华宝海外中国成长混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9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
报告送出日期：2018年10月26日

§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责任。

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10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝海外中国混合	
基金主代码	241001	
交易代码	241001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年5月7日	
报告期末基金份额总额	293,325,989.35份	
投资目标	主要投资于海外上市的中国公司的股票，在全球资本市场分享中国经济增长，追求资本长期增值。	
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。本基金各类资产配置的比例范围为：股票占基金资产总值的60%-95%，债券和其他资产占基金资产总值的5%-40%。	
业绩比较基准	中证海外内地指数。	
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。	
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	
境外投资顾问	英文名称：-	
	中文名称：-	
境外资产托管人	英文名称：The Bank of New York Mellon Corporation	
	中文名称：纽约梅隆银行	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日－2018年9月30日)
1.本期已实现收益	884,272.33
2.本期利润	-39,000,334.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1290
4.期末基金资产净值	480,054,319.58
5.期末基金份额净值	1.637

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。

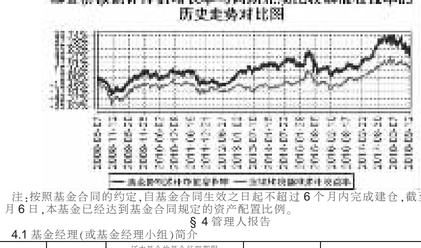
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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
过去三个月	-7.15%	1.77%	-4.37%	1.15%	-2.78%	0.62%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，自基金合同生效之日起不超过6个月内完成建仓，截至2008年11月6日，本基金已经达到基金合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周欣	本基金基金经理，华宝香港精选混合基金经理	2009年12月31日	-	19年	北京大学经济学硕士、耶鲁大学商学院工商管理硕士，曾在德意志银行亚洲证券、法国巴黎银行亚洲证券、东方证券资产管理部从事证券研究投资工作。2009年12月加入华宝基金管理有限公司，曾任海外投资管理部总经理。2009年12月至今担任华宝海外中国成长混合型证券投资基金基金经理，2015年9月至2017年8月任华宝中国互联网股票型证券投资基金基金经理，2018年6月任华宝港股通香港精选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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝海外中国成长混合型证券投资基金基金合同》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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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、公司股票库管理制度、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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2018年3季度港股市场在中美贸易摩擦加剧、新兴市场资金外流、人民币贬值加速、中国社会融资增速低于预期以及龙头权重股半年报不及预期等因素冲击下继续震荡下行。按照人民币计价，恒生指数下跌0.2%，恒生国企指数由于中国能源和电信板块表现强劲而上涨3.5%，中证海外内地指数下跌4.4%。美国中国双方针对对方500亿美元进口商品互相加征关税，中美贸易摩擦加剧伴随美元指数上升导致人民币兑美元汇率显著贬值，同时压制市场风险偏好，港股因此下跌。土耳其因受美国经济制裁造成货币大幅贬值，引发市场对新兴市场资本外流的担心。港股龙头权重股等半年报业绩不达预期，拖累整体科技股估值回调。由于银行资管新规的实施以及严格规范地方政府债务管理，三季度中国社会融资总量增速显著低于市场预期，市场担心金融条件持续收紧对经济增长带来的压力。此前表现强劲的教育板块由于《民办教育促进法实施条例》送审稿里面的政策调整方案引发剧烈下跌，估值较高的医药板块也大幅回调。7月媒体报导明年棚户区改造安置货币化比例将显著回落，市场担心这一政策变化将大幅压低三四线楼市需求，因此导致地产股和周期股大跌。此外市场还担心汽车行业合资股比政策放开可能导致上市合资车企中方股权被摊薄因而汽车类股显著下跌。

