华宝现金添益交易型货币市场基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6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
送出日期:2019年8月29日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月27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06月30日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

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	
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	
报告期末基金份额总额	124,521,842,636.19份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2013年1月28日	
下属分级基金的基金简称:	华宝添益	华宝添益B
下属分级基金场内简称:	华宝添益	changNeiJianChengB
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	98,800,261,903.32份	25,721,580,732.87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。为便于投资者理解,本报告中(除期末上市基金前十名持有人外)场内基金份额均按份额净值为1.00折算后进行披露及汇总统计。

2.2基金产品说明

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。

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		华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	010一67595096
传真		021-38505777	010-66275853

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.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所

§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

金额单位:人民币元

基金级别	华宝添益	华宝添益B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	1,190,868,726.56	708,137,788.84
本期利润	1,190,868,726.56	708,137,788.84
本期净值收益率	1.2629%	1.3835%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末基金资产净值	98,800,261,903.32	25,721,580,732.87
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
累计净值收益率	24.2182%	12.3472%

注:1、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。

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

华宝添益

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	0.1982%	0.0001%	0.1110%	0.0000%	0.0872%	0.0001%
过去三个月	0.6043%	0.0002%	0.3366%	0.0000%	0.2677%	0.0002%
过去六个月	1.2629%	0.0004%	0.6695%	0.0000%	0.5934%	0.0004%
过去一年	2.7278%	0.0007%	1.3500%	0.0000%	1.3778%	0.0007%
过去三年	9.9493%	0.0018%	4.0481%	0.0000%	5.9012%	0.0018%
自基金合同生效日起至今	24.2182%	0.0025%	8.7879%	0.0000%	15.4303%	0.0025%

华宝添益B

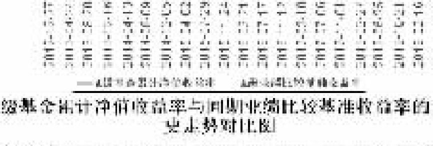
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2179%	0.0001%	0.1110%	0.0000%	0.1069%	0.0001%
过去三个月	0.6644%	0.0002%	0.3366%	0.0000%	0.3278%	0.0002%
过去六个月	1.3835%	0.0004%	0.6695%	0.0000%	0.7140%	0.0004%
过去一年	2.9747%	0.0007%	1.3500%	0.0000%	1.6247%	0.0007%
过去三年	10.6988%	0.0017%	4.0481%	0.0000%	6.6507%	0.0017%
自基金合同生效日起至今	12.3472%	0.0020%	4.9118%	0.0000%	7.4354%	0.0020%

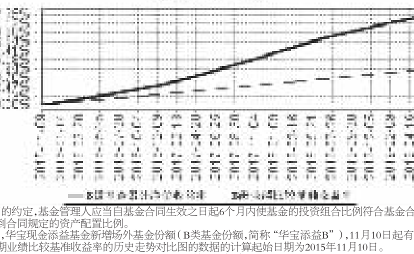
注:1、本基金业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)。

2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。

3、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,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数据的计算起始日期为2015年11月10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、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,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2015年11月10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

