汇添富货币市场基金 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

基金名称	汇添富货币市场基金
基金简称	汇添富货币
基金主代码	519518
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年3月23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	19,623,616,197.93份
基金合同存续期	不定期

下属分级基金的基金简称	下属分级基金的交易代码	报告期末下属分级基金的份额总额
汇添富货币A	519518	228,813,596.15份
汇添富货币B	519517	12,684,723,184.66份
汇添富货币C	000642	2,995,466,322.33份
汇添富货币D	000650	3,714,613,094.79份

2.2 基金产品说明

投资目标	力求本金稳妥和基金资产高流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。
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	税后活期存款利率(即活期存款利率×(1-利息税率))。
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。

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

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

基金级别	3.1.1期间数据和指标	本期已实现收益	本期利润	本期净值收益率
汇添富货币A	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	3,986,400.01	3,986,400.01	2.0176%
汇添富货币B	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	200,579,755.79	200,579,755.79	2.1388%
汇添富货币C	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	81,661,793.48	81,661,793.48	2.0176%
汇添富货币D	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	54,802,222.24	54,802,222.24	2.0176%

基金级别	3.1.2期末数据和指标	期末基金资产净值	期末基金份额净值
汇添富货币A	报告期末(2018年6月30日)	228,813,596.15	1.0000
汇添富货币B		12,684,723,184.66	1.0000
汇添富货币C		2,995,466,322.33	1.0000
汇添富货币D		3,714,613,094.79	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。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。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(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

汇添富货币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	0.3262%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.2974%	0.0003%
过去三个月	0.9999%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.9126%	0.0008%
过去六个月	2.0176%	0.0010%	0.1736%	0.0000%	1.8440%	0.0010%
过去一年	3.9262%	0.0010%	0.3503%	0.0000%	3.5759%	0.0010%
过去三年	9.5732%	0.0021%	1.0540%	0.0000%	8.5192%	0.0021%
自基金合同生效日起至今	46.3656%	0.0063%	12.3810%	0.0031%	33.9846%	0.0032%

汇添富货币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	0.3460%	0.0004%	0.0288%	0.0000%	0.3172%	0.0004%
过去三个月	1.0602%	0.0009%	0.0873%	0.0000%	0.9729%	0.0009%
过去六个月	2.1388%	0.0010%	0.1736%	0.0000%	1.9652%	0.0010%
过去一年	4.1758%	0.0010%	0.3503%	0.0000%	3.8255%	0.0010%
过去三年	10.3661%	0.0021%	1.0540%	0.0000%	9.3121%	0.0021%
自基金合同生效日起至今	46.9529%	0.0064%	9.8591%	0.0031%	37.0938%	0.0033%

汇添富货币C

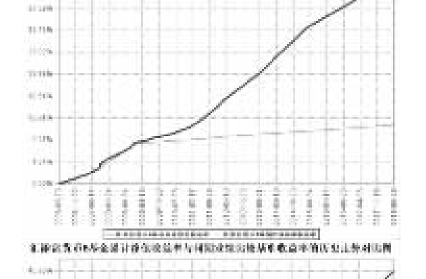
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3262%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.2974%	0.0003%
过去三个月	0.9999%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.9126%	0.0008%
过去六个月	2.0176%	0.0010%	0.1736%	0.0000%	1.8440%	0.0010%
过去一年	3.9262%	0.0010%	0.3503%	0.0000%	3.5759%	0.0010%
过去三年	9.5732%	0.0021%	1.0540%	0.0000%	8.5192%	0.0021%
自基金合同生效日起至今	14.3206%	0.0029%	1.4319%	0.0000%	12.8887%	0.0029%

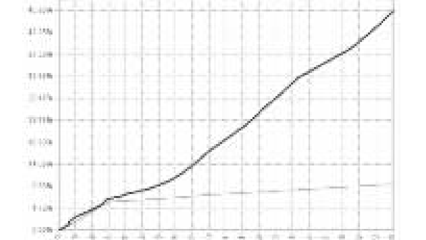
汇添富货币D

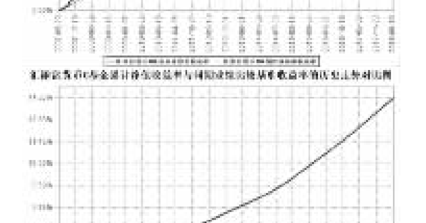
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3262%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.2974%	0.0003%
过去三个月	0.9999%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.9126%	0.0008%
过去六个月	2.0176%	0.0010%	0.1736%	0.0000%	1.8440%	0.0010%
过去一年	3.9262%	0.0010%	0.3503%	0.0000%	3.5759%	0.0010%
过去三年	9.5732%	0.0021%	1.0540%	0.0000%	8.5192%	0.0021%
自基金合同生效日起至今	14.3201%	0.0029%	1.4319%	0.0000%	12.8882%	0.0029%