按照人民币计价调整之后的MSCI分类指数表现来看，三季度表现最好的是受益于国际原油价格上涨的能源板块，上涨14.2%；电信服务行业因为资金避险需求上升而上涨12.4%。工业、金融、原材料行业分别上涨5.6%、1.4%和0.3%。表现最差的是医疗服务和可选消费行业，分别下跌15.2%。医疗服务板块因为估值较高而承受卖压，可选消费受到汽车销售数据疲弱和社会消费零售总额增速较弱影响拖累。信息科技板块由于手机零部件龙头中报业绩不达预期而下跌10.9%。必需消费和公用事业板块下跌4.9%和2.8%。三季度我们增持了业绩改善确定性较强的环保类股、可再生能源类股和受益于利用小时改善的火力发电类股；减持了受国际原油价格上涨负面冲击的航空类股，以及因游戏行业监管趋严而可能使游戏收入增速放缓的信息科技股，减持了盈利增速放缓的手机零部件类股。我们认为目前港股市场的估值已经反映了关于中国经济和人民币汇率过于悲观的预期，虽然中美贸易摩擦可能仍将持续相当长时间，但由于中美双方在贸易关系中利益深度交织，两国全面爆发贸易战的可能性仍较低。中国四季度货币和财政政策有微调的空间，全年仍大概率取得6.5%的GDP增速。三季度由于投资组合中汽车、地产等板块显著回调，因此投资组合跑输业绩基准。

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为-7.15%，同期业绩比较基准收益率为-4.37%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	399,837,133.62	82.32
	其中：普通股	399,551,643.51	82.26
	优先股	-	-
	存托凭证	285,490.11	0.06
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	76,975,334.27	15.85
8	其他资产	8,915,831.29	1.84
9	合计	485,728,299.18	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
香港	399,551,643.51	83.23
美国	285,490.11	0.06
合计	399,837,133.62	83.29

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
房地产	100,759,253.78	20.99
非日常生活消费品	103,795,092.62	21.62
工业	6,712,413.61	1.40
公用事业	25,837,632.44	5.38
金融	62,723,459.18	13.07
能源	4,848,901.00	1.01
通信服务	5,256,272.68	1.09
信息技术	30,290,203.16	6.31
医疗保健	496,353.47	0.10
原材料	59,117,551.68	12.31
合计	399,837,133.62	83.29

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港	香港	9,180,000	46,160,820.18	9.62
2	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	中国金茂	817 HK	香港	香港	9,866,000	30,876,347.19	6.43
3	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	吉利汽车	175 HK	香港	香港	2,038,000	27,948,826.95	5.82
4	CHINA YONGDA AUTOMOBILES SER	永达汽车	3669 HK	香港	香港	4,473,500	27,646,335.46	5.76
5	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	龙光地产	3380 HK	香港	香港	3,500,000	27,199,136.47	5.67
6	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	碧桂园	2007 HK	香港	香港	3,007,000	26,090,679.35	5.43
7	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	中国东方集团	581 HK	香港	香港	4,666,000	25,923,678.06	5.40
8	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LIMITED	中升控股	881 HK	香港	香港	1,128,000	18,900,217.53	3.94
9	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL COLTD	中国建材	3323 HK	香港	香港	2,846,000	17,388,195.20	3.62
10	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技	2382 HK	香港	香港	202,500	16,074,874.26	3.35

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

5.10.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	820,678.00
2	应收证券清算款	2,922,951.91
3	应收股利	3,121,288.75
4	应收利息	2,700.60
5	应收申购款	2,048,212.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,915,831.29

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	307,789,565.72
报告期期间基金总申购份额	19,655,071.02
减：报告期期间基金总赎回份额	34,118,647.39
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	293,325,989.35

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝海外中国成长混合型证券投资基金基金合同；

华宝海外中国成长混合型证券投资基金招募说明书；

华宝海外中国成长混合型证券投资基金托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

8.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

8.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2018年10月26日

华宝现金宝货币市场基金

2018年第三季度报告

2018年9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
报告送出日期：2018年10月26日

§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责任。

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10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝现金宝货币		
基金主代码	240006		
交易代码	240006		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2005年3月31日		
报告期末基金份额总额	3,148,314,887.07份		
投资目标	保持本金的安全性与流动性，追求高于比较基准的收益率。		
投资策略	以对宏观经济及利率走势的判断为基础，在满足组合平均久期、收益性以及信用等级的前提下利用现代金融分析方法和工具，优化组合配置效果，实现组合增值。		
业绩比较基准	同期7天通知存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。		
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		
下属分级基金的基金简称	华宝现金宝货币A	华宝现金宝货币B	华宝现金宝货币E
下属分级基金的交易代码	240006	240007	000678
报告期末下属分级基金的份额总额	160,876,642.90份	868,796,057.80份	2,118,642,186.37份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日－2018年9月30日)		
	华宝现金宝货币A	华宝现金宝货币B	华宝现金宝货币E
1.本期已实现收益	1,510,985.88	6,947,484.78	22,201,107.02
2. 本期利润	1,510,985.88	6,947,484.78	22,201,107.02
3. 期末基金资产净值	160,876,642.90	868,796,057.80	2,118,642,186.37

