# 汇添富和聚宝货币市场基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

基金管理人: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

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1月1日起至6月30日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇添富和聚宝货币 |
| 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 | Hub55@spdb.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-888-9918 | 95528 |
| 传真 | | 021-28932998 | 021-63602540 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.99fund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市富城路99号震旦国际大楼19-22层 汇添富基金管理股份有限公司 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(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 |

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。

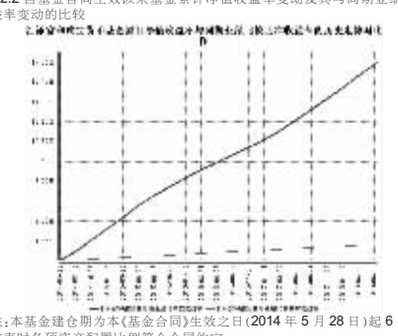
3、本基金收益分配为按日结转份额。

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



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、汇添富医药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、汇添富金额宝货币市场基金、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日任汇添富收益快钱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日任汇添富收益快钱货币基金基金经理,2016年6月7日至2018年5月4日任汇添富金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。 |
| 陶然 | 汇添富现金宝货币、汇添富添富通货币、汇添富金额宝货币、汇添富收益快钱货币、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 | 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日至今任汇添富金额宝货币基金、汇添富收益快钱货币基金、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遵规守信情况的说明

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,基金管理人对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、货币市场发展、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程度的扰动,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。

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历,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 | 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 | 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 | 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 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 390,001,460.00 | - |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 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 | - | - |
| 资产总计 | 12,813,714,377.15 | 6,228,002,460.12 |
| 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 | 1,474,947,162.57 | 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 | 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 | 223,109.93 | 269,300.00 |
| 负债合计 | 1,480,938,833.24 | 608,241,628.61 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 11,332,775,543.91 | 5,619,760,831.51 |
| 未分配利润 | - | - |
| 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 | 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 | 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 | 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 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 859,970.13 | -766,363.19 |
| 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 | 34,601,831.68 | 9,879,605.14 |
| 1、管理人报酬 | 11,045,725.01 | 3,404,028.19 |
| 2、托管费 | 1,636,403.78 | 504,300.47 |
| 3、销售服务费 | 10,227,523.13 | 3,151,877.97 |
| 4、交易费用 | - | - |
| 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 | 225,636.76 | 225,866.18 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 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 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 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 |

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《关于进一步明确金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 关联方关系

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

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 汇添富基金管理股份有限公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司"浦发银行" | 基金托管人、基金代销机构 |
| 东方证券股份有限公司"东方证券" | 基金管理人的股东、基金代销机构 |

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

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。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 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 | |
|---|---|---|---|---|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 东方证券股份有限公司 | 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。

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日