	000397
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 13 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	116,504,097,210.55
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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95568
传真	021-28932998	010-58560798
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	200120	100031
法定代表人	李文	高迎欣

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

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 20 楼

§ 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(2020 年 01 月 01 日 - 2020 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	1,222,157,929.48
本期利润	1,222,157,929.48
本期基金净值收益率	1.0919%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)
期末基金资产净值	116,504,097,210.55
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)
累计净值收益率	26.5182%

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、所述基金业绩指标不包含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、本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

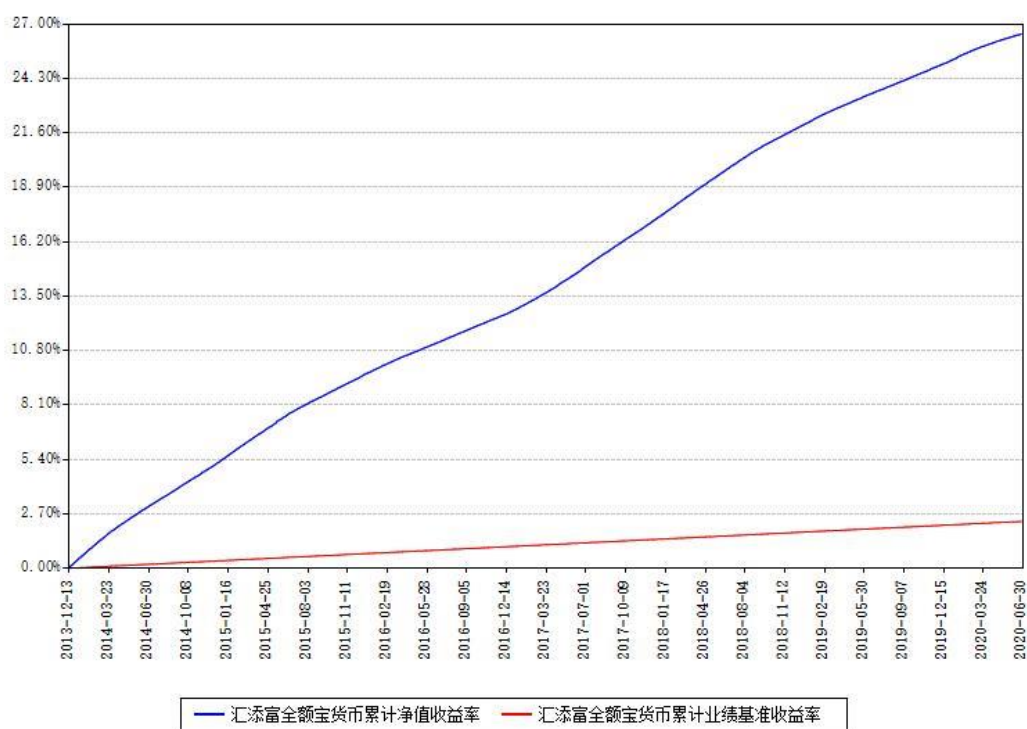
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.1401%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.1109%	0.0002%
过去三个月	0.4584%	0.0009%	0.0885%	0.0000%	0.3699%	0.0009%
过去六个月	1.0919%	0.0018%	0.1769%	0.0000%	0.9150%	0.0018%

月						
过去一年	2.3249%	0.0016%	0.3558%	0.0000%	1.9691%	0.0016%
过去三年	10.0659%	0.0026%	1.0656%	0.0000%	9.0003%	0.0026%
自基金合同生效日起至今	26.5182%	0.0032%	2.3256%	0.0000%	24.1926%	0.0032%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富全额宝货币累计净值收益率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013年12月13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经中国证监会证监基金字【2005】5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立。目前，公司注册资本为 132,724,224 元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

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

2020 上半年，汇添富基金新成立 11 只公开募集证券投资基金，包括 4 只债券型基金、5 只混合型基金、1 只基金中基金、1 只指数基金联接基金。截至 2020 年 6 月 30 日，公司共管理 154 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限 （年）	说明
		任职日期	离任日期		
徐寅喆	本基金的基金经理、现金管理部主管	2020 年 02 月 26 日		12	国籍：中国。 学历：复旦大学管理学硕士。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，现任现金管理部主管。2014 年 8 月 27 日至今任汇添富理财 7 天债