基金管理人是2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末(2019年6月30日),正在管理运作的证券投资基金包括宝康系列基金、华宝多策略基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合基金、华宝收益增长基金、华宝先进成长基金、华宝行业精选基金、华宝海外中国成长基金、华宝大盘精选基金、华宝增强收益基金、华宝中证100 基金、上证180价值ETF、华宝上证180价值ETF联接基金、华宝新兴产业基金、华宝可转债基金、华宝油气基金、华宝医药生物基金、华宝资源优选基金、华宝添益货币市场基金、华宝服务优选基金、华宝创新优选基金、华宝生态中国基金、华宝量化对冲基金、华宝高端制造基金、华宝品质生活基金、华宝稳健回报基金、华宝事件驱动基金、华宝国策导向基金、华宝新价值基金、华宝新机遇基金、华宝医疗分级基金、华宝中证1000分级基金、华宝万物互联基金、华宝转型升级基金、华宝核心优势基金、华宝美国消费基金、华宝香港中小盘基金、华宝中证全指证券公司ETF、华宝中证军工ETF、华宝新活力基金、华宝沪深300指数增强基金、华宝未来主导产业基金、华宝新起点基金、华宝红利基金、华宝新飞跃基金、华宝新优选基金、华宝香港大盘基金、华宝智慧产业基金、华宝第三产业基金、华宝银行ETF、华宝银行ETF联接基金、华宝价值发现基金、华宝香港本地基金、华宝中证500指数增强基金、华宝香港精选基金、华宝券商ETF联接基金、华宝宝丰高等级债券基金、华宝绿色主题基金、华宝沪港深价值基金、华宝科技先锋基金、华宝宝裕纯债基金、华宝大健康基金、华宝中短债基金、华宝稳健FOF基金、华宝宝盛纯债基金、华宝宝怡纯债基金、华宝消费升级基金、华宝质量价值基金等,正在管理运作的证券投资基金资产净值合计171,851,775,826.03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		
陈昕	固定收益部总经理、本基金基金经理、华宝现金宝货币、华宝宝怡债券基金经理	2012年12月27日	-	16年	工商管理硕士。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,现任固定收益部总经理。2011年11月起任华宝现金宝货币市场基金基金经理,2012年6月至2014年2月任华宝中证短融50债券基金基金经理,2012年12月起任华宝现金添益交易型货币市场基金基金经理。2019年5月起任华宝宝怡纯债债券型证券投资基金基金经理。
高文庆	本基金基金经理、华宝现金宝货币、华宝新起点混合、华宝中短债债券、华宝宝怡债券基金经理	2019年7月19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。2019年3月起任华宝中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。2019年5月起任华宝宝怡纯债债券型证券投资基金基金经理。2019年7月起任华宝现金添益交易型货币市场基金基金经理。
高文庆	本基金基金经理助理、华宝新起点混合基金、华宝现金宝货币、华宝中短债债券、华宝宝怡债券、华宝添益基金经理	2015年8月27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。2015年8月至2017年3月任华宝现金宝货币市场基金基金经理助理,2015年8月至2019年7月任华宝现金添益交易型货币市场基金基金经理助理,2016年5月至2017年4月任华宝宝康债券投资基金基金经理助理,2016年8月至2017年4月任华宝增强收益债券型证券投资基金、华宝可转债债券型证券投资基金、华宝宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理助理,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。2019年3月起任华宝中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。2019年5月起任华宝宝怡纯债债券型证券投资基金基金经理。2019年7月起任华宝现金添益交易型货币市场基金基金经理。
林昊	本基金基金经理助理、华宝新价值、华宝新机遇混合、华宝新活力混合、华宝宝丰高等级债券基金经理	2014年6月16日	-	13年	本科。2006年5月加入华宝基金管理有限公司,先后担任渠道经理、交易员、高级交易员、基金经理助理等职务。2014年6月至2017年4月任华宝现金宝货币市场基金基金经理助理,2014年6月至2019年7月任华宝现金添益交易型货币市场基金基金经理助理,2016年5月至2017年3月任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理助理, 017年3月起任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年12月至2018年6月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年12月至2018年7月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理,2017年12月至2018年12月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018年8月起任华宝宝丰高等级债券型发起式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。

3、基金经理助理高文庆、林昊于2019年7月19日离任本基金,管理人已就此事项发布公告。

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。

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,华宝现金添益交易型货币市场基金在短期内出现过持有现金、国债、中央银行票据、政策性金融债以及五个交易日内到期的其他金融工具低于基金资产净值10%和持有到期日在十个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值比例超过10%的的情况,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,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