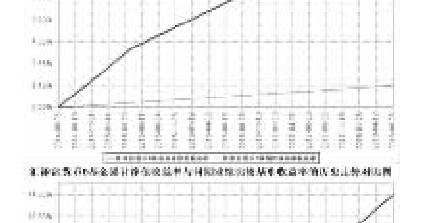
注:2012年8月21日,本基金收益分配由按月结转份额改为按日结转份额。

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、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2006年3月23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。

2、本基金从本《基金合同》生效之日起至2009年2月15日采用的业绩比较基准为同期税后一年定期存款利率。从2009年2月16日起,本基金业绩比较基准为同期税后活期存款利率。

§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发起式证券投资基金(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:任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
蒋文玲	汇添富货币基金、现金宝货币基金、添富通货币基金、实业债债券基金、优选回报混合基金、汇添富鑫益定开债基金、添富年年益定开混合、添富鑫汇定开债券基金的基金经理,汇添富多元收益债券基金的基金经理助理。	2016年6月7日	-	12年	国籍:中国。学历:上海财经大学经济学硕士。业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员。2012年11月30日至2014年1月7日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理。2014年1月加入汇添富基金,历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理。2014年4月8日至今任汇添富多元收益债券基金的基金经理助理,2015年3月10日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富优选回报混合基金(原理财21天债券基金)的基金经理,2015年3月10日至2018年5月4日任汇添富理财14天债券基金的基金经理,2016年6月7日至今任汇添富货币基金、添富通货币基金、实业债债券基金的基金经理,2016年6月7日至2018年5月4日任理财30天债券基金、理财60天债券基金的基金经理,2017年4月20日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理,2017年5月15日至今任添富年年益定开混合基金的基金经理,2017年6月23日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理。
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天债券基金经理。	2018年5月4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。
温开强	汇添富现金宝货币、汇添富添富通货币、汇添富货币、汇添富理财14天债券、汇添富理财30天债券、汇添富理财60天债券基金的基金经理助理	2016年8月30日	-	6年	国籍:中国,学历:天津大学管理学硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格、CFA。从业经历:曾任长城基金债券交易员、中金基金交易主管,高级经理,2016年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,2016年8月30日至今任汇添富现金宝货币、汇添富添富通货币、汇添富货币、汇添富理财14天债券、汇添富理财30天债券、汇添富理财60天债券基金的基金经理助理。

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、本基金的基金经理蒋文玲女士于2017年8月21日起休产假,无法正常履行职务。依据法律法规及公司制度规定,本公司研究决定,蒋文玲女士休假期间,本基金的投资管理工作由基金经理徐寅喆女士代为履行职责。本基金管理人已于2017年8月18日就上述事项进行公告。

蒋文玲女士已于2018年1月30日结束休假,恢复履行本基金的基金经理职务。本基金管理人已于2018年2月1日就上述事项进行公告。

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

2018年上半年债券市场各期限收益率普遍大幅下行,高评级债券下行幅度好于低评级债券。债券市场的回暖来自于经济基本面、流动性环境等多重利好因素的叠加。经济基本面情况方面,2018年上半年GDP增长6.8%,持平于去年下半年,但分季度分析,二季度增长6.7%,相比一季度的6.8%轻微下行。在防风险去杠杆政策的影响下,今年以来的地方政府债务问题得到整治,金融机构过去多年发展的非标业务出现明显压缩,全社会面临信用收缩问题。从数据上看,上半年固定资产投资累计增长仅6%,并且基建和地产均有明显回落趋势。消费上半年社会零售增长9.4%,相比一季度的9.8%也是出现回落。社会融资方面,最新6月份全社会融资在传统贷款大幅增量的情况下,社融增量仅1.18万亿,社融余额增速降至9.8%的历史新低。流动性方面,今年以来货币政策接连发生重大转向。央行于4月份意外降准,6月下旬再次定向降准。在二季度货币政策执行报告中正式明确流动性从"合理稳定"转为"合理充裕"。今年以来,银行间流动性宽松态势普遍超出市场机构的预期。经历传统春节因素、CRA退出和季末MPA考核等关键时点,银行间市场流动性都并未受到明显的冲击。在这些利好因素刺激下,今年上半年债券市场明显回暖,各期限收益率波动下行。10年国债收益率从最高3.98%下探至3.48%,10年国开债收益率更是从最高5.13%下降至4.25%。短端方面,国有股份制银行3M期限存单从年初5.0%降至4月份的3.7%后反弹至5月底的4.55%,6月底再降至3.8%。

