汇添富添富通货币市场基金
2017 年半年度报告摘要

2017 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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 2017 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

基金简称	汇添富添富通货币		
基金主代码	000366		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 1 月 16 日		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	14,138,468,529.16 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	汇添富添富通货币 A	汇添富添富通货币 B	汇添富添富通货币 E
下属分级基金场内简称:	-	-	现金添富
下属分级基金的交易代码:	000366	000980	511980
报告期末下属分级基金的份额总额	242,970,734.77 份	13,854,198,329.59 份	41,299,464.80 份

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	活期存款利率（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。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、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		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

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 21 楼 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

金额单位：人民币元

基金级别	汇添富添富通货币 A	汇添富添富通货币 B	汇添富添富通货币 E
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 ）	报告期（2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日）	报告期（ 2017 年 1 月 1 日 -2017 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	4,074,008.12	262,790,731.89	86,919,826.71
本期利润	4,074,008.12	262,790,731.89	86,919,826.71
本期净值收益率	1.5797%	1.7008%	1.5788%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（ 2017 年 6 月 30 日 ）		
期末基金资产净值	242,970,734.77	13,854,198,329.59	4,129,946,479.72
期末基金份额净值	1	1	100

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，公允价值变动损益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、上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 A 类、B 类份额的收益分配按月结转份额；E 类份额以每百份基金为基金，每日计算收益并分配，计入投资人收益账户。

4、自 2015 年 10 月 16 日起，汇添富添富通货币市场基金增设 E 类份额类别，本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

汇添富添富通货币 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	0.3092%	0.0005%	0.0288%	0.0000%	0.2804%	0.0005%

过去三个月	0.8703%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.7830%	0.0008%
过去六个月	1.5797%	0.0011%	0.1736%	0.0000%	1.4061%	0.0011%
过去一年	2.8279%	0.0013%	0.3498%	0.0000%	2.4781%	0.0013%
自基金合同生效日起至今	7.0423%	0.0017%	0.8615%	0.0000%	6.1808%	0.0017%

汇添富添富通货币 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	0.3290%	0.0005%	0.0288%	0.0000%	0.3002%	0.0005%
过去三个月	0.9307%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.8434%	0.0008%
过去六个月	1.7008%	0.0011%	0.1736%	0.0000%	1.5272%	0.0011%
过去一年	3.0723%	0.0013%	0.3498%	0.0000%	2.7225%	0.0013%
自基金合同生效日起至今	7.6433%	0.0017%	0.8615%	0.0000%	6.7818%	0.0017%

汇添富添富通货币 E

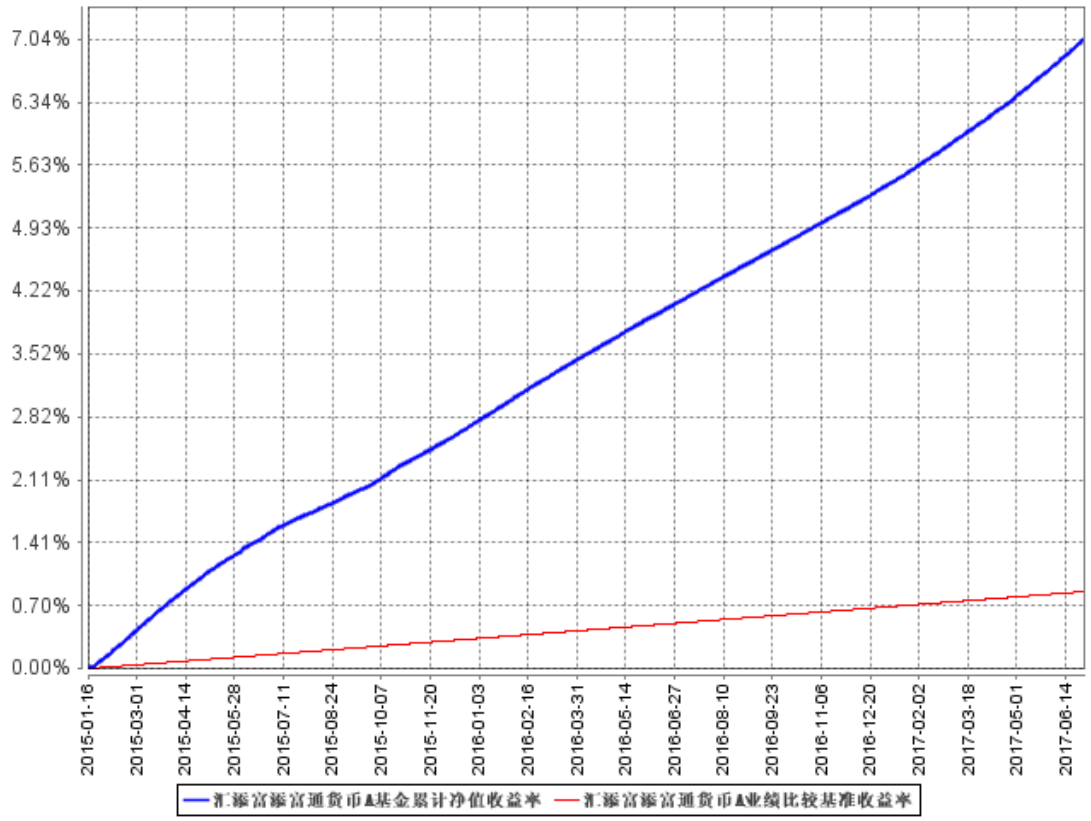
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.3091%	0.0005%	0.0288%	0.0000%	0.2803%	0.0005%
过去三个月	0.8698%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.7825%	0.0008%
过去六个月	1.5788%	0.0011%	0.1736%	0.0000%	1.4052%	0.0011%
过去一年	2.8262%	0.0013%	0.3498%	0.0000%	2.4764%	0.0013%
自基金合同生效日起至今	4.6932%	0.0012%	0.5926%	0.0000%	4.1006%	0.0012%