展望2019年下半年,从经济基本面来看,上半年支撑经济的主要因素是地产和基建投资,房地产投资虽然出现走弱迹象,但土地购置费的拉动正逐步向回升空间较大的安装工程过渡。基建投资在近期密集出台的专项债作为资本金、化解地方政府隐形债务等政策下有望持续回升。基建和制造业在下半年将更大程度受货币宽松、信用投放和专项债资金落地的影响,对经济形成拖底。但是从居民就业来看,压力依然较大,消费预期难以提振。考虑到全球宏观经济走弱和贸易摩擦带来的不确定性,预计下半年外贸端将持续承压,无论中美贸易谈判的走势将如何演绎,出口下行的趋势预期难以大幅改善。整体而言,下半年经济依然面临下行风险,在需求持续走弱的背景下,经济企稳将有赖于宏观政策带来的分项改善。政策组合上,央行上半年已逐步从去年的宽货币、宽信用向中性货币、宽信用转变。由于包商事件引发同业信用收缩,继而对实体经济信用投放产生负面影响,可能使下半年的社融增速回升速度放缓。信用修复的放缓、通胀制约的减弱以及美联储最新6月议息会议向市场释放出降息的信号等,都为国内央行的宽松货币政策打开了空间,我们预期19年下半年货币政策仍将维持中性宽松。

短期来看,经济基本面和政策面以及中美利差对债券市场相对有利,但是下半年市场变化和国内国际政策的不确定性较大,股票和债券走势将易受市场风险偏好和政策预期变化的影响,资金价格也面临波动的风险。在此背景下,本基金管理人将继续本着谨慎、稳健、安全的原则,在投资操作上会相对谨慎,保持一定的高流动性资产配置,以应对市场风险偏好上升或流动性信用分层给基金管理规模带来的影响。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期华宝添益的基金份额A净值收益率为1.2629%,本报告期华宝添益的基金份额B净值收益率为1.3835%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

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2019年下半年,从经济基本面来看,上半年支撑经济的主要因素是地产和基建投资,房地产投资虽然出现走弱迹象,但土地购置费的拉动正逐步向回升空间较大的安装工程过渡。基建投资在近期密集出台的专项债作为资本金、化解地方政府隐形债务等政策下有望持续回升。基建和制造业在下半年将更大程度受货币宽松、信用投放和专项债资金落地的影响,对经济形成拖底。但是从居民就业来看,压力依然较大,消费预期难以提振。考虑到全球宏观经济走弱和贸易摩擦带来的不确定性,预计下半年外贸端将持续承压,无论中美贸易谈判的走势将如何演绎,出口下行的趋势预期难以大幅改善。整体而言,下半年经济依然面临下行风险,在需求持续走弱的背景下,经济企稳将有赖于宏观政策带来的分项改善。政策组合上,央行上半年已逐步从去年的宽货币、宽信用向中性货币、宽信用转变。由于包商事件引发同业信用收缩,继而对实体经济信用投放产生负面影响,可能使下半年的社融增速回升速度放缓。信用修复的放缓、通胀制约的减弱以及美联储最新6月议息会议向市场释放出降息的信号等,都为国内央行的宽松货币政策打开了空间,我们预期19年下半年货币政策仍将维持中性宽松。

短期来看,经济基本面和政策面以及中美利差对债券市场相对有利,但是下半年市场变化和国内国际政策的不确定性较大,股票和债券走势将易受市场风险偏好和政策预期变化的影响,资金价格也面临波动的风险。在此背景下,本基金管理人将继续本着谨慎、稳健、安全的原则,在投资操作上会相对谨慎,保持一定的高流动性资产配置,以应对市场风险偏好上升或流动性信用分层给基金管理规模带来的影响。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时,由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

(1)日常估值流程

本基金的估值由基金会计负责,基金会计以本基金为会计核算主体,基金会计核算独立于公司会计核算,独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理;每日按时接收成交数据及权益数据,进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行;基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对,每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

(2)特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度,对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况,量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法(比如:指数收益法)进行估值,并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见,但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力,参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金A类份额在本年度累计分配收益1,190,868,726.56元,其中以红利再投资方式结转入实收基金1,204,365,570.13元,计入应付利润科目-13,496,843.57元。B类份额在本年度累计分配收益708,137,788.84元,其中以红利再投资方式结转入实收基金710,439,596.87元,计入应付利润科目-2,301,808.03元。

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 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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,本托管人根据《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,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金A类份额在本年度累计分配收益1,190,868,726.56元,其中以红利再投资方式结转入实收基金1,204,365,570.13元,计入应付利润科目-13,496,843.57元。B类份额在本年度累计分配收益708,137,788.84元,其中以红利再投资方式结转入实收基金710,439,596.87元,计入应付利润科目-2,301,808.03元。

