天弘余额宝货币市场基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
送出日期:2019年08月24日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年08月21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2019年01月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘余额宝货币
基金主代码	000198
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年05月29日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,033,562,700,062.65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	本基金根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。
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,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

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		天弘基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	李修滨
	联系电话	022-83310208	4006800000
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	lixiubin@citicbank.com
客户服务电话		95046	95558
传真		022-83865569	010-85230024

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.thfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

§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(2019年01月01日-2019年06月30日)
本期已实现收益	12,368,436,666.83
本期利润	12,368,436,666.83
本期净值收益率	1.1915%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)
期末基金资产净值	1,033,562,700,062.65
期末基金份额净值	1.0000

注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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、本基金的利润分配是按日结转份额。

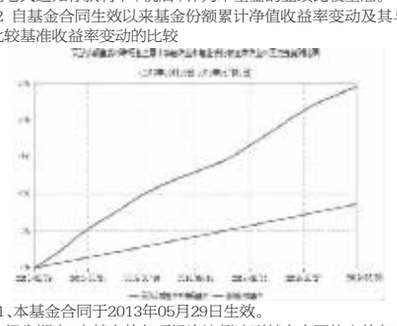
3.2 基金净值表现

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	0.1879%	0.0000%	0.1126%	0.0000%	0.0753%	0.0000%
过去三个月	0.5711%	0.0001%	0.3418%	0.0000%	0.2293%	0.0001%
过去六个月	1.1915%	0.0004%	0.6810%	0.0000%	0.5105%	0.0004%
过去一年	2.6732%	0.0010%	1.3781%	0.0000%	1.2951%	0.0010%
过去三年	10.1306%	0.0019%	4.1916%	0.0000%	5.9390%	0.0019%
自基金合同生效起至今	24.6632%	0.0027%	8.6975%	0.0000%	15.9657%	0.0027%

注:天弘余额宝货币市场基金业绩比较基准:同期七天通知存款利率(税后)。通知存款是一种不约定存期,支取时需提前通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款,具有存期灵活、存取方便的特征,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期七天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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、本基金合同于2013年05月29日生效。

2、本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§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

天弘基金管理有限公司(以下简称"公司"或"本基金管理人")经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准,于2004年11月8日正式成立。注册资本金为5.143亿元人民币,总部设在天津,在北京、上海、广州、天津、深圳、四川设有分公司。公司股权结构为:

股东名称	股权比例
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
合计	100%

截至2019年6月30日,本基金管理人共管理49只基金:天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘文化新兴产业股票型证券投资基金、天弘添利债券型证券投资基金(LOF)、天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康颐养混合型证券投资基金、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘同利债券型证券投资基金(LOF)、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数型发起式证券投资基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘医疗健康混合型证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘量化驱动股票型证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘创业板指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机主题指数型发起式证券投资基金(原"天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金")、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘沿证宝货币市场基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘优选债券型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘悦享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘耀利一年定期开放债券型证券投资基金、天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金、天弘港股通精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘增强回报债券型证券投资基金、天弘安益债券型证券投资基金、天弘华享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

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		
王登峰	本基金基金经理;本公司固定收益部总经理。	2013年06月	-	10年	男,经济学硕士。历任中信建投证券股份有限公司固定收益部高级经理。2012年5月加盟本公司,历任本公司固定收益研究员等。
田瑶	本基金基金经理助理。	2018年11月	-	8年	女,金融学硕士,2012年7月加盟本公司,历任本公司债券研究员、债券交易员。

注:1、基金经理任职日期为基金合同生效日。基金经理助理任职日期为聘任日期。

2、本基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作,不具有独立决策职能。

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

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定,勤勉尽责地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。

本报告期内,本基金运作合法合规,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

公平交易的执行情况包括:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权审批程序;实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离;加强对投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定,拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内,严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易;针对以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

本基金本报告期内未发生同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

基本面方面,进入2019年之后,经济仍有下行压力,但是政府基建支持力度较大,对经济形成较强支撑作用,下行速度在政府稳增长政策支持之下有所放缓,4月份市场对基本面预期转向乐观,但此后乐观预期被证伪,经济在5、6月份重回下行。通胀方面,通胀预期有所抬头,猪价受非洲猪瘟影响2月见底之后出现明显上涨,带动CPI抬升。