注：1、汇添富新收益债券型证券投资基金从 2015 年 1 月 16 日起正式转型为汇添富添富通货币市场基金，本表列示的是本报告期基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

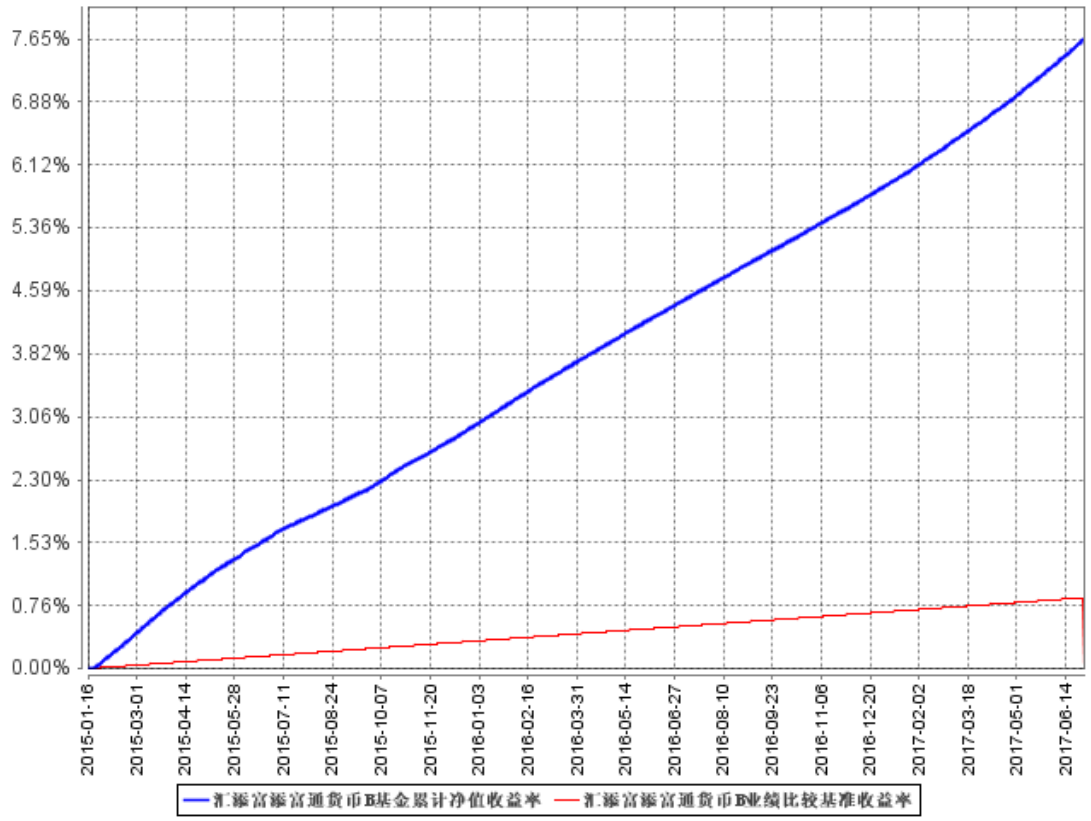
2、汇添富添富通货币市场基金 E 类合同生效日为 2015 年 10 月 16 日。