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

本托管人复核审查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。

§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:华宝现金添益交易型货币市场基金

报告截止日: 2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	54,919,432,108.69	72,907,441,301.06
结算备付金	453,189,805.07	1,747,023,963.64
存出保证金	16,362.28	-
交易性金融资产	34,519,967,107.29	43,368,470,172.22
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	34,201,967,107.29	42,968,470,172.22
资产支持证券投资	318,000,000.00	400,000,000.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	36,679,430,037.37	13,872,248,803.40
应收证券清算款	200,000,000.00	-
应收利息	814,723,469.76	793,228,300.43
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	397.86	-
资产总计	127,586,759,288.32	132,688,412,540.75
负债和所有者权益	本期末 2019年6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	2,941,216,009.39	-
应付证券清算款	26,000,000.00	1,270,000,000.00
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	40,199,940.10	49,709,456.47
应付托管费	10,337,127.45	12,782,431.66
应付销售服务费	20,261,011.76	26,421,542.13
应付交易费用	455,521.85	302,768.11
应交税费	62,993.60	51,718.37
应付利息	432,323.28	-
应付利润	25,798,827.47	41,597,479.07
递延所得税负债	-	-
其他负债	152,897.23	429,000.00
负债合计	3,064,916,652.13	1,401,294,395.81
所有者权益:		
实收基金	124,521,842,636.19	131,287,118,144.94
未分配利润	-	-
所有者权益合计	124,521,842,636.19	131,287,118,144.94
负债和所有者权益总计	127,586,759,288.32	132,688,412,540.75

注:报告截止日2019年6月30日,华宝现金添益交易型货币市场基金A类基金份额净值100.00元,基金份额总额988,002,619.03份;华宝现金添益交易型货币市场基金B类基金份额净值1.00元,基金份额总额25,721,580,732.87份。为便于投资者理解,本财务报表中A类基金份额按份额净值1.00元折算后进行披露及汇总统计,折算后华宝现金添益交易型货币市场基金A类基金份额总额98,800,261,903.32份,华宝现金添益交易型货币市场基金份额合计124,521,842,636.19份。

6.2利润表

会计主体:华宝现金添益交易型货币市场基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	2,364,910,913.21	3,080,413,391.99
1.利息收入	2,364,713,212.01	3,080,391,999.72
其中:存款利息收入	1,184,247,427.74	1,954,795,670.68
债券利息收入	571,750,132.50	554,395,727.85
资产支持证券利息收入	8,032,895.71	-
买入返售金融资产收入	600,682,756.06	571,200,601.19
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	197,701.20	21,392.27
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	197,701.20	21,392.27
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)	-	-
减:二、费用	465,904,397.81	447,830,333.10
1. 管理人报酬	253,864,429.35	233,712,217.12
2. 托管费	65,279,424.65	60,097,427.20
3. 销售服务费	119,813,284.62	127,663,149.39
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	26,672,295.58	26,006,845.59
其中:卖出回购金融资产支出	26,672,295.58	26,006,845.59
6. 税金及附加	26,678.86	21,085.83
7. 其他费用	248,284.75	329,607.97
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	1,899,006,515.40	2,632,583,058.89
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	1,899,006,515.40	2,632,583,058.89

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝现金添益交易型货币市场基金

本报告期:2019年1月1日 至 2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	131,287,118,144.94	-	131,287,118,144.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,899,006,515.40	1,899,006,515.40
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)	-6,765,275,508.75	-	-6,765,275,508.75
其中:1.基金申购款	211,767,768,973.02	-	211,767,768,973.02
2.基金赎回款	-218,533,044,481.77	-	-218,533,044,481.77
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)	-	-1,899,006,515.40	-1,899,006,515.40
五、期末所有者权益(基金净值)	124,521,842,636.19	-	124,521,842,636.19
项目	上年度可比期间 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)	88,735,823,424.44	-	88,735,823,424.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,632,583,058.89	2,632,583,058.89
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)	32,501,257,144.37	-	32,501,257,144.37
其中:1.基金申购款	221,323,909,124.45	-	221,323,909,124.45
2.基金赎回款	-188,822,651,980.08	-	-188,822,651,980.08
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)	-	-2,632,583,058.89	-2,632,583,058.89
五、期末所有者权益(基金净值)	121,237,080,568.81	-	121,237,080,568.81