本基金上半年组合规模有所增加。针对市场流动性环境的变化,组合投资操作上采取较为进取的策略,努力为基金持有人获取更好的投资收益。整体思路是以拉长组合剩余天数和提高杠杆水平为主,同时对组合债券比例和期限结构进行灵活调整。一季度积极进行存单的配置操作,4月份考虑到收益率的快速大幅下行后适当进行减仓。在5月和6月加大了存款存单的配置比例。另外,考虑利差水平,短融和超短融的价值显现,组合适度提高该类资产的配置比例。债券选择方面,以AAA主体评级为主,规避信用风险。存款合作银行方面,按照公司内部额度管理制度,降低单家存款银行的集中度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富货币A基金份额净值为1.0000元,本报告期基金份额净值增长率为2.0176%;截至本报告期末汇添富货币B基金份额净值为1.0000元,本报告期基金份额净值增长率为2.1388%;截至本报告期末汇添富货币C基金份额净值为1.0000元,本报告期基金份额净值增长率为2.0176%;截至本报告期末汇添富货币D基金份额净值为1.0000元,本报告期基金份额净值增长率为2.0176%;同期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

进入下半年,债券市场的利好因素有望延续。宏观经济的下行压力难以有效缓解,原因主要有两点:其一,中美贸易战已扩大化,特朗普推出反全球化的贸易霸凌主义政策短期不会结束。这对今年的出口构成明显压力。其二,国内防风险去杠杆政策棋至半局。国内融资环境大幅收紧,信用收缩的局面短期内难以彻底逆转。货币政策方面,为缓解信用收缩压力,防止去杠杆引发的风险,货币条件有望继续放松,下半年市场流动性可能更加充裕。监管方面,《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》已正式落地,相比此前的征求意见稿在过渡期和部分指标的计算上有所放松。后续相应的配套细则制度将陆续出台,需要密切进行关注。

根据货币基金的监管要求,本基金始终坚持货币市场基金作为流动性管理工具的定位,在保障组合流动性安全的情况下,努力为基金持有人争取更好的收益。具体操作上,针对流动性环境的变化,投资策略更加灵活进取,在杠杆水平、组合期限、现券比例等方面灵活调整。资产配置上根据类属资产的收益情况合理配置回购、同业存款、同业存单、短融和利率债的比例。

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》以及中国证券投资基金业协会颁布的《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:本基金每日计算投资人帐户当日所产生的收益,每月将投资人帐户累计的收益结转为基金份额,计入该投资人帐户的基金份额中。

2018年1月1日至2018年6月30日期间累计分配收益341,030,171.52元,均为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	11,184,049,850.21	4,671,609,714.38
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	5,844,547,480.18	4,040,630,892.37
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	5,844,547,480.18	4,040,630,892.37
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	2,738,400,176.20	1,442,163,083.24
应收证券清算款	-	158,081,098.67
应收利息	106,975,580.13	51,500,399.74
应收股利	-	-
应收申购款	77,177,136.69	31,075,302.97
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	19,951,150,223.41	10,395,060,491.37
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	169,987,795.01	99,989,730.01
应付证券清算款	150,000,000.00	-
应付赎回款	91,310.69	5,616.81
应付管理人报酬	2,717,606.28	2,544,461.28
应付托管费	905,868.75	789,630.08
应付销售服务费	1,843,956.95	1,207,614.24
应付交易费用	110,201.06	80,240.82
应交税费	1,517,993.79	1,462,671.04
应付利息	29,942.78	49,512.63
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	329,350.17	409,311.03
负债合计	327,534,025.48	106,538,787.94
所有者权益:		
实收基金	19,623,616,197.93	10,288,521,703.43
未分配利润	-	-
所有者权益合计	19,623,616,197.93	10,288,521,703.43
负债和所有者权益总计	19,951,150,223.41	10,395,060,491.37