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

华宝现金宝货币A

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.8314%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.4911%	0.0007%

注：基金收益分配是按日结转份额。

华宝现金宝货币B

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.8927%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.5524%	0.0007%

注：基金收益分配是按日结转份额。

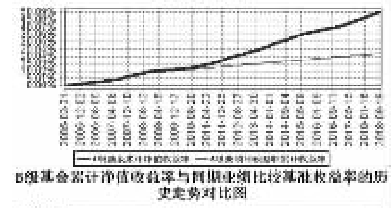
华宝现金宝货币E

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.8926%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.5523%	0.0007%

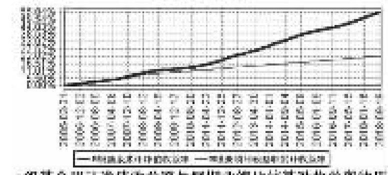
注：基金收益分配是按日结转份额。

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

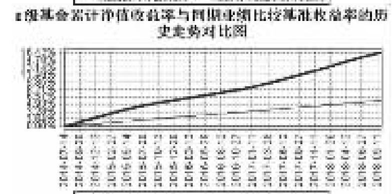
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金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



E级基金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



注：1.按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效之日起不超过六个月内完成建仓。截至2005年4月7日，本基金已根据基金合同规定完成建仓，资产配置比例符合基金合同约定。

2. 华宝现金宝E成立于2014年7月14日，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2014年7月14日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、华宝添益基金经理	2011年11月15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月至2014年2月兼任华宝中证短融50债券基金基金经理，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月任固定收益部总经理。
高文庆	本基金基金经理、华宝新起点混合基金经理	2017年3月17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月起任华宝现金宝货币市场基金、华宝新起点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》、《华宝现金宝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。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，现金宝货币市场基金在短期内出现过前十大份额持有人持有基金份额在20%~50%之间时持有现金、国债、中央银行票据、政策性金融债及5个交易日内到期的其他金融工具占净值比低于20%以及持有无托管资格的银行的存款、同业存单比例超过基金资产净值5%的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

4.3 公平交易专项说明

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、公司股票库管理制度、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，本基金没有发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度以来，央行通过公开市场和MLF操作向市场累计投放资金4925亿，货币政策继续延续二季度的稳健充裕。季初随着7月定向降准的实施，市场流动性异常宽裕，短端资产收益率继续下行，银行间隔夜利率在8月初一度来到1.4%，7D和14D回购利率一度均低于央行公开市场操作的基准利率。此后，资金价格开始企稳回升，隔夜利率重新回到2.5-2.6的中枢水平，资金面整体维持中性偏宽松，仅在缴税期和季末出现短暂扰动。债市方面，短端债券收益率在资金价格的带动下呈现先下后上，回购利率和存单利率都在8月上旬触底后反弹，短端利率也随之反弹。而经济预期的改善、美联储加息、以及对通胀的预期等因素推动长端利率在二季度震荡上行，收益率曲线继续陡峭化。

投资运作方面，本基金在三季度适当增加了同业存单和回购的配置比重，投资久期较二季度有所拉长，整体运行平稳。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期华宝现金宝货币A的基金份额净值收益率为0.8314%，本报告期华宝现金宝货币B的基金份额净值收益率为0.8927%，本报告期华宝现金宝货币E的基金份额净值收益率为0.8926%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	2,064,079,817.28	65.51
	其中：债券	2,064,079,817.28	65.51
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	635,598,968.40	20.17
	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	435,795,440.59	13.83
4	其他资产	15,119,534.76	0.48
5	合计	3,150,593,761.03	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	6.46	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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

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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	86
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	58

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

在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。

5.3.2 报告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	27.88	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	20.91	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	24.84	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	1.59	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	24.37	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.59	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	90,005,595.79	2.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	230,473,999.71	7.32
	其中：政策性金融债	230,473,999.71	7.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	131,127,393.61	4.17
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,612,472,828.17	51.22
8	其他	-	-
9	合计	2,064,079,817.28	65.56
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111813116	18浙商银行CD116	2,000,000	193,524,746.51	6.15
2	111881438	18盛京银行CD300	1,500,000	149,671,872.93	4.75
3	111821278	18渤海银行CD278	1,500,000	149,290,745.25	4.74
4	041751029	17重汽CP001	1,000,000	101,026,588.04	3.21
5	111881848	18宁波银行CD138	1,000,000	99,746,388.52	3.17
6	111788099	17哈尔滨银行CD210	1,000,000	99,701,317.77	3.17
7	111814046	18江苏银行CD046	1,000,000	99,059,677.25	3.15
8	111899442	18厦门国际银行CD133	1,000,000	97,996,604.13	3.11
9	189930	18贴现国债30	700,000	70,000,000.00	2.22
10	111882257	18重庆农村商行CD067	700,000	69,200,364.88	2.20