				<p>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、汇添富理财 60 天债券基金的基金经理，2019 年 1 月 25 日至今任汇添富添富通货币基金的基金经理，2019 年 9 月 10 日至今任汇添富汇鑫货币基金的基金经理，2020 年 2 月 26 日至今任汇添富全额宝货币基</p>
--	--	--	--	---

					金、汇添富收益快线货币基金的基金经理。
王俊杰	本基金的基金经理助理	2020年02月28日		4	<p>国籍：中国。 学历：上海财经大学市场营销学学士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014年9月至2016年4月任上海国际货币经纪有限责任公司债券经纪人；2016年5月至2018年6月任汇添富基金管理股份有限公司债券交易员，2018年7月至2019年8月任汇添富基金管理股份有限公司高级债券交易员。2019年9月1日至今任汇添富和聚宝货币的基金经理助理，2019年10月30日至今任汇添富汇鑫货币的基金经理助理，2020年2月28日至今任汇添富全额宝货币、汇添富收益快线货币、汇添富收益快钱货币的基金经理助理。</p>
陶然	已离职	2018年05月	2020年02月	10	国籍：中国，

		04 日	26 日		<p>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 日至 2020 年 2 月 28 日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 2020 年 2 月 26 日任汇添富现金宝货币的基金经理，2017 年 9 月 7 日至</p>
--	--	------	------	--	---

					2019年1月25日任汇添富添富货币基金基金经理，2018年5月4日至2020年2月26日任汇添富全额宝货币基金、汇添富收益快线货币基金、汇添富收益快线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。

4.1.3 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

注：本报告期末本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《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。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作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。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、营运、风险管理以及合规稽核等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

对于同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3日内和5日内）同买或者同卖同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。根据95%置信区间下平均价差率的T检验显著程度、

同向交易占优比等方面进行综合分析,来判断是否存在重大利益输送的可能性。本报告期内,未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

对于反向交易,我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析,未发现异常情况。

综合而言,本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估,严格执行了公平交易制度,公平对待了旗下各投资组合。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 34 次,投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易,基金经理按内部规定履行了审批程序,未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

上半年全球新冠疫情肆虐,世界经济遭受重创,欧美日等世界各国纷纷推出强有力的刺激政策以提振市场,试图缓解疫情对经济的冲击,全球进入流动性宽松格局;聚焦国内,上半年经历了疫情爆发,到逐步控制,再到经济逐渐回暖的过程;宏观数据来看,上半年 GDP 同比下降 1.6%,其中二季度 GDP 同比增长 3.2%,较一季度-6.8%显著改善,工业增加值、PMI 等一系列指标同样在二季度逐渐转好;总的来看,国内经济稳中向好、长期向好、高质量发展的基本面仍没有变化。

货币政策方面,上半年央行通过降准、调低公开市场操作及 MLF 利率,下调超额准备金利率及再贷款再贴现利率、创设直达实体经济的工具等一系列的举措进一步降低社会融资成本,疏通货币政策向实体经济的传导,缓解实体经济面临的实际困难,对冲疫情的影响。在一季度特殊时期的货币政策实施的同时,警惕风险,随着经济基本面的逐步改善,货币政策逐渐在二季度回归常态,逐步从总量型工具转向结构型工具,防止刺激政策带来后遗症,从而防范系统性金融风险的出现。

市场方面,上半年各期限利率经历先下后上的大幅波动,DR001 回购利率最低下至 1% 以下后,至 6 月回归到 1.7%附近;3M 国股存单从年初 2.7% 下行至 4 月最低 1.3%后逐步上行至二季末 2.1%。

操作上,报告期内本基金以同业存单、银行存款为主要配置资产,维持一定比例高等级

信用债配置，采取相对灵活的投资策略，积极调整组合仓位及投资组合剩余期限，在控制组合风险的同时为持有人获取稳定回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值收益率为 1.0919%。同期业绩比较基准收益率为 0.1769%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，目前来看，国内受疫情影响经济最差的时候已经过去了，而在前期宽松政策助推下，下半年经济将较大概率继续回升，未来的风险仍在于中美政治摩擦以及海外疫情的延续。因此，下半年我国将处于一个外部环境仍旧严峻，内部逐渐改善的情况之下。从政策的角度来看，两会期间财政方面通过的提高赤字率、发行特别国债、增加地方政府专项债额度等一系列措施，将在下半年成为主要抓手，进一步发力实现六稳、六保的诉求。