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19,623,616,197.93份,其中下属A级基金份额总额228,813,596.15份;下属B级基金份额总额12,684,723,184.66份;下属C级基金份额总额2,995,466,322.33份;下属D级基金份额总额3,714,613,094.79份。

6.2 利润表

会计主体:汇添富货币市场基金

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	369,079,564.99	125,674,298.70
1.利息收入	377,337,025.03	127,078,386.14
其中:存款利息收入	191,032,635.05	95,099,563.99
债券利息收入	150,789,898.63	30,222,726.31
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	35,514,491.35	1,756,095.84
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-8,311,310.07	-1,477,799.27
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-8,311,310.07	-1,477,799.27
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)	53,850.03	73,711.83
减:二、费用	28,049,393.47	21,184,771.37
1. 管理人报酬	12,265,341.97	10,007,657.91
2. 托管费	4,088,447.32	3,032,623.60
3. 销售服务费	9,180,415.09	6,046,620.96
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	2,228,613.97	1,846,342.78
其中:卖出回购金融资产支出	2,228,613.97	1,846,342.78
6. 税金及附加	28,116.12	-
7. 其他费用	258,459.00	251,526.12
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	341,030,171.52	104,489,527.33

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富货币市场基金

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)	10,288,521,703.43	-	10,288,521,703.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	341,030,171.52	341,030,171.52
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)	9,335,094,494.50	-	9,335,094,494.50
其中:1.基金申购款	75,044,597,757.76	-	75,044,597,757.76
2.基金赎回款	-65,709,503,263.26	-	-65,709,503,263.26
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)	-	-341,030,171.52	-341,030,171.52
五、期末所有者权益(基金净值)	19,623,616,197.93	-	19,623,616,197.93

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)	4,804,830,775.69	-	4,804,830,775.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	104,489,527.33	104,489,527.33
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)	1,461,227,631.05	-	1,461,227,631.05
其中:1.基金申购款	55,222,814,926.39	-	55,222,814,926.39
2.基金赎回款	-53,761,587,295.34	-	-53,761,587,295.34
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)	-	-104,489,527.33	-104,489,527.33
五、期末所有者权益(基金净值)	6,266,058,406.74	-	6,266,058,406.74

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[2006]21号文《关于核准汇添富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有限公司(现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2006年3月23日正式生效,首次设立募集规模为4,104,914,022.13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为汇添富基金管理股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司和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。

2007年5月22日,本基金按照500万份基金份额的界限划分为A级基金份额和B级基金份额,单一持有人持有500万份基金份额以下的为A级,达到或超过500万份的为B级。本基金份额分级规则于分级日起生效。基金分级后,当份额持有人在单个基金账户保留的基金份额减少至500万份以下时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金帐户持有的B级基金份额降级为A级基金份额;相应地,当达到或超过500万份时,A级基金份额自动升级为B级基金份额。两级基金份额单独计算及公布基金日收益和基金七日收益率。

自2014年6月5日起本基金增设C级基金份额和D级基金份额。增设基金份额后,本基金将分设A级基金份额、B级基金份额、C级基金份额和D级基金份额。其中A级、B级基金份额可通过场内、场外两种方式交易,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,单一持有人持有500万份基金份额以下的为A级基金份额,达到或超过500万份的为B级基金份额;C级基金份额仅开通场外申赎,注册登记机构为汇添富基金管理股份有限公司,不进行基金份额升降级;D级基金份额仅开通场外申赎,销售机构为上海浦东发展银行股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,不进行基金份额升降级。本基金A级份额和B级份额基金收益为"每日分配,按月支付",C级份额和D级份额基金收益为"每日分配,按日支付"。各级基金份额单独设置基金代码,并单独公布各级基金每万份基金净收益和七日年化收益率。

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括:现金;通知存款;一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券;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;短期融资券及中国证监会、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。本基金的业绩比较基准为:税后活期存款利率即(活期存款利率×(1-利息税率))。

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 营业税、增值税

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,继续免征营业税;

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征增值税试点的通知》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]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定,2017年7月1日(含)以后,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,按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7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]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,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。

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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利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:本基金本报告期及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: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	190,000,000.00	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:本基金本期及上年度可比期间均未有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	12,265,341.97	10,007,657.91
其中:支付销售机构的客户维护费	683,442.64	596,808.51

