华宝现金添益交易型货币市场基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

基金管理人:华宝基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2018年8月24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。

基金托管人中国建设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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	华宝添益	
场内简称	华宝添益	
基金主代码	511990	
交易代码	511990	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月27日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	27,552,060,904.98份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2013年1月28日	
下属分级基金的基金简称:	华宝添益A	华宝添益B
下属分级基金的交易代码:	511990	001893
报告期末下属分级基金的份额总额	946,313,329.93份	26,605,747,575.05份

注:本基金场内基金份额(A类基金份额)简称为"华宝添益",基金份额净值为100.00元;场外基金份额(B类基金份额)简称为"华宝添益B",基金份额净值为100元。

2.2基金产品说明

投资目标	保持本金的安全性和基金财产的流动性,追求高于比较基准的稳定收益。
投资策略	1.久期策略:基于对宏观经济环境的深入研究,预期未来市场利率的变化趋势,结合基金未来现金流的分析,确定投资组合平均剩余期限,把握买卖时机。 2.收益率曲线策略,收益率曲线策略是根据收益曲线的非平行移动调整资产组合,将预期到的变动资本化。 3.类属配置策略:类属配置策略主要实现两个目标:一是通过类属配置满足基金流动性需求,二是通过类属配置获得投资收益。 4.证券选择策略:基金管理人将在保证基金的安全性和流动性的前提下,适当参与市场的套利,捕捉和把握无风险套利机会,进行债市场、跨品种操作,以取得高于安全的超额收益。 5.逆回购策略:基金管理人将密切关注由于新股申购等原因导致的短期资金需求激增的机会,通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金拆借利率陡升的投资机会。 6.现金流管理策略,投资运作中本基金将采用均衡分布、滚动投资、优化期限配置等方法,加强流动性管理。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	zxxpl@sfund.com	tianqing1zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588,021-38924558	010-67595096
传真		021-38505777	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金报别	华宝添益	华宝添益B
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)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	1,782,007,584.58	850,575,474.31
本期利润	1,782,007,584.58	850,575,474.31
本期净值收益率	1.9555%	2.0450%
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	94,631,332,993.76	26,605,747,575.05
期末基金份额净值	100	1.0000

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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

华宝添益A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3090%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.1980%	0.0002%
过去三个月	0.9435%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.6069%	0.0004%
过去六个月	1.9555%	0.0005%	0.6695%	0.0000%	1.2860%	0.0005%
过去一年	3.9425%	0.0004%	1.3500%	0.0000%	2.5925%	0.0004%
过去三年	9.6119%	0.0020%	4.0500%	0.0000%	5.5619%	0.0020%
自基金合同生效日起至今	20.9197%	0.0026%	7.4379%	0.0000%	13.4818%	0.0026%

华宝添益B

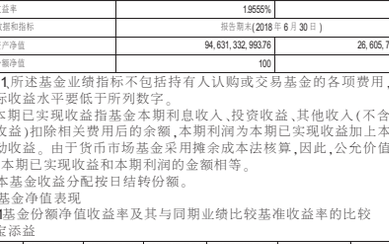
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3288%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.2178%	0.0002%
过去三个月	1.0039%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.6673%	0.0004%
过去六个月	2.0450%	0.0004%	0.6695%	0.0000%	1.3755%	0.0004%
过去一年	4.1598%	0.0004%	1.3500%	0.0000%	2.8098%	0.0004%
自基金合同生效日起至今	9.1018%	0.0023%	3.5618%	0.0000%	5.5400%	0.0023%

注:1.本基金业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)。

2.净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。

3.2015年11月9日起,华宝现金添益基金新增场外基金份额(B类基金份额,简称"华宝添益B"),11月10日起有资金进入申购,本报告中其累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的数据的计算起始日期为2015年11月10日。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.根据基金合同的约定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至2018年6月27日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

2.2015年11月9日起,华宝现金添益基金新增场外基金份额(B类基金份额,简称"华宝添益B"),11月10日起有资金进入申购,本报告中其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的数据的计算起始日期为2015年11月10日。