政策面方面,2019年年初,政策延续前期思路,着力支持信用扩张,力求疏通货币政策传导机制,并且吸取2018年政策过晚推出的教训,稳增长政策提前出台,力图努力稳住经济。在经济出现企稳迹象之后,一季度政治局会议在政策立场上有所微调,政策中心转向强调经济增长质量和结构转型,5月份中美贸易摩擦超预期升级之后,政策重新强调逆周期调节,通过允许专项债作为重大项目资本金等方式推动基建发力,以稳货币宽货币的方式对经济进行托底。

资金面方面,年初资金面延续宽松态势,4月份资金面波动率明显上升,包商事件之后,央行着力稳定资金面,资金利率出现明显下行。

债券市场方面, 1月份债券收益率延续2018年趋势有所下行,2月份由于风险偏好回升债市出现一定幅度调整,3月份债券市场呈现震荡行情。4月份债市出现明显调整,此后由于中美贸易摩擦升级、经济下行压力重现,收益率再度下行,包商事件对债市收益率造成一定冲击,此后利率债和高等级信用债收益率再度下行,低等级信用债收益率则处于高位,行情出现一定分化。

余额宝在风控指标范围内,保证流动性需求的情况下,对资产做出最优配置,再配置资产以同业存款、同业存单、逆回购和信用债配置为主。本基金在报告期内,为持有人创造了与风险相匹配的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年06月30日,本基金本报告期净值收益率为1.1915%,同期业绩比较基准收益率为0.6810%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基本面方面,目前宏观经济基本面呈现小幅下滑局面,但短期来看下滑最快的时期可能已经过去,后续需要密切关注地产链条情况,以前瞻性判断未来的经济走势。

政策面方面,虽然稳增长仍有必要,但是决策层对于稳增长诉求有所下降,坚持推行供给侧结构性改革,对经济托而不举,货币政策预计维持稳健并根据基本面的变化预期微调。

资金面方面,流动性将维持合理充裕,6月份由于应对包商事件而出现的宽松的局面难以持续,下半年资金利率中枢相对将有所抬升,但将维持平稳,不会出现过度紧张的局面。

市场结构方面,在全球货币再宽松的大背景下,不少国家的债券收益率再度跌入负利率区间,叠加人民币汇率企稳,中国的无风险利率对外资而言,配置价值显著,可能会吸引境外机构加大对中债的增持力度。

债券市场仍处于牛市环境中,但下行的空间可能有限,需要看到经济超预期下行或货币政策超预期放松,才能够带来市场收益率的明显下行,后续需要密切关注经济和政策变化,积极对组合久期、杠杆水平进行调整。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策, 对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督,对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管固定收益投资的高级管理人员、督察长、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组, 由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、基金会计、风险管理人员及内控合规人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一, 在基金估值定价过程中,充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内,本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书(更新)等有关规定,本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人(该收益参与下一日的收益分配),并按自然日结转至基金份额持有人的基金账户。

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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§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

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对天弘余额宝货币市场基金2019年上半年的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,履行了托管人的义务,不存在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,天弘基金管理有限公司在天弘余额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《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,天弘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2019半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:天弘余额宝货币市场基金
报告截止日:2019年06月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	578,565,389,143.80	550,873,057,066.67
结算备付金	9,661,782.95	32,747,449.08
存出保证金	865,726.08	188,519.40
交易性金融资产	127,237,923,348.62	163,739,030,579.84
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	127,237,923,348.62	163,739,030,579.84
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	327,061,444,755.85	416,115,973,040.59
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,223,433,944.41	2,597,898,015.90
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,034,098,718,701.71	1,133,358,894,671.48
负债和所有者权益	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018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	-	-
应付证券清算款	-	10,386,302.17
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	253,432,907.67	302,997,921.95
应付托管费	67,582,108.73	80,799,445.86
应付销售服务费	211,194,089.70	252,498,268.28
应付交易费用	2,303,554.78	2,996,265.35
应交税费	1,060,594.42	1,192,067.57
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	445,383.76	1,159,000.00
负债合计	536,018,639.06	652,029,271.18
所有者权益:		
实收基金	1,033,562,700,062.65	1,132,706,865,400.30
未分配利润	-	-
所有者权益合计	1,033,562,700,062.65	1,132,706,865,400.30
负债和所有者权益总计	1,034,098,718,701.71	1,133,358,894,671.48

注:报告截止日2019年06月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额1,033,562,700,062.65份。