注:自2006年3月23日(基金合同生效日)至2017年12月18日前,基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%年费率计提;于2017年12月18日起,基金管理费按前一日的基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.15%÷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

基金管理费在基金合同生效后每日计提,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5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、休息日等,支付日期顺延。

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	4,088,447.32	3,032,623.60

注:自2006年3月23日(基金合同生效日)至2017年12月18日前,基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%年费率计提;于2017年12月18日起,基金托管费按前一日的基金资产净值的0.05%年费率计提。

计算方法如下:

H=E×0.05%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费在基金合同生效后每日计提,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5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

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:汇添富货币A	汇添富货币B	汇添富货币C	汇添富货币D	合计
东方证券股份有限公司	14,060.16	787.26	5,072,269.80	-	5,087,117.22
上海浦东发展银行股份有限公司	11,623.94	926.17	-	3,391,567.61	3,404,117.72
汇添富基金管理股份有限公司	41,933.00	456,064.06	-	-	497,997.06
合计	67,617.10	457,777.49	5,072,269.80	3,391,567.61	8,989,232.00

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 当期发生的基金应支付的销售服务费:汇添富货币A	汇添富货币B	汇添富货币C	汇添富货币D	合计
东方证券股份有限公司	12,178.47	4,426.09	4,486,660.23	-	4,503,264.79
上海浦东发展银行股份有限公司	12,253.11	-	-	1,249,881.67	1,262,134.78
汇添富基金管理股份有限公司	68,407.62	49,252.19	4,729.70	-	122,389.51
合计	92,839.20	53,678.28	4,491,389.93	1,249,881.67	5,887,789.08

注:基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用,由基金管理人支配使用。

本基金各级基金份额按照不同的费率计提销售服务费,但各级基金份额的销售服务费率均不超过0.25%年费率,A级基金份额、B级基金份额、C级基金份额和D级基金份额的约定年费率分别为0.25%、0.01%、0.25%和0.25%。各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

H=E×R÷当年天数

H为各级基金份额每日应计提的销售服务费

E为前一日该级基金份额的基金资产净值

R为该级基金份额的销售服务费率

各级基金份额的销售服务费在基金合同生效后每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首5个工作日内从基金财产中一次性划往登记机构账户。由基金管理人支付给各销售机构,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

6.4.8.3 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期2018年1月1日至2018年6月30日 债券交易金额:基金买入	基金卖出	基金逆回购:交易金额	利息收入	基金正回购:交易金额	利息支出
上海浦东发展银行	-	-	202,740,000.00	777,632.88	1,313,915,000.00	285,237.50

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间2017年1月1日至2017年6月30日 债券交易金额:基金买入	基金卖出	基金逆回购:交易金额	利息收入	基金正回购:交易金额	利息支出
上海浦东发展银行	-	-	-	-	461,954,000.00	91,658.13

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

汇添富货币B

份额单位:份

关联方名称	本期末2018年6月30日:持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末2017年12月31日:持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
东方证券股份有限公司	50,386,590.04	0.2568%	0.00	0.0000%

注:东方证券股份有限公司于2018年3月29日申购本基金份额50,000,000.00份,申购费用0。符合招募说明书规定的申购费率。

6.4.8.5 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2018年1月1日至2018年6月30日:期末余额	当期利息收入	上年度可比期间2017年1月1日至2017年6月30日:期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	2,590,049,850.21	17,777,288.30	104,071,246.33	2,017,851.69

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本期及上年度可比期间在承销期内未有参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3.1 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169,987,795.01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
180201	18国开01	2018年7月2日	100.09	1,868,000	186,973,435.31
合计				1,868,000	186,973,435.31

-

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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	5,844,547,480.18	29.29
	其中:债券	5,844,547,480.18	29.29
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,738,400,176.20	13.73
	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	11,184,049,850.21	56.06
4	其他各项资产	184,152,716.82	0.92
5	合计	19,951,150,223.41	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	0.79
	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	169,987,795.01	0.87
	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	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	49

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	24.80	1.63
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.20	-
2	30天(含)—60天	9.76	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	39.83	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	3.94	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)	22.40	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
	合计	100.73	1.63

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:报告期内投资组合平均剩余存续期无超过240天情况

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	1,417,492,061.20	7.22
	其中:政策性金融债	1,417,492,061.20	7.22
4	企业债券	739,868,540.07	3.77
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,687,186,878.91	18.79
8	其他	-	-
9	合计	5,844,547,480.18	29.78
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	39,177,838.20	0.20