§4管理人报告

4.1基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及基金管理层的经验

基金管理人是2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末(2018年6月30日),所管理的证券投资基金包括宝康系列基金、华宝多策略基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合基金、华宝收益增长基金、华宝先进成长基金、华宝行业精选基金、华宝海外中国成长基金、华宝大盘精选基金、华宝增强收益基金、华宝中证100基金、上证180价值ETF,华宝上证180价值ETF联接基金、华宝新兴产业基金、华宝可转债基金、上证180成长ETF,华宝上证180成长ETF联接基金、华宝油气基金、华宝医药生物基金、华宝资源优选基金、华宝添益货币市场基金、华宝服务优选基金、华宝创新优选基金、华宝生态中国基金、华宝量化对冲基金、华宝高端制造基金、华宝品质生活基金、华宝稳健回报基金、华宝事件驱动基金、华宝国策导向基金、华宝新价值基金、华宝新机遇基金、华宝医疗分级基金、华宝中证100分级基金、华宝万物互联基金、华宝转型升级基金、华宝核心优势基金、华宝美国消费基金、华宝鑫纯债基金、华宝香港中小盘基金、华宝中证全指证券公司ETF,华宝中证军工ETF,华宝新活力基金、华宝沪深300指数增强基金、华宝未来主导产业基金、华宝新起点基金、华宝红利基金、华宝新飞跃基金、华宝新优选基金、华宝香港大盘基金、华宝智慧产业基金、华宝第三产业基金、华宝新优享基金、华宝银行ETF,华宝价值发现基金、华宝香港本地基金、华宝中证500指数增强基金、华宝香港精选基金、华宝券商ETF联接基金,所管理的证券投资基金资产净值合计1,634,280,039,194.92元。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈昕	固定收益部总经理,本基金基金经理,华宝现金宝货币基金经理	2012年12月27日	-	14年	经济学学士,2003年7月加入华宝基金管理有限公司,先后在清算登记部,交易部,固定收益部从事固定收益产品相关的估值,交易,投资工作,2011年11月至今任华宝现金宝货币市场基金基金经理,2012年6月-2014年2月兼任华宝中证短融50指数债券型证券投资基金基金经理,2012年12月起兼任华宝现金添益交易型货币市场基金基金经理,2015年3月起任固定收益部副总经理,2016年5月起任固定收益部总经理。
高文庆	本基金基金经理助理,华宝新起点混合基金经理,华宝现金宝货币基金经理	2015年8月27日	-	8年	硕士,2010年5月加入华宝基金管理有限公司,先后担任助理风险分析师,助理产品经理,信用分析师,高级信用分析师,基金经理助理等职务,2017年3月起担任华宝现金宝货币市场基金,华宝新起点混合型证券投资基金基金经理。
林昊	本基金基金经理助理,华宝新机遇混合,华宝新活力混合,华宝新回报混合,华宝新优选混合基金经理	2014年6月16日	-	12年	本科,2006年5月加入华宝基金管理有限公司,先后担任渠道经理,交易员,高级交易员,基金经理助理等职务,2017年3月起担任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金,华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF),华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年12月至2018年6月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年12月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金和华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2.证券从业含义遵从行业协会《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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《货币市场基金监督管理办法》、《华宝现金添益交易型货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司投票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制,确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求,分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差;分析结果未发现异常情况。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本报告期内,基金管理人未发生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%。

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年国内GDP增速6.8%,同比下降0.1个百分点,经济走势整体稳中趋缓。投资方面,1-6月固定资产投资增速为6.0%,其中制造业投资累计增速企稳回升至6.8%。在土地购置费延后支付的影响下上半年地产投资增速较1-7年上半年和全年分别提高12和27个百分点,保持了较高的增速。1-6月份社会消费品零售总额累计同比增长9.4%,消费对GDP累计同比贡献率上升至78.5%。虽然受到中美贸易摩擦的影响,1-6月出口累计增速仍在1-7年的高增速基础上进一步回升4.9个百分点,对支撑上半年经济的平稳起到至关重要的作用。

2018年上半年市场流动性整体处于中性偏宽松,央行货币政策由稳健中性转为稳健宽裕,分别于4月和7月实施定向降准,其中4月25日下调准备金率1个百分点,用来置换到期的MLF9000亿元,同时释放增量资金4000亿元。在央行降准和MLF续作等多种手段呵护下,市场资金面持续宽松,上半年银行间隔夜和7天回购利率中枢分别较去年下半年下行了18BP和18BP至2.7%和3.29%。债市方面,1月在银监会密集出台多项监管政策后,市场对监管趋严的担忧增加,10年期国开债估值收益率一度从4.87%上行26BP至5.18%的高点。1月中下旬开始,在宏观经济数据转弱、社会融资总量累计同比增速持续下行、金融监管边际趋缓、中美贸易战升级引发的避险情绪下,债市做多情绪持续发酵,长端利率债快速振荡下行,以10年期国开债为例,估值收益率较年初高点下行幅度超过90BP。高等级信用债跟随利率债大幅上涨,而低等级信用债受上市民企违约事件影响,收益率持续上行,信用利差整体走扩。