6.2 利润表

会计主体:天弘余额宝货币市场基金
本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入	15,642,239,350.55	36,764,224,736.33
1.利息收入	15,517,836,884.21	36,763,137,556.19
其中:存款利息收入	8,780,058,888.76	23,128,385,986.02
债券利息收入	1,775,632,497.46	2,014,934,680.60
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,962,145,497.99	11,619,816,889.57
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	124,402,466.34	1,087,180.14
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	124,402,466.34	1,087,180.14
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	3,273,802,683.72	5,098,734,608.05
1. 管理人报酬	1,552,634,341.81	2,427,328,245.36
2. 托管费	414,035,824.48	647,287,532.16
3. 销售服务费	1,293,861,951.45	2,022,773,537.83
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	11,958,680.51	-
其中:卖出回购金融资产支出	11,958,680.51	-
6. 税金及附加	723,953.57	418,223.60
7. 其他费用	587,931.90	927,069.10
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	12,368,436,666.83	31,665,490,128.28
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	12,368,436,666.83	31,665,490,128.28

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:天弘余额宝货币市场基金
本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年06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)	1,132,706,865,400.30	-	1,132,706,865,400.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,368,436,666.83	12,368,436,666.83
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)	-99,144,165,337.65	-	-99,144,165,337.65
其中:1.基金申购款	3,287,167,548,919.83	-	3,287,167,548,919.83
2.基金赎回款	-3,386,311,714,257.48	-	-3,386,311,714,257.48
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)	-	-12,368,436,666.83	-12,368,436,666.83
五、期末所有者权益(基金净值)	1,033,562,700,062.65	-	1,033,562,700,062.65
项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06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)	1,579,832,396,375.85	-	1,579,832,396,375.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	31,665,490,128.28	31,665,490,128.28
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)	-125,811,441,275.30	-	-125,811,441,275.30
其中:1.基金申购款	4,465,986,137,938.88	-	4,465,986,137,938.88
2.基金赎回款	-4,591,797,579,214.18	-	-4,591,797,579,214.18
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)	-	-31,665,490,128.28	-31,665,490,128.28
五、期末所有者权益(基金净值)	1,454,020,955,100.55	-	1,454,020,955,100.55

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:

郭树强	薄贺龙	肖慧敏
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

天弘余额宝货币市场基金(原名"天弘增利宝货币市场基金",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")证监许可[2013]692号《关于核准天弘增利宝货币市场基金募集的批复》核准,由天弘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《天弘增利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200,628,721.85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(2013)第306号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘增利宝货币市场基金基金合同》于2013年5月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,628,721.85份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据相关法律法规、《天弘增利宝货币市场基金基金合同》的相关规定和《天弘基金管理有限公司关于变更天弘增利宝货币市场基金名称并修改基金合同相应条款的公告》,"天弘增利宝货币市场基金"于2015年5月15日公告后更名为"天弘余额宝货币市场基金",基金简称由"天弘增利宝货币"变更为"天弘余额宝货币", 基金代码不变, 仍为000198。

根据《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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》和《天弘余额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1年以内(含1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、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;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》、《天弘余额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。

本财务报表以本基金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2019年度上半年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2019年06月30日的财务状况以及2019年度上半年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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 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:

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加、地方教育费附加和防洪工程维护费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
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中信银行股份有限公司	基金托管人

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 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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,552,634,341.81	2,427,328,245.36
其中:支付销售机构的客户维护费	1,238,920.71	2,023,791.87

注:1、支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%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 X 0.30% / 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	414,035,824.48	647,287,532.16

注:支付基金托管人中信银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.08%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 X 0.08% / 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 2019年01月01日至2019年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
天弘基金管理有限公司	1,262,888,933.51
合计	1,262,888,933.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
天弘基金管理有限公司	1,972,178,698.26
合计	1,972,178,698.26

注:支付基金管理人天弘基金管理有限公司销售服务费按前一日基金资产净值0.25%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:日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

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 2019年01月01日至2019年06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
中信银行股份有限公司	1,386,909,405.61	-	10,970,000,000.00	2,210,556.72	-	-
上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06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
中信银行股份有限公司	4,460,003,185.21	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	182,765,389,143.80	2,150,588,004.60	22,502,219,479.80	503,200,598.85

注:本基金的银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

于2019年06月30日, 本基金持有7,700,000张中信银行股份有限公司的同业存单,成本总额为人民币764,585,751.82元,估值总额为人民币765,312,000.00元, 成本总额占基金资产净值的比例为0.0740%(2018年12月31日:0.0088%)。

6.4.9 期末(2019年06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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年06月30日, 本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年06月30日, 本基金未持有交易所市场