5.7 "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	0.2432%
报告期内偏离度的最低值	0.0951%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1440%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

5.8 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

5.9.2

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	14,877,381.32
4	应收申购款	241,657.89
5	其他应收款	495.55
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	15,119,534.76

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝现金宝货币A	华宝现金宝货币B	华宝现金宝货币E
报告期期初基金份额总额	223,339,747.76	522,404,381.99	2,311,136,044.15
报告期期间基金总申购份额	53,762,417.36	1,061,388,466.48	1,614,601,055.27
报告期期间基金总赎回份额	116,225,522.22	714,996,790.67	1,807,094,913.05
报告期期末基金份额总额	160,876,642.90	868,796,057.80	2,118,642,186.37

注：总申购份额含份额级别调整、转换入份额和红利再投；总赎回份额含份额级别调整和转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝现金宝货币市场基金基金合同；

华宝现金宝货币市场基金招募说明书；

华宝现金宝货币市场基金托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

9.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2018年10月26日

华宝现金添益交易型货币市场基金

2018年第三季度报告

2018年9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
报告送出日期：2018年10月26日

§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责任。

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10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	33,908,960,019.17份	
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.套利策略：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，进行跨市场、跨品种操作，以期获得安全的超额收益。 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。	
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	
下属分级基金的基金简称	华宝添益	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	1,329,880,340.70份	32,579,079,678.47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1.00元。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日－2018年9月30日)	
	华宝添益	华宝添益B
1.本期已实现收益	1,042,450,185.91	393,183,718.46
2. 本期利润	1,042,450,185.91	393,183,718.46
3. 期末基金资产净值	132,988,034,069.68	32,579,079,678.47

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

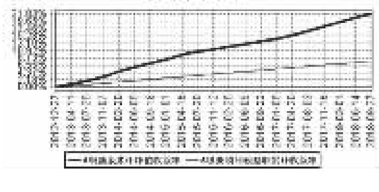
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7551%	0.0006%	0.3403%	0.0000%	0.4148%	0.0006%

华宝添益B

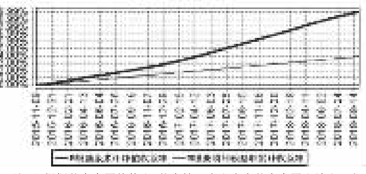
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8158%	0.0006%	0.3403%	0.0000%	0.4755%	0.0006%

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

A级基金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



B级基金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



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2013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，上图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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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。

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 公平交易专项说明

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、公司股票库管理制度、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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度以来，央行通过公开市场和MLF操作向市场累计投放资金4925亿，货币政策继续延续二季度的稳健充裕。季初随着7月定向降准的实施，市场流动性异常宽裕，短端资产收益率持续下行，银行间隔夜利率在8月初一度来到1.4%，7D和14D回购利率一度均低于央行公开市场操作的基准利率。此后，资金价格开始企稳回升，隔夜利率重新回到2.5-2.6的中枢水平，资金面整体维持中性偏宽松，仅在缴税期和季末出现短暂扰动。债市方面，短端债券收益率在资金价格的带动下呈现先下后上，回购利率和存单利率都在8月上旬触底后反弹，短端利率也随之反弹。而经济预期的改善、美联储加息、以及对通胀的预期等因素推动长端利率在二季度震荡上行，收益率曲线继续陡峭化。

本基金在三季度规模有所增长，在投资策略上，本基金在二季度增加了逆回购的投资比重，资产配置主要仍以同业存款为主要投资标的，回购、同业存单、利率债等其他品种为辅，投资久期较二季度有所拉长，整体运行平稳。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期华宝添益的基金份额净值收益率为0.7551%，本报告期华宝添益B的基金份额净值收益率为0.8158%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	47,202,476,876.12	28.31
	其中：债券	47,012,476,876.12	28.20
	资产支持证券	190,000,000.00	0.11
2	买入返售金融资产	42,094,934,335.16	25.25
	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	76,545,682,044.58	45.92
4	其他资产	865,395,620.67	0.52
5	合计	166,708,488,876.53	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	1.06	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,000,578,259.13	0.60
	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

