华泰柏瑞天添宝货币市场基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:江苏银行股份有限公司
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及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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞天添宝货币	
基金主代码	002246	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年9月22日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	25,969,785,570.45份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞天添宝货币A级	华泰柏瑞天添宝货币B级
下属分级基金的交易代码:	002246	003871
报告期末下属分级基金的份额总额	5,101,001,966.81份	20,868,783,603.64份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力争保持基金资产安全和流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的稳健投资收益。
投资策略	本基金将采用主动的投资管理策略对短期货币市场工具进行投资,在投资中将充分利用现代金融工程理论以及数量分析方法来提高投资决策的及时性与合理性,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上,获得稳健的投资收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为当期银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属于证券投资基金较高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

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		华泰柏瑞基金管理有限公司	江苏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	柯振林
	联系电话	021-38601777	025-58588217
	电子邮箱	cs400880000@huatai-pb.com	kezhenlin@jsbchina.cn
客户服务电话		400-888-0001	95319
传真		021-38601799	025-58588155

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	http://www.huatai-pb.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§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

基金级别	华泰柏瑞天添宝货币A级	华泰柏瑞天添宝货币B级
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	137,370,320.75	348,074,338.04
本期利润	137,370,320.75	348,074,338.04
本期净值收益率	2.1399%	2.2615%
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	5,101,001,966.81	20,868,783,603.64
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

金额单位:人民币元

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

华泰柏瑞天添宝货币A级

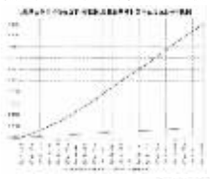
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3296%	0.0006%	0.0292%	0.0000%	0.2994%	0.0006%
过去三个月	1.0307%	0.0007%	0.0885%	0.0000%	0.9422%	0.0007%
过去六个月	2.1399%	0.0012%	0.1760%	0.0000%	1.9639%	0.0012%
过去一年	4.3490%	0.0014%	0.3549%	0.0000%	3.9941%	0.0014%
自基金合同生效起至今	7.0987%	0.0022%	0.6290%	0.0000%	6.4697%	0.0022%

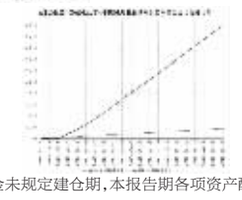
华泰柏瑞天添宝货币B级

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	0.3486%	0.0006%	0.0292%	0.0000%	0.3194%	0.0006%
过去三个月	1.0914%	0.0007%	0.0885%	0.0000%	1.0029%	0.0007%
过去六个月	2.2615%	0.0012%	0.1760%	0.0000%	2.0855%	0.0012%
过去一年	4.5992%	0.0014%	0.3549%	0.0000%	4.2443%	0.0014%
自基金合同生效起至今	7.0357%	0.0019%	0.6290%	0.0000%	6.4067%	0.0019%

注:本基金于2016年11月23日新增B类份额,上述A类指标计算日期为2016年9月22日至2018年6月30日, 上述B类指标计算日期为2016年11月23日至2018年6月30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、本基金未规定建仓期,本报告期各项资产配置比例符合合同约定。

2、本基金的收益分配是按日结转份额。

3、本基金于2016年11月23日新增B类份额,上述A类指标计算日期为2016年9月22日至2018年6月30日, 上述B类指标计算日期为2016年11月23日至2018年6月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准, 于2004年11月18日成立的合资基金管理公司,注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司(原AIGGIC)和苏州新区高新技术产业股份有限公司,出资比例分别为49%、49%和2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选30灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金。截至2018年6月30日,公司基金管理规模为886.17亿元。

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		
郑青	固定收益部副总监,本基金的基金经理	2016年9月22日	-	13年	13年证券(基金)从业经验,经济学硕士。曾任职于国信证券股份有限公司、平安资产管理有限责任公司,2008年3月至2010年4月任中海基金管理有限公司交易员,2010年加入华泰柏瑞基金管理有限公司,任债券研究员。2012年6月起任华泰柏瑞货币市场证券投资基金经理。2013年7月至2017年11月任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金的基金经理。2015年1月起任固定收益部副总监。2015年7月起任华泰柏瑞交易型货币市场证券投资基金的基金经理。2016年9月起任华泰柏瑞天添宝货币市场基金的基金经理。

注: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。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

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, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定,在严格控制风险的基础上,忠实履行基金管理职责,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定,不存在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,公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离,实行集中交易制度,由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务,为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况,不同业务类别的投资经理之间互不干扰,独立做出投资决策。公司机构设置合理,公平交易的相关管理制度健全,投资决策流程完善,各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待,不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现,报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查, 交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制,风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内,该制度执行情况良好,无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中,均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5%的同日反向交易。