本基金在上半年的资产配置仍以同业存款为主要投资标的,债券、同业存单等其他品种为辅。在保证流动性的前提下,基金整体久期适度拉长。本基金在报告期内整体运行平稳。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,华宝添益A类基金份额净值收益率为1.9555%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%,本报告期华宝添益B的基金份额净值收益率为2.0450%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济稳中趋缓,表现出一定的韧性。展望下半年,经济依然存在一定的下行压力,一方面海外经济复苏分化,中美贸易争端可能对外需出口形成一定的负面影响。另一方面上半年投资整体低迷,城投平台融资渠道收缩以及民营企业融资环境尚未改善的背景下,后续基建投资和房地产投资对经济的承压影响或将持续显现。预计下半年货币政策继续维持总体稳健,结构性宽松,财政政策将更为积极。在一系列包括扩大开放、关税下调、增值税调降、小微企业税收优惠等政策安排下,内需在下半年是否会有所回暖有待观察。短期来看,债市交易情绪仍会受金融数据以及中美贸易争端预期变化的影响,而经济和政策的变化在下半年也显得更为关键。在此背景下,本基金管理人将继续本着谨慎、稳健、安全的原则,兼顾组合的安全性和流动性,维持资产结构的均衡配比,随时把握市场动向,为投资者谋取稳定回报。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时,由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

(1)日常估值流程

本基金的估值由基金会计负责,基金会计以本基金为会计核算主体,基金会计核算独立于公司会计核算,独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理;每日按时接收成交数据及权益数据,进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算,相互核对的方式进行;基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对,每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

(2)特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度,对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况,量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法(比如:指数收益法)进行估值,并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见,但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力,参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金A类份额在本年度累计分配收益1,782,007,584.58元,其中以红利再投资方式结转入实收基金1,784,266,982.23元,计入应付利润科目-2,259,397.65元。B类份额在本年度累计分配收益850,575,474.31元,其中以红利再投资方式结转入实收基金853,212,882.64元,计入应付利润科目-2,637,408.33元。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§5托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

本基金A类份额在本年度累计分配收益1,782,007,584.58元,其中以红利再投资方式结转入实收基金1,784,266,982.23元,计入应付利润科目-2,259,397.65元。B类份额在本年度累计分配收益850,575,474.31元,其中以红利再投资方式结转入实收基金853,212,882.64元,计入应付利润科目-2,637,408.33元。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:华宝现金添益交易型货币市场基金
报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	72,287,192,469.27	68,946,411,638.86
结算备付金	1,353,650,754.55	159,609,609.09
存出保证金	-	-
交易性金融资产	33,475,547,899.22	19,904,884,218.74
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	33,475,547,899.22	19,904,884,218.74
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	15,455,097,398.70	99,875,224.94
应收证券清算款	-	-
应收利息	891,210,646.19	758,852,660.54
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	1,638.73	1,888.73
资产总计	123,462,700,806.66	89,869,635,240.90
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	1,184,273,047.86	999,998,800.00
应付证券清算款	934,314,369.23	50,000,000.00
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	46,480,777.42	29,285,617.86
应付托管费	11,952,199.89	7,530,587.42
应付销售服务费	22,235,605.56	15,584,176.05
应付交易费用	314,766.61	226,446.72
应交税费	-	-
应付利息	199,053.68	373,288.44
应付利润	25,639,093.99	30,535,899.97
递延所得税负债	-	-
其他负债	211,323.61	277,000.00
负债合计	2,225,620,237.85	1,133,811,816.46
所有者权益:		
实收基金	121,237,080,568.81	88,735,823,424.44
未分配利润	-	-
所有者权益合计	121,237,080,568.81	88,735,823,424.44
负债和所有者权益总计	123,462,700,806.66	89,869,635,240.90

报告截止日2018年6月30日,华宝添益基金份额净值100.0000元,基金份额总额9,463,133,29.93份;华宝添益B基金份额净值100.00元,基金份额总额26,605,747,575.05份。华宝添益份额总额合计为27,552,060,904.98份。