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	180404	18农发04	4,100,000	410,642,641.59	2.09
2	111898463	18宁波银行CD106	3,000,000	297,556,527.09	1.52
3	111811160	18平安银行CD160	3,000,000	297,510,367.61	1.52
4	180201	18国开01	2,300,000	230,213,544.55	1.17
5	111808158	18中信银行CD158	2,000,000	198,395,070.92	1.01
6	111815262	18民生银行CD262	2,000,000	198,340,282.56	1.01
7	111815271	18民生银行CD271	2,000,000	198,238,351.92	1.01
8	111898934	18盛京银行CD220	2,000,000	198,204,330.18	1.01
9	111814097	18江苏银行CD097	2,000,000	195,905,616.87	1.00
10	011800615	18中电投SCP007	1,800,000	180,002,406.77	0.92

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	0.1411%
报告期内偏离度的最低值	0.0374%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0743%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:本基金本报告期内负偏离度的绝对值无达到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:本基金本报告期内偏离度的绝对值无达到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前十名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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	106,975,580.13
4	应收申购款	77,177,136.69
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	184,152,716.82

§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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者:持有份额	占总份额比例	个人投资者:持有份额	占总份额比例
汇添富货币A	11,612	19,704.93	35,250,653.25	15.41%	193,562,942.90	84.59%
汇添富货币B	81	156,601,520.80	12,624,295,763.59	99.52%	60,427,421.07	0.48%
汇添富货币C	29,600	101,198.19	195,042,014.74	6.51%	2,800,424,307.59	93.49%
汇添富货币D	448,368	8,284.74	56,515.70	0.00%	3,714,556,579.09	100.00%
合计	489,661	40,075.92	12,854,644,947.28	65.51%	6,768,971,250.65	34.49%

8.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富货币A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	上海犇牛投资管理有限公司-犇牛优势市场配置1号私募投资基金	3,000,000.05	19.35%
2	马晓健	1,061,400.89	6.85%
3	岑淑华	908,595.91	5.86%
4	杨文明	793,781.62	5.12%
5	黄蓍	713,767.41	4.60%
6	沈仲南	688,088.65	4.44%
7	安庆	628,467.75	4.05%
8	徐培青	510,167.45	3.29%
9	徐高豪	469,531.12	3.03%
10	北京小强趋势投资管理有限公司-小强黄埔三期私募基金	412,385.91	2.66%

8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	银行类机构	1,021,082,493.64	5.20%
2	其他机构	1,017,716,664.54	5.19%
3	银行类机构	1,000,000,000.00	5.10%
4	银行类机构	961,152,283.39	4.90%
5	银行类机构	605,362,529.20	3.08%
6	银行类机构	506,170,658.27	2.58%
7	其他机构	403,705,814.41	2.06%
8	银行类机构	403,202,607.26	2.05%
9	银行类机构	402,163,130.41	2.05%
10	其他机构	400,465,146.57	2.04%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富货币A	5,177.40	0.00%
	汇添富货币B	0.00	0.00%
	汇添富货币C	0.00	0.00%
	汇添富货币D	10,000.88	0.00%
	合计	15,178.28	0.00%

8.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富货币A	0
	汇添富货币B	0
	汇添富货币C	0
	汇添富货币D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富货币A	0
	汇添富货币B	0
	汇添富货币C	0
	汇添富货币D	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	基金合同生效日(2006年3月23日)基金份额总额	本报告期期初基金份额总额	本报告期基金总申购份额	减:本报告期基金总赎回份额	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
汇添富货币A	4,104,914,022.13	180,013,307.97	338,755,092.68	289,954,804.50	-	228,813,596.15
汇添富货币B	-	6,307,073,625.99	19,992,376,669.10	13,614,727,110.43	-	12,684,723,184.66
汇添富货币C	-	2,044,995,401.13	45,786,406,451.49	44,835,935,530.29	-	2,995,466,322.33
汇添富货币D	-	1,756,439,368.34	8,927,059,544.49	6,968,885,818.04	-	3,714,613,094.79

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

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灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,由杨瑨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,杨瑨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:成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金:佣金	占当期佣金总量的比例	备注
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:成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易:成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易:成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	190,000,000.00	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:本基金本报告期末发生偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§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。

汇添富基金管理股份有限公司

2018年8月25日