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,尽管宏观经济展现出一定的韧性,但是市场预期转差,实体经济开始出现信用风险事件,金融机构出现风险偏好的回落。另一方面关于中美贸易方面的冲突在逐渐升级, 双方虽然开启了磋商,但是并没有达到共识, 美国仍然宣布对中国出口的2000亿美金产品征收关税,进一步强化了悲观预期。作为对冲,央行于4月17日和6月24日分别降准1%和0.5%,在宽货币紧信用的环境下,债券利率显著回落,备受市场关注的同业存单利率虽然由于银行跨季的需求而呈现季节性的上升,但是利率高点也呈现逐季下降的趋势。以3个月股份制银行存单利率为例:一季度的高点达到过4.9%,但是二季度高点为4.55%。此外,6月最后一个工作日当天的R007利率为3.58%而一季末为4.19%,这也表明货币市场明显转松。在此过程中,华泰柏瑞天添宝把握时机增加了3个月及以上期限的存款和存单的配置,并在6月底前适当加了杠杆。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期华泰柏瑞天添宝货币A级的基金份额净值收益率为2.1399%, 本报告期华泰柏瑞天添宝货币B级的基金份额净值收益率为2.2615%,同期业绩比较基准收益率为0.1760%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,国内的宏观经济短期面临较大压力:中美贸易摩擦还可能继续。信用风险事件贫发,金融机构风险偏好显著回落。地方政府融资平台不透明的债务风险在逐渐暴露。根据信托业协会的数据,今年下半年非标的到期量为3.1万亿,近期监管开始调查地方政府债务问题,未来不排除会出现第二轮债务置换。因为,未来货币环境仍有必要保持宽松,银行的资金出于避险需求将会增加货币基金和同业存单的配置, 因此1年期以内的短端利率将维持在较低的水平,尽管季节性的缴税等因素会使资金利率出现波动,但波动幅度有限,对货币基金而言,应抓住波动时点进行配置。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,基金管理人严格执行基金估值控制流程,定期评估估值技术的合理性,每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人,基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定,本基金收益根据每日基金收益公告,以每万份基金已实现收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,计入投资人收益账户。本基金在本报告期共支付 485,444,658.79元基金收益并结转为基金份额。

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

注: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

在托管华泰柏瑞天添宝货币市场基金的过程中,本基金托管人—江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《华泰柏瑞天添宝货币市场基金基金合同》、《华泰柏瑞天添宝货币市场基金托管协议》的约定,对华泰柏瑞天添宝货币市场基金的基金管理人—华泰柏瑞基金管理有限公司2018年上半年度基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,华泰柏瑞基金管理有限公司在华泰柏瑞天添宝货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、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问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,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

本托管人认为, 华泰柏瑞基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的华泰柏瑞天添宝货币市场基金的年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:华泰柏瑞天添宝货币市场基金

报告截止日: 2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		13,351,230,951.14	9,802,292,299.48
结算备付金		9,038,636.36	9,540,909.08
存出保证金		31,680.96	-
交易性金融资产		11,646,731,594.89	5,040,762,855.29
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		11,308,628,611.23	5,040,762,855.29
资产支持证券投资		338,102,983.66	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		4,683,424,625.15	1,833,954,045.86
应收证券清算款		-	186,509,683.89
应收利息		131,392,493.19	84,770,586.89
应收股利		-	-
应收申购款		9,830,895.15	45,411.93
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		29,831,680,876.84	16,957,875,792.32
负债和所有者权益	附注号	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		3,048,855,387.14	1,478,821,900.62
应付证券清算款		800,000,000.00	-
应付赎回款		2,067,264.86	658,102.00
应付管理人报酬		3,878,322.12	2,573,753.64
应付托管费		1,020,611.07	677,303.57
应付销售服务费		1,344,264.72	1,172,294.12
应付交易费用		394,899.16	175,749.76
应交税费		145,065.46	-
应付利息		806,634.43	533,054.86
应付利润		3,274,702.24	2,209,359.85
递延所得税负债		-	-
其他负债		108,155.19	129,071.28
负债合计		3,961,895,306.39	1,486,950,589.70
所有者权益:			
实收基金		25,969,785,570.45	15,470,925,202.62
未分配利润		-	-
所有者权益合计		25,969,785,570.45	15,470,925,202.62
负债和所有者权益总计		29,831,680,876.84	16,957,875,792.32

注:报告截止日2018年6月30日,华泰柏瑞天添宝货币A级基金份额净值1.0000元,基金份额总额5,101,001,966.81份;华泰柏瑞天添宝货币B级基金份额净值1.0000元,基金份额总额20,868,783,603.64份。华泰柏瑞天添宝货币份额总额合计为25,969,785,570.45份。