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:

______黄小意______　　　______向辉______　　　____张幸骏____
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

华宝现金添益交易型货币市场基金(原名为华宝兴业现金添益交易型货币市场基金,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[2012]1651号《关于核准华宝兴业现金添益交易型货币市场基金募集的批复》核准,由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,已于2017年10月17日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,802,628,000.00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(2012)第546号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》 于2012年12月27日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为18,026,280.00份基金份额。本基金有效认购资金在募集期间产生的利息在银行结息日计入基金资产。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称"上交所")上证基字[2013]17号审核同意,本基金18,026,280.00份基金份额于2013年1月28日在上交所挂牌交易。

经中国证监会备案,本基金于2015年11月9日起增设本基金的场外基金份额(以下简称"B类基金份额")。本基金的原场内基金份额为A类基金份额,A类基金份额仅在上交所申购、赎回和上市交易。B类基金份额仅在场外进行申购和赎回。A类基金份额的申购、赎回净值为每份人民币100.00元,B类基金份额的申购、赎回净值为每份人民币1.00元。A类基金份额由中国证券登记结算有限责任公司进行登记;B类基金份额由华宝兴业基金管理有限公司进行登记。为便于投资者理解,本财务报表中A类基金 份额按份额净值1.00元折算后进行披露及汇总统计。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,华宝兴业现金添益交易型货币市场基金于2017年12月30日起更名为华宝现金添益交易型货币市场基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝现金添益交易型货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括现金;通知存款;短期融资券;剩余期限在397天以内(含397天)的债券;1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单;期限在1年以内(含1年)的债券回购;剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;期限在1年以内(含1年)的中央银行票据;剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据以及中国证监会、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。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。

本基金的财务报表于2019年8月29日已经本基金的基金管理人批准报出。

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》、《华宝现金添益交易型货币市场基金基金合同》和在财务报表附注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半年度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6月30日的财务状况以及2019半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4重要会计政策和会计估计

本基金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会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

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
华宝基金管理有限公司("华宝基金")	基金管理人、B类基金份额登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人
华宝信托有限责任公司("华宝信托")	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management,L.P.)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司("宝武集团")	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司("华宝证券")	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司("华宝投资")	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司("宝钢财务")	受宝武集团控制的公司

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 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	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华宝证券	30,675,400,000.00	5.50%	-	-

6.4.8.1.4权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	253,864,429.35	233,712,217.12
其中:支付销售机构的客户维护费	25,700,604.71	24,173,477.22

注:支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.35%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 × 0.35% / 当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	65,279,424.65	60,097,427.20

注:支付基金托管人 中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.09%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 0.09% / 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1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝添益	华宝添益B	合计
华宝基金	42,376,435.89	2,563,268.82	44,939,704.71
华宝证券	465,891.31	-	465,891.31
合计	42,842,327.20	2,563,268.82	45,405,596.02
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	华宝添益	华宝添益B	合计
华宝基金	43,645,250.90	13,219,613.83	56,864,864.73
华宝证券	560,349.56	-	560,349.56
合计	44,205,600.46	13,219,613.83	57,425,214.29

注:支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给华宝,再由华宝计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日基金销售服务费=前一日基金资产净值×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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日					
	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
中国建设银行	-	52,022,268.49	-	-	45,977,902,000.00	3,208,060.72
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日					
	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
中国建设银行	251,280,252.05	-	-	-	23,778,820,000.00	2,580,292.43

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

份额单位:份

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	华宝添益	华宝添益B
基金合同生效日(2012年12月27日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	192,976,300.00	445,892,412.85
期间申购/买入总份额	3,117,572,700.00	104,949,948.89
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	3,115,013,300.00	538,000,000.00
期末持有的基金份额	195,535,700.00	12,842,361.74
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2000%	0.0500%
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	华宝添益	华宝添益B
基金合同生效日(2012年12月27日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	186,427,800.00	-
期间申购/买入总份额	5,081,548,600.00	130,099,949.74
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	5,077,765,500.00	60,099,949.74
期末持有的基金份额	190,210,900.00	70,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2000%	0.2600%