从流动性管理角度来看，货币政策最为宽松的时刻已经过去，下半年将逐步回归正常化，但在就业压力，企业生存及外部冲击的影响下预计也不会迅速收紧，维持流动性总量合理充裕、降低社会融资成本、疏通货币政策向实体经济的传导仍是货币政策的重点。因此，预计下半年资金面会以平衡为主，但仍应警惕关键时点流动性边际收紧的风险。

我们将密切追踪基本面、政策面和资金面的变化，做好同业存单、定期存款及高等级信用债等各类资产配置切换以及比例的动态调整，严防流动性风险。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《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金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。

2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日期间累计分配收益 1,222,157,929.48 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 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：汇添富全额宝货币市场基金

报告截止日：2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	54,394,602,489.74	45,087,755,356.66
结算备付金		547,751,666.65	406,868,095.14
存出保证金		32,541.66	-
交易性金融资产	6.4.7.2	44,681,267,838.56	32,656,848,165.09
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		44,417,477,816.47	32,556,843,363.13
资产支持证券投资		263,790,022.09	100,004,801.96
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	22,683,678,000.00	20,059,481,978.48
应收证券清算款		399,230,104.35	1,373,220,317.51
应收利息	6.4.7.5	627,466,755.44	316,708,732.19
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		123,334,029,396.40	99,900,882,645.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
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		6,391,984,604.00	8,899,917,184.66
应付证券清算款		381,631,742.43	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		25,776,568.30	21,136,225.75
应付托管费		4,773,438.55	3,914,115.90
应付销售服务费		23,867,192.87	19,570,579.36
应付交易费用	6.4.7.7	639,394.13	547,315.81
应交税费		564,097.88	4,916.05
应付利息		586,393.79	3,525,378.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	108,753.90	289,300.00
负债合计		6,829,932,185.85	8,948,905,016.01
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	116,504,097,210.55	90,951,977,629.06
未分配利润	6.4.7.1 0	-	-
所有者权益合计		116,504,097,210.55	90,951,977,629.06
负债和所有者权益总计		123,334,029,396.40	99,900,882,645.07

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 116,504,097,210.55 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富全额宝货币市场基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 01 月 01 日 至 2020 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
一、收入		1,610,651,486.31	1,556,022,767.49
1. 利息收入		1,590,897,208.18	1,555,765,418.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	926,592,720.41	836,371,626.08
债券利息收入		432,341,296.29	474,970,590.59
资产支持证券利息收入		808,242.91	313,226.90
买入返售金融资产收入		231,154,948.57	244,109,974.94
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,754,278.13	257,348.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	19,757,144.49	257,762.80
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.2	-2,866.36	-413.82
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-	-
减：二、费用		388,493,556.83	289,745,653.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	151,993,371.25	127,944,577.72
2. 托管费	6.4.10.2.2	28,146,920.55	23,693,440.31
3. 销售服务费		140,734,603.04	118,467,201.61
4. 交易费用	6.4.7.20	-	-

5. 利息支出		67,225,342.70	19,365,626.86
其中：卖出回购金融资产支出		67,225,342.70	19,365,626.86
6. 税金及附加		186,184.33	53,187.92
7. 其他费用	6.4.7.21	207,134.96	221,619.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,222,157,929.48	1,266,277,114.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,222,157,929.48	1,266,277,114.07