6.2 利润表

会计主体:华泰柏瑞天添宝货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 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		550,508,483.97	73,705,675.72
1.利息收入		552,364,696.67	73,987,133.34
其中:存款利息收入	6.4.7.11	310,960,397.45	42,051,891.73
债券利息收入		188,876,983.77	24,094,182.54
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		52,527,315.45	7,840,359.07
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-1,856,212.70	-281,457.62
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,856,212.70	-281,457.62
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	-	-
减:二、费用		65,063,825.18	10,955,665.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	20,829,296.46	3,610,289.43
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,481,393.76	882,173.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	8,824,949.66	1,064,000.34
4. 交易费用	6.4.7.19	90,507.30	30,410.00
5. 利息支出		29,656,775.38	5,297,524.83
其中:卖出回购金融资产支出		29,656,775.38	5,297,524.83
6. 税金及附加		63,218.71	-
7. 其他费用	6.4.7.20	117,683.91	71,267.49
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		485,444,658.79	62,750,010.45
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		485,444,658.79	62,750,010.45

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华泰柏瑞天添宝货币市场基金

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)	15,470,925,202.62	-	15,470,925,202.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	485,444,658.79	485,444,658.79
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)	10,498,860,367.83	-	10,498,860,367.83
其中:1.基金申购款	44,078,208,561.33	-	44,078,208,561.33
2.基金赎回款	-33,579,348,193.50	-	-33,579,348,193.50
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)	-	-485,444,658.79	-485,444,658.79
五、期末所有者权益(基金净值)	25,969,785,570.45	0.00	25,969,785,570.45
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)	1,740,821,971.44	-	1,740,821,971.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	62,750,010.45	62,750,010.45
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)	4,521,398,525.18	-	4,521,398,525.18
其中:1.基金申购款	9,154,965,365.22	-	9,154,965,365.22
2.基金赎回款	-4,633,566,840.04	-	-4,633,566,840.04
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)	-	-62,750,010.45	-62,750,010.45
五、期末所有者权益(基金净值)	6,262,220,496.62	-	6,262,220,496.62

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:

韩 勇 房 伟 力 赵景云

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

华泰柏瑞天添宝货币市场基金(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")证监基金字[2016]第1838号《关于准予华泰柏瑞天添宝货币市场基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞天添宝货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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201,930,396.50元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1237号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞天添宝货币市场基金基金合同》于2016年9月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为201,930,396.50份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为江苏银行股份有限公司。

根据本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司2016年11月23日《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞天添宝货币市场基金增加B类份额并修改基金合同的公告》的规定,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,自2016年11月23日起对本基金增加B类份额并相应修改基金合同。本基金原有的基金份额类别更名为A类基金份额,新增的基金份额类别命名为B类基金份额。A类基金份额的业务规则与现行规则相同;新增B类基金份额的注册登记机构为华泰柏瑞基金管理有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞天添宝货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金;期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:当期银行活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2018年8月25日批准报出。

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》、《华泰柏瑞天添宝货币市场基金 基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

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1月1日至2018年6月30日止期间的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1月1日至2018年6月30日止期间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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[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
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金直销机构、基金份额的注册登记机构
江苏银行股份有限公司("江苏银行")	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司("柏瑞爱建资产")	基金管理人的控股子公司

注:关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

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:本基金本报告期内与上年度可比期间未进行股票交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注:无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期与上年度可比期间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	20,829,296.46	3,610,289.43
其中:支付销售机构的客户维护费	155,419.15	8,586.38

注:支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的适用年费率计提,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×适用年费率/ 当年天数。

2016年9月22日(基金合同生效日)至2017年5月7日,管理人报酬的适用年费率为0.30%,自2017年5月8日起适用年费率为0.19%。

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	5,481,393.76	882,173.18

注:支付基金托管人江苏银行的托管费按前一日基金资产净值的适用年费率计提,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×适用年费率/ 当年天数。

2016年9月22日(基金合同生效日)至2017年5月7日,托管人报酬的适用年费率为0.07%,自2017年5月8日起适用年费率为0.05%。

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		
	华泰柏瑞天添宝货币A级	华泰柏瑞天添宝货币B级	合计
江苏银行股份有限公司	6,209.92	0.00	6,209.92
华泰证券股份有限公司	57,073.69	2,506.43	59,580.12
华泰柏瑞基金管理有限公司	7,617,680.79	771,394.25	8,389,075.04
合计	7,680,964.40	773,900.68	8,454,865.08
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		
	华泰柏瑞天添宝货币A级	华泰柏瑞天添宝货币B级	合计
江苏银行股份有限公司	112,261.12	0.00	112,261.12
华泰证券股份有限公司	349.33	0.00	349.33
华泰柏瑞基金管理有限公司	837,574.98	107,824.06	945,399.04
合计	950,185.43	107,824.06	1,058,009.49

注:本基金A类基金份额应支付销售机构的销售服务费,按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提,B类基金份额应支付销售机构的销售服务费,按前一日基金资产净值的0.01%的年费率计提,计算方法如下:

H = E × 年费率(A类0.25%,B类0.01%) ÷ 当年天数

H为每日A类或B类基金份额应支付的销售服务费

E为前一日的A类或B类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人支付给各基金销售机构。

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

本期 2018年1月1日至2018年6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
江苏银行	197,814,786.67	-	-	-	399,896,000.00	30,676.88
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6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