注:1. 期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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

华宝添益B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华宝投资有限公司	100,358,403.81	0.3900%	50,008,515.59	0.2100%
华宝信托有限责任公司	-	-	380,799,998.83	1.6000%
宝钢集团财务有限责任公司	-	-	530,105,028.24	2.2300%

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1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,432,108.69	39,982.21	2,192,469.27	15,066.22

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9期末(2019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

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

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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2,941,216,009.39元,是以如下债券作为抵押:

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
199916	19贴现国债16	2019年7月1日	99.87	185,000	18,476,751.85
199921	19贴现国债21	2019年7月1日	99.64	5,800,000	577,893,586.15
199923	19贴现国债23	2019年7月1日	99.50	3,200,000	318,387,176.20
199920	19贴现国债20	2019年7月1日	99.69	5,700,000	568,248,682.59
199922	19贴现国债22	2019年7月1日	99.59	415,000	41,331,382.90
199917	19贴现国债17	2019年7月1日	99.83	505,000	50,413,259.58
090208	09国开08	2019年7月1日	99.98	2,700,000	269,935,567.88
120312	12进出12	2019年7月1日	100.20	11,754,000	1,177,706,930.42
合计				30,259,000	3,022,393,337.57

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购,因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2019年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为34,519,967,107.29元,无属于第一或第三层次的余额(2018年12月31日:第二层次43,368,470,172.22元,无第一或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018年12月31日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外,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	34,519,967,107.29	27.06
	其中:债券	34,201,967,107.29	26.81
	资产支持证券	318,000,000.00	0.25
2	买入返售金融资产	36,679,430,037.37	28.75
	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	55,372,621,913.76	43.40
4	其他各项资产	1,014,740,229.90	0.80
5	合计	127,586,759,288.32	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		1.66
	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	2,941,216,009.39	2.36
	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%。

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	72
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	110
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

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。

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	41.84	2.38
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	16.91	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	18.18	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	3.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	21.80	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		101.81	2.38

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

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240 天。

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	5,119,852,205.22	4.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,203,048,826.01	2.57
	其中:政策性金融债	3,203,048,826.01	2.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	90,000,148.35	0.07
6	中期票据	10,005,827.24	0.01
7	同业存单	25,779,060,100.47	20.70
8	其他	-	-
9	合计	34,201,967,107.29	27.47
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	120312	12进出12	16,300,000	1,633,199,163.34	1.31
2	111913042	19浙商银行CD042	15,000,000	1,478,507,565.46	1.19
3	090208	09国开08	12,100,000	1,209,711,248.65	0.97
4	111814152	18江苏银行CD152	10,000,000	995,431,796.99	0.80
5	111883001	18重庆农村商行CD076	10,000,000	995,369,624.74	0.80
6	111909174	19浦发银行CD174	10,000,000	994,056,210.90	0.80
7	199921	19贴现国债21	9,700,000	966,477,204.43	0.78
8	111994126	19徽商银行CD025	9,500,000	943,466,262.14	0.76
9	111813117	18浙商银行CD117	9,000,000	898,175,830.05	0.72
10	111813139	18浙商银行CD139	7,000,000	698,978,827.30	0.56

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	0.0546%
报告期内偏离度的最低值	0.0008%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0265%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到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

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到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名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	156794	信泽01A2(总价)	2,870,000.00	287,000,000.00	0.23
2	159180	信泽02A1(总价)	310,000.00	31,000,000.00	0.02

7.9投资组合报告附注

7.9.1基金计价方法说明

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。

7.9.2本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

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	16,362.28
2	应收证券清算款	200,000,000.00
3	应收利息	814,723,469.76
4	应收申购款	-
5	其他应收款	397.86
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,014,740,229.90

7.9.4投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因 ,合计数可能不等于分项之和。

§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		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华宝添益	41,162	2,400,278.46	80,714,215,830.15	81.69%	18,086,046,073.17	18.31%
华宝添益B	67	383,904,190.04	25,721,580,732.87	100.00%	0.00	0.00%
合计	41,229	3,020,248.92	106,435,796,563.02	85.48%	18,086,046,073.17	14.52%