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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	107
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

在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。

5.3.2 报告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	23.21	0.60
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	16.45	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	19.45	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	0.63	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	40.43	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		100.17	0.60

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,454,735,420.71	1.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,867,224,535.15	5.36
	其中：政策性金融债	8,867,224,535.15	5.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	299,988,706.80	0.18
6	中期票据	-	-
7	同业存单	35,390,528,213.46	21.38
8	其他	-	-
9	合计	47,012,476,876.12	28.39
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150223	15国开23	26,400,000	2,640,535,844.58	1.59
2	111810069	18兴业银行CD069	24,500,000	2,419,269,340.47	1.46
3	111881438	18盛京银行CD300	23,100,000	2,304,946,843.34	1.39
4	160208	16国开08	19,900,000	1,984,449,791.53	1.20
5	111898900	18徽商银行CD085	10,000,000	991,286,754.94	0.60
6	111814097	18江苏银行CD097	10,000,000	991,139,451.36	0.60
7	111814055	18江苏银行CD055	10,000,000	987,709,411.09	0.60
8	111882520	18重庆农村商行CD069	10,000,000	987,408,581.30	0.60
9	111814152	18江苏银行CD152	10,000,000	969,306,978.67	0.59
10	111883001	18重庆农村商行CD076	10,000,000	968,894,862.36	0.59

5.7 "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	0.0766%
报告期内偏离度的最低值	0.0313%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0473%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

5.8 报告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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	156005	宁远06A1	1,900,000	190,000,000.00	0.11

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

5.9.2

华宝添益货币基金截至2018年9月30日持仓前十名证券中的18兴业银行CD069(111810069)发行主体兴业银行(601166)于2018年5月4日收到银保监会处罚通知。由于公司存在：(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；(二)非真实转让信贷资产；(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务；(四)内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；(六)债券卖出回购业务违规出表；(七)个人理财资金违规投资；(八)提供日期倒签的材料；(九)部分非现场监管统计数据与事实不符；(十)个别董事未经任职资格核准即履职；(十一)变相批量转让个人贷款；(十二)向四证不全的房地产项目提供融资；被处以罚款。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	865,393,981.94
4	应收申购款	-
5	其他应收款	1,638.73
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	865,395,620.67

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝添益	华宝添益B
报告期期初基金份额总额	946,313,329.94	26,605,747,575.05
报告期期间基金总申购份额	707,089,850.35	45,454,954,810.58
报告期期间基金总赎回份额	323,522,839.59	39,481,622,707.16
报告期期末基金份额总额	1,329,880,340.70	32,579,079,678.47