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富全额宝货币市场基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 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）	90,951,977,629.06	-	90,951,977,629.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,222,157,929.48	1,222,157,929.48
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）	25,552,119,581.49	-	25,552,119,581.49
其中：1. 基金申购款	687,435,726,113.42	-	687,435,726,113.42
2. 基金赎回款	-661,883,606,531.93	-	-661,883,606,531.93
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）	-	-1,222,157,929.48	-1,222,157,929.48
五、期末所有者权益（基金净值）	116,504,097,210.55	-	116,504,097,210.55
项目	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 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)	83,923,915,392.35	-	83,923,915,392.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,266,277,114.07	1,266,277,114.07
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)	6,640,086,397.48	-	6,640,086,397.48
其中: 1. 基金申购款	416,164,666,843.27	-	416,164,666,843.27
2. 基金赎回款	-409,524,580,445.79	-	-409,524,580,445.79
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)	-	-1,266,277,114.07	-1,266,277,114.07
五、期末所有者权益(基金净值)	90,564,001,789.83	-	90,564,001,789.83

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

汇添富全额宝货币市场基金(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[2013]1243号文《关于核准汇添富全额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2013年12月13日正式生效。首次设立募集规模为584,963,382.92份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金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：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《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集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 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日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，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.3 企业所得税

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

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

6.4.6.4 个人所得税

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

6.4.7 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 2020年06月30日
活期存款	489,602,489.74
定期存款	53,905,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	6,830,000,000.00
存款期限3个月以上	47,075,000,000.00
其他存款	-
合计	54,394,602,489.74

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020年06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	323,149,289.65	322,240,000.00	-909,289.65	-0.0008
	银行间市场	44,094,328,526.82	44,097,041,000.00	2,712,473.18	0.0023
	合计	44,417,477,816.47	44,419,281,000.00	1,803,183.53	0.0015
资产支持证券		263,790,022.09	263,790,000.00	-22.09	-
合计		44,681,267,838.56	44,683,071,000.00	1,803,161.44	0.0015

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 2020年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	22,683,678,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	22,683,678,000.00	-

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 2020年06月30日
应收活期存款利息	28,085.77
应收定期存款利息	451,906,461.30
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	246,488.20
应收债券利息	172,555,360.58
应收资产支持证券利息	113,395.08
应收买入返售证券利息	2,616,949.91
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	14.60
合计	627,466,755.44

注：“其他”为应收结算保证金利息。

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 2020年06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	639,394.13
合计	639,394.13

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30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	-
应付审计费	39,781.56
应付信息披露费	59,672.34
应付指数使用费	-
应付账户维护费	9,300.00
应付汇划费	-

其他	-
合计	108,753.90

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	90,951,977,629.06	90,951,977,629.06
本期申购	687,435,726,113.42	687,435,726,113.42
本期赎回（以“-”号填列）	-661,883,606,531.93	-661,883,606,531.93
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	116,504,097,210.55	116,504,097,210.55

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	1,222,157,929.48	-	1,222,157,929.48
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	-1,222,157,929.48	-	-1,222,157,929.48
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年01月01日至2020年06月30日	
活期存款利息收入	380,241.06	
定期存款利息收入	923,146,921.40	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	3,065,417.49	
其他	140.46	
合计	926,592,720.41	

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年01月01日至2020年06月30日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	125,372,870,183.50	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	125,000,983,859.96	
减：应收利息总额	352,129,179.05	
买卖债券差价收入	19,757,144.49	

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年01月01日至2020年06月30日	
卖出资产支持证券成交总额	96,923,573.93	
减：卖出资产支持证券成本总额	96,212,866.36	
减：应收利息总额	713,573.93	
资产支持证券投资收益	-2,866.36	

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.17 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.18 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。

6.4.7.19 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.20 交易费用

注：本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	89,081.06
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-
合计	207,134.96

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内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, 基金销售机构, 基金注册登记机构
中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	325,477,271.23	100.00	-	-

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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
东方证券	473,099,346,000.00	100.00	452,624,100,000.00	100.00

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不存在向关联方支付佣金的情况。

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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	151,993,371.25	127,944,577.72
其中：支付销售机构的客户维护费	81,342,031.28	42,063,506.59

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.27% 的年费率计提。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 为前一日的基金资产净值

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款指令，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	上年度可比期间
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	28,146,920.55	23,693,440.31

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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款指令，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、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	合计
汇添富基金管理股份有限公司	3,487,536.85
中国民生银行股份有限公司	3.64
合计	3,487,540.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	合计
汇添富基金管理股份有限公司	40,562,025.31
中国民生银行股份有限公司	12.30
合计	40,562,037.61