8.2期末上市基金前十名持有人

华宝添益

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	高盛国际—自有资金	36,177,393.00	3.66%
2	MERRILL LYNCH INTERNATIONAL	17,500,991.00	1.77%
3	上海汽车集团财务有限责任公司	14,973,094.00	1.52%
4	中信信托有限责任公司—中信信托锐进43期高毅晓峰投资集合资金信托计划	13,334,884.00	1.35%
5	中国国际金融香港资产管理有限公司—客户资金	13,257,416.00	1.34%
6	易方达资产管理(香港)有限公司—客户资金(交易所)	12,531,926.00	1.27%
7	上海保银投资管理有限公司—保银紫荆怒放私募基金	11,795,272.00	1.19%
8	泰康资产管理(香港)有限公司—客户资金	10,761,817.00	1.09%
9	上海保银投资管理有限公司—保银中国价值基金	9,732,069.00	0.99%
10	上海高毅资产管理合伙企业(有限合伙)—高毅晓峰2号致信基金	7,001,149.00	0.71%

注:1、华宝添益B类基金份额不上市交易。

2、此表中的基金份额数量按份额净值为100.00元进行披露。

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	其他机构	3,617,739,300.00	2.91%
2	银行类机构	3,532,966,692.57	2.84%
3	银行类机构	2,067,307,467.79	1.66%
4	银行类机构	2,066,416,967.51	1.66%
5	银行类机构	2,024,840,693.46	1.63%
6	银行类机构	2,007,313,604.68	1.61%
7	银行类机构	2,002,458,275.84	1.61%
8	其他机构	1,750,099,100.00	1.41%
9	其他机构	1,497,309,400.00	1.20%
10	信托类机构	1,333,488,400.00	1.07%

注:

1、持有份额由1~10依次按照市值由大到小排列;

2、占比=持有份额÷总份额(该总份额为场内份额和场外份额直接相加所得)。

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	华宝添益	100.00	0.0000%
	华宝添益B	0.00	0.0000%
	合计	100.00	0.0000%

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	华宝添益	0
	华宝添益B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝添益	0
	华宝添益B	0
	合计	0

§9开放式基金份额变动

单位:份

	华宝添益	华宝添益B
基金合同生效日(2012年12月27日)基金份额总额	18,026,280.00	-
本报告期期初基金份额总额	107,543,588,977.32	23,743,529,167.62
本报告期期间基金总申购份额	54,951,741,170.13	156,816,027,802.89
减:本报告期期间基金总赎回份额	63,695,068,244.13	154,837,976,237.64
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	98,800,261,903.32	25,721,580,732.87

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。

§10 重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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、基金管理人的重大人事变动
本报告期内,基金管理人无重大人事变动。
2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
托管人中国建设银行2019年6月4日发布公告,聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为:本基金合同生效之日起至本报告期末。

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,管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
上海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

注:1.基金管理人选择交易单元的标准和程序如下:

(1)选择标准: 资力雄厚,信誉良好,注册资本不少于5亿元人民币;财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;经营行为规范,最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚;内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务;研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告;适当的地域分散化。

(2)选择程序:(a)服务评价;(b)拟定备选交易单元;(c)签约。

2.本期交易单元未发生变化。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
上海证券	-	-	54,152,000,000.00	9.71%	-	-
国信证券	-	-	7,240,700,000.00	1.30%	-	-
东方证券	-	-	140,330,900,000.00	25.17%	-	-
安信证券	-	-	81,644,300,000.00	14.65%	-	-
华泰证券	200,361,014.69	100.00%	243,383,000,000.00	43.66%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	30,675,400,000.00	5.50%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

10.8偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过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

无。

11.2影响投资者决策的其他重要信息

产品:基金管理人于2019 年3 月26 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下货币市场基金修订基金合同有关条款的公告》,公司根据有关法律法规和基金合同的规定对旗下货币市场基金(包括华宝现金宝货币市场基金及华宝现金添益交易型货币市场基金)基金合同有关条款进行修订并相应修订了托管协议,具体修订内容详见公司公告,请投资者予以关注。

华宝基金管理有限公司
2019年8月29日