注：1、本基金基金合同生效于2012年12月27日。本基金的份额折算日为基金合同生效当日。折算后本基金场内份额(A类基金份额)的份额净值为100.00元。

2、自2015年11月9日起增设华宝现金添益交易型货币市场基金的场外基金份额(B类基金份额)，场外份额(B类基金份额)的份额净值为1.00元。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	分红再投资	2018年7月2日	595.00	0.00	0.00%
2	强制调减	2018年7月2日	-1,902,109.00	-190,231,823.20	0.00%
3	申购	2018年7月3日	1,902,318.00	190,231,800.00	0.00%
4	分红再投资	2018年7月4日	197.00	0.00	0.00%
5	强制调减	2018年7月4日	-1,902,913.00	-190,342,813.80	0.00%
6	申购	2018年7月5日	1,903,428.00	190,342,800.00	0.00%
7	分红再投资	2018年7月6日	183.00	0.00	0.00%
8	分红再投资	2018年7月9日	513.00	0.00	0.00%
9	分红再投资	2018年7月10日	168.00	0.00	0.00%
10	分红再投资	2018年7月11日	163.00	0.00	0.00%
11	分红再投资	2018年7月12日	160.00	0.00	0.00%
12	分红再投资	2018年7月13日	159.00	0.00	0.00%
13	分红再投资	2018年7月16日	479.00	0.00	0.00%
14	分红再投资	2018年7月17日	160.00	0.00	0.00%
15	赎回	2018年7月17日	-35,000,000.00	-35,000,000.00	0.00%
16	分红再投资	2018年7月18日	161.00	0.00	0.00%
17	分红再投资	2018年7月19日	160.00	0.00	0.00%
18	分红再投资	2018年7月20日	161.00	0.00	0.00%
19	分红再投资	2018年7月23日	482.00	0.00	0.00%
20	分红再投资	2018年7月24日	162.00	0.00	0.00%
21	分红再投资	2018年7月25日	161.00	0.00	0.00%
22	分红再投资	2018年7月26日	160.00	0.00	0.00%
23	分红再投资	2018年7月27日	161.00	0.00	0.00%
24	分红再投资	2018年7月30日	484.00	0.00	0.00%
25	分红再投资	2018年7月31日	162.00	0.00	0.00%
26	分红再投资	2018年8月1日	163.00	0.00	0.00%
27	分红再投资	2018年8月2日	160.00	0.00	0.00%
28	分红再投资	2018年8月3日	157.00	0.00	0.00%
29	分红再投资	2018年8月6日	464.00	0.00	0.00%
30	分红再投资	2018年8月7日	152.00	0.00	0.00%
31	分红再投资	2018年8月8日	151.00	0.00	0.00%
32	分红再投资	2018年8月9日	149.00	0.00	0.00%
33	分红再投资	2018年8月10日	147.00	0.00	0.00%
34	分红再投资	2018年8月13日	436.00	0.00	0.00%
35	分红再投资	2018年8月14日	145.00	0.00	0.00%
36	分红再投资	2018年8月15日	144.00	0.00	0.00%
37	分红再投资	2018年8月16日	145.00	0.00	0.00%
38	分红再投资	2018年8月17日	145.00	0.00	0.00%
39	分红再投资	2018年8月20日	436.00	0.00	0.00%
40	分红再投资	2018年8月21日	146.00	0.00	0.00%
41	分红再投资	2018年8月22日	125.00	0.00	0.00%
42	分红再投资	2018年8月23日	147.00	0.00	0.00%
43	分红再投资	2018年8月24日	149.00	0.00	0.00%
44	分红再投资	2018年8月27日	451.00	0.00	0.00%
45	分红再投资	2018年8月28日	151.00	0.00	0.00%
46	分红再投资	2018年8月29日	140.00	0.00	0.00%
47	分红再投资	2018年8月30日	151.00	0.00	0.00%
48	分红再投资	2018年8月31日	151.00	0.00	0.00%
49	分红再投资	2018年9月3日	453.00	0.00	0.00%
50	分红再投资	2018年9月4日	151.00	0.00	0.00%
51	分红再投资	2018年9月5日	152.00	0.00	0.00%
52	分红再投资	2018年9月6日	152.00	0.00	0.00%
53	分红再投资	2018年9月7日	151.00	0.00	0.00%
54	分红再投资	2018年9月10日	455.00	0.00	0.00%
55	分红再投资	2018年9月11日	153.00	0.00	0.00%
56	分红再投资	2018年9月12日	157.00	0.00	0.00%
57	分红再投资	2018年9月13日	157.00	0.00	0.00%
58	分红再投资	2018年9月14日	156.00	0.00	0.00%
59	分红再投资	2018年9月17日	466.00	0.00	0.00%
60	分红再投资	2018年9月18日	158.00	0.00	0.00%
61	分红再投资	2018年9月19日	154.00	0.00	0.00%
62	分红再投资	2018年9月20日	153.00	0.00	0.00%
63	分红再投资	2018年9月21日	153.00	0.00	0.00%
64	分红再投资	2018年9月25日	610.00	0.00	0.00%
65	分红再投资	2018年9月26日	153.00	0.00	0.00%
66	分红再投资	2018年9月27日	151.00	0.00	0.00%
67	分红再投资	2018年9月28日	152.00	0.00	0.00%
合计			-35,000,037.01	-34,985,353.00	

交易日期为确认日期，交易金额为确认金额。

华宝添益(511990)面值为100元，华宝添益B(001893)面值为1元。

其中，序号15的交易流水中包含用赎回添益B基金35000000份得到35000000元。其余均为华宝添益交易流水。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝现金添益交易型货币市场基金基金合同；

华宝现金添益交易型货币市场基金招募说明书；

华宝现金添益交易型货币市场基金托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

9.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2018年10月26日