注：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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行股份有限公司	642,581,477.37	201,110,854.79	-	-	1,681,673,000.00	462,132.71
上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行股份有限公司	485,194,673.97	-	-	-	-	-

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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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：本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至
----	----------------------------------	---------------------------

方名称	30 日		2019 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
民生银行	7,009,602,489.74	71,720,497.77	3,808,244,979.62	34,028,785.23

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直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

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
1,222,157,929.48	-	-	1,222,157,929.48	

6.4.12 期末(2020年06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

6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.2 受限证券类别: 债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

		日		类					
				型					
1686	信	202	202	新					
49	润	0年	0年	债	100.	100.	2,600,0	260,000,000	260,000,000
	03A	06	07	流	00	00	00	.00	.00
	1	月	月	通					
		22	06	受					
		日	日	限					

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2020 年 06 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 6,391,984,604.00 元, 是以如下债券作为质押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
111905110	19 建设银行 CD110	2020 年 07 月 01 日	99.69	9,000,000	897,212,752.94
111905116	19 建设银行 CD116	2020 年 07 月 01 日	99.65	2,111,000	210,365,571.38
112008094	20 中信银行 CD094	2020 年 07 月 01 日	98.33	4,000,000	393,332,161.86
112008099	20 中信银行 CD099	2020 年 07 月 01 日	99.54	8,000,000	796,330,265.34
112018094	20 华夏银行 CD094	2020 年 07 月 01 日	98.87	3,125,000	308,979,450.57
140203	14 国开 03	2020 年 07 月 01 日	101.74	1,500,000	152,617,028.51

160206	16 国开 06	2020 年 07 月 01 日	100.94	3,500,000	353,303,596.25
160309	16 进出 09	2020 年 07 月 01 日	100.44	11,000,000	1,104,845,524.94
180203	18 国开 03	2020 年 07 月 01 日	102.19	6,240,000	637,691,079.76
190211	19 国开 11	2020 年 07 月 01 日	100.15	7,700,000	771,116,563.13
190307	19 进出 07	2020 年 07 月 01 日	100.11	10,200,000	1,021,072,204.94
合计				66,376,000	6,646,866,199.62

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 年 06 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 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	3,637,458,290.54	200,002,336.78
A-1 以下	-	-
未评级	10,474,293,380.80	4,751,878,444.11
合计	14,111,751,671.34	4,951,880,780.89

注：未评级债券为超短期融资券、国债、中央银行票据以及政策性金融债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	263,790,022.09	100,004,801.96
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	263,790,022.09	100,004,801.96

注：短期信用评级 A-1 所填列的资产支持证券均为 AAA 级的短期资产支持证券。

6.4.13.2.3 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 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	25,517,368,143.38	26,511,857,783.69

合计	25,517,368,143.38	26,511,857,783.69
----	-------------------	-------------------

6.4.13.2.4 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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	886,575,128.08	-
AAA 以下	-	-
未评级	3,901,782,873.67	-
合计	4,788,358,001.75	1,093,181,944.68

注：未评级债券包括国债、中央银行票据以及政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券

注：本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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 20 20 年 06 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	6,179,602, 489.74	26,330,000 ,000.00	21,885,000 ,000.00	-	-	-	54,394,602 ,489.74

结 算 备 付 金	547,751,66 6.65	-	-	-	-	-	547,751,66 6.65
存 出 保 证 金	32,541.66	-	-	-	-	-	32,541.66
交 易 性 金 融 资 产	4,841,116, 598.90	22,462,303 ,065.47	16,273,002 ,649.25	1,104,845 ,524.94	-	-	44,681,267 ,838.56
应 收 股 利	-	-	-	-	-	-	-
应 收 利 息	-	-	-	-	-	627,466,7 55.44	627,466,75 5.44
应 收 申 购	-	-	-	-	-	-	-

款							
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	399,230,104.35	399,230,104.35
买入返售金融资产	22,362,778,000.00	320,900,000.00	-	-	-	-	22,683,678,000.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	33,931,281,296.95	49,113,203,065.47	38,158,002,649.25	1,104,845,524.94	-	1,026,696,859.79	123,334,029,396.40