6.2利润表

会计主体:华宝现金添益交易型货币市场基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	3,080,413,399.99	1,820,252,107.25
1.利息收入	3,080,391,999.72	1,820,342,393.46
其中:存款利息收入	1,954,795,670.68	1,563,004,531.36
债券利息收入	554,395,727.85	184,229,656.09
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	571,200,601.19	73,108,206.01
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	21,392.27	-90,286.21
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	21,392.27	-90,286.21
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	447,830,333.10	295,124,366.31
1.管理人报酬	233,712,217.12	151,730,523.96
2.托管费	60,097,427.20	39,016,420.39
3.销售服务费	127,663,149.39	92,691,155.38
4.交易费用	-	-
5.利息支出	26,006,845.59	11,294,741.23
其中:卖出回购金融资产支出	26,006,845.59	11,294,741.23
6.税金及附加	21,085.83	-
7.其他费用	329,607.97	391,525.35
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	2,632,583,058.89	1,525,127,740.94
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	2,632,583,058.89	1,525,127,740.94

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝现金添益交易型货币市场基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	88,735,823,424.44	-	88,735,823,424.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,632,583,058.89	2,632,583,058.89
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)	32,501,257,144.37	-	32,501,257,144.37
其中:1.基金申购款	221,323,909,124.45	-	221,323,909,124.45
2.基金赎回款	-188,822,651,980.08	-	-188,822,651,980.08
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)	-	-2,632,583,058.89	-2,632,583,058.89
五、期末所有者权益(基金净值)	121,237,080,568.81	-	121,237,080,568.81
项目	上年度可比期间 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)	75,515,727,758.62	-	75,515,727,758.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,525,127,740.94	1,525,127,740.94
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)	7,263,952,978.49	-	7,263,952,978.49
其中:1.基金申购款	94,649,359,075.91	-	94,649,359,075.91
2.基金赎回款	-87,385,406,097.42	-	-87,385,406,097.42
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)	-	-1,525,127,740.94	-1,525,127,740.94
五、期末所有者权益(基金净值)	82,779,680,737.11	-	82,779,680,737.11

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:

_____黄小薏_____ _____向辉_____ _____张幸骏_____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4报表附注

6.4.1基金基本情况

华宝现金添益交易型货币市场基金(原名为华宝兴业现金添益交易型货币市场基金,以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]651号《关于核准华宝兴业现金添益交易型货币市场基金募集的批复》核准,由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,已于2017年10月17日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,802,628,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第546号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》于2012年12月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,802,628,000.00份基金份额。本基金有效认购资金在募集期间产生的利息在银行结息日计入基金资产。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称"上交所")上证基字[2013]17号审核同意,本基金1,802,628,000.00份基金份额于2013年1月28日在上交所挂牌交易。

经中国证监会备案,本基金于2015年11月9日起增设本基金的场外基金份额(以下简称"B类基金份额")。本基金的原场内基金份额为A类基金份额,A类基金份额仅在上交所申购、赎回和上市交易。B类基金份额仅在场外进行申购和赎回。A类基金份额的申购、赎回净值为每份人民币100.00元,B类基金份额的申购、赎回净值为每份人民币100元。A类基金份额由中国证券登记结算有限责任公司进行登记;B类基金份额由华宝兴业基金管理有限公司进行登记。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,华宝兴业现金添益交易型货币市场基金于2017年12月30日起更名为华宝现金添益交易型货币市场基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝现金添益交易型货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括现金;通知存款;短期融资券;剩余期限在397天以内(含397天)的债券;1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单;期限在1年以内(含1年)的债券回购;剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;期限在1年以内(含1年)的中央银行票据;剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。

6.4.2会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝现金添益交易型货币市场基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5会计政策变更的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

6.4.7关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司("华宝基金")	基金管理人、B类基金份额登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人
华宝信托有限责任公司("华宝信托")	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management, L.P.)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司("宝武集团")	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司("华宝证券")	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司("华宝投资")	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司("宝钢财务")	受宝武集团控制的公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	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管理费	233,712,217.12	151,730,523.96
其中:支付销售机构的客户维护费	24,173,477.22	21,528,567.04

注:支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.35%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.35%/当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	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托管费	60,097,427.20	39,016,420.39

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.09%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值X0.09%/当年天数。

6.4.8.2.3销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	华宝添益	华宝添益B	合计
华宝基金	43,645,250.90	13,219,613.83	56,864,864.73
华宝证券	560,349.56	-	560,349.56
合计	44,205,600.46	13,219,613.83	57,425,214.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		