计							
负							
债							
应							
付							
赎							
回							
款							
	-	-	-	-	-	-	-
应							
付							
管							
理							
人							
报							
酬							
	-	-	-	-	-	25,776,568.30	25,776,568.30
应							
付							
托							
管							
费							
	-	-	-	-	-	4,773,438.55	4,773,438.55
应							
付							
证							
券							
清							
算							
款							
	-	-	-	-	-	381,631,742.43	381,631,742.43
卖	6,391,984,604.00						6,391,984,604.00
出		-	-	-	-	-	

回 购 金 融 资 产 款							
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	23,867,192.87	23,867,192.87
应 付 交 易 费 用	-	-	-	-	-	639,394.13	639,394.13
应 交 税 费	-	-	-	-	-	564,097.88	564,097.88
应 付 利 息	-	-	-	-	-	586,393.79	586,393.79
应	-	-	-	-	-	-	-

付 利 润							
其 他 负 债	-	-	-	-	-	108,753.9 0	108,753.90
负 债 总 计	6,391,984, 604.00	-	-	-	-	437,947,5 81.85	6,829,932, 185.85
利 率 敏 感 度 缺 口	27,539,296 ,692.95	49,113,203 ,065.47	38,158,002 ,649.25	1,104,845 ,524.94	-	588,749,2 77.94	116,504,09 7,210.55
上 年 度 末 20 19 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	2,917,755, 356.66	21,490,000 ,000.00	20,680,000 ,000.00	-	-	-	45,087,755 ,356.66
结算备付金	406,868,09 5.14	-	-	-	-	-	406,868,09 5.14
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	4,980,988, 387.85	24,271,534 ,389.05	3,404,325, 388.19	-	-	-	32,656,848 ,165.09
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收	-	-	-	-	-	316,708,7 32.19	316,708,73 2.19

利息							
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,373,220,317.51	1,373,220,317.51
买入返售金融资产	20,059,481,978.48	-	-	-	-	-	20,059,481,978.48
其他	-	-	-	-	-	-	-

他 资 产							
资 产 总 计	28,365,093 ,818.13	45,761,534 ,389.05	24,084,325 ,388.19	-	-	1,689,929 ,049.70	99,900,882 ,645.07
负 债							
应 付 赎 回 款	-	-	-	-	-	-	-
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	-	-	21,136,22 5.75	21,136,225 .75
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	3,914,115 .90	3,914,115. 90
应 付 证	-	-	-	-	-	-	-

券清算款							
卖出回购金融资产款	8,899,917,184.66	-	-	-	-	-	8,899,917,184.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-	19,570,579.36	19,570,579.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	547,315.81	547,315.81
应交税	-	-	-	-	-	4,916.05	4,916.05

费							
应付利息	-	-	-	-	-	3,525,378.48	3,525,378.48
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	289,300.00	289,300.00
负债总计	8,899,917,184.66	-	-	-	-	48,987,831.35	8,948,905,016.01
利率敏感度缺口	19,465,176,633.47	45,761,534,389.05	24,084,325,388.19	-	-	1,640,941,218.35	90,951,977,629.06

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,并按照合同约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. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，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；定期存款利息收入、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；		
	5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
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 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	基准利率增加 25 个基点	-29,481,900.91	-16,487,253.46
	基准利率减少 25 个基点	29,542,119.24	16,508,463.01

6.4.13.4.2 外汇风险

注：本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

注：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

截止资产负债表日，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	44,681,267 ,838.56	36.23
	其中：债券	44,417,477 ,816.47	36.01
	资产支持证券	263,790,02 2.09	0.21
2	买入返售金融资产	22,683,678 ,000.00	18.39
	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	54,942,354 ,156.39	44.55
4	其他各项资产	1,026,729, 401.45	0.83
5	合计	123,334,02 9,396.40	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		7.68
	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	6,391,984,6 04.00	5.49
	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	85
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	99
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	76

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	27.66	5.81
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	18.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.95	-
3	60 天（含）—90 天	23.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	8.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

5	120 天（含）—397 天（含）	27.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		105.32	5.81

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	497,764,318 .73	0.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,747,737,2 12.39	5.79
	其中：政策性金融债	6,747,737,2 12.39	5.79
4	企业债券	323,149,289 .65	0.28
5	企业短期融资券	10,768,033, 013.89	9.24
6	中期票据	563,425,838 .43	0.48
7	同业存单	25,517,368, 143.38	21.90
8	其他	-	-
9	合计	44,417,477, 816.47	38.13
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	1,104,845,5	0.95

		24.94	
--	--	-------	--

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	111909272	19 浦发银行 CD272	12,000,000	1,197,736,955.66	1.03
2	160309	16 进出 09	11,000,000	1,104,845,524.94	0.95
3	190307	19 进出 07	10,200,000	1,021,072,204.94	0.88
4	112020020	20 广发银行 CD020	10,000,000	996,130,257.40	0.86
5	112020100	20 广发银行 CD100	10,000,000	995,487,858.11	0.85
6	200201	20 国开 01	9,700,000	974,046,388.87	0.84
7	111905110	19 建设银行 CD110	9,000,000	897,212,752.94	0.77
8	112017127	20 光大银行 CD127	9,000,000	895,713,656.94	0.77
9	111904117	19 中国银行 CD117	9,000,000	891,117,281.61	0.76
10	190211	19 国开 11	8,000,000	801,160,065.59	0.69

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1141%
报告期内偏离度的最低值	-0.0139%

报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0490%
------------------------	---------

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 0.50%情况说明

注：本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.50%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	168649	信润 03A1	2,600,000	260,000,000.00	0.22
2	1989480	19 上和 4A1	1,000,000	3,790,022.09	0.00

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

本基金估值采用摊余成本法计价，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销。

7.9.2

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、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	32,541.66
2	应收证券清算款	399,230,104.35
3	应收利息	627,466,755.44

4	应收申购款	
5	其他应收款	
6	待摊费用	
7	其他	
8	合计	1,026,729,401.45

§ 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 (%)
22,933,530	5,080.08	34,561,315.59	0.03	116,469,535,894.96	99.97

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	其他机构	30,050,085.85	0.03
2	个人	8,700,085.59	0.01
3	个人	7,004,937.40	0.01
4	个人	6,374,171.69	0.01
5	个人	6,032,890.11	0.01
6	个人	4,997,367.10	0.00
7	个人	4,990,363.27	0.00
8	个人	4,990,212.86	0.00
9	个人	4,989,324.68	0.00
10	个人	4,951,546.57	0.00

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	376,977.87	0.00

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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（2013年12月13日）基金份额总额	584,963,382.92
本报告期期初基金份额总额	90,951,977,629.06
本报告期基金总申购份额	687,435,726,113.42
减：本报告期基金总赎回份额	661,883,606,531.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	116,504,097,210.55

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内托管人及其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		基金交易	
	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 (%)	成 交 金 额	占当 期基 金成 交总 额的 比例 (%)
东 方 证 券	325,477,271.23	100.00	473,099,346,000.00	100.00	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的费率优惠活动的公告	上证报, 公司网站	2020 年 01 月 02 日
2	汇添富基金旗下 139 只基金 2019 年第 4 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 01 月 21 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金暂停申购、赎回 等业务的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 01 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于调整基金经理的公告（全额宝）	证券时报, 公司网站	2020 年 02 月 27 日
5	汇添富全额宝货币市场基金更新招募说明书（2020 年 2 月 29 日更新）	证券时报, 公司网站	2020 年 02 月 29 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金的基金经理助理	上交所, 证券时报, 公司网站, 深交所	2020 年 02 月 29 日

	的公告		
7	汇添富基金旗下 139 只基金 2019 年年度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 03 月 30 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所	2020 年 04 月 01 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议并更新招募说明书	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 04 月 14 日
10	汇添富基金旗下 145 只基金 2020 年 1 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 04 月 21 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金中基金 (FOF) 资产管理计划通过直销渠道申赎本公司旗下公募基金免除相关费用的公告	中证报, 公司网站	2020 年 04 月 29 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者超过 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全额宝货币市场基金募集的文件；
- 2、《汇添富全额宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《汇添富全额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、报告期内汇添富全额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 20 楼 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 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

2020 年 08 月 28 日