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

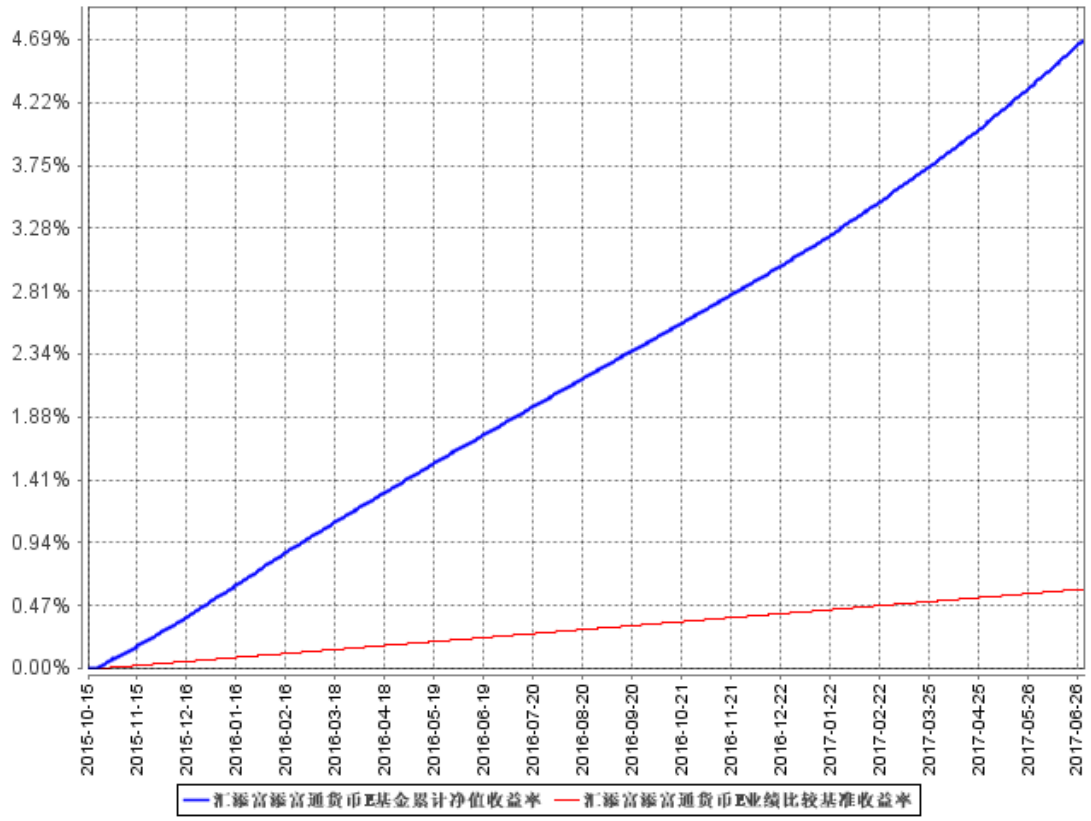
汇添富添富通货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



汇添富添富通货币B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



汇添富添富通货币E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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2015 年 1 月 16 日）起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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 2017 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 2898.83 亿元，有效客户数约 1500 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 85 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。

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		
蒋文玲	汇添富货币基金、现金宝货币基金、添富通货币基金、理财 14	2016 年 6 月 7 日	-	11 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

	天债券基金、理财30天债券基金、理财60天债券基金、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。				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、汇添富理财14天债券基金、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，2016年6月7日至今任汇添富货币基金、添富通货币基金、理财30天债券基金、理财60天债券基金、实业债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。

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。

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 8 次，由于组合投资策略导致，并经过公司内部风控审核。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

2017 年上半年宏观经济走势稳中趋缓，韧性强。经济数据方面，PMI 连续 9 个月在 51%以上高位震荡，制造业景气度同去年同期相比明显更好。尽管二季度企业补库存力量呈现边际减弱以及本轮房地产调控影响在一二线城市和部分热点区域开始显现，但主要发达体经济复苏带来我国出口贸易的恢复和三四线房地产销售数据的突出表现对经济形成有效支撑。上半年债券市场收益率出现两次显著上扬，分别来自流动性和监管冲击。一季度央行在“稳健中性”基调下收紧货币条件，两次上调公开市场操作利率和 MLF 操作利率，银行间市场资金利率中枢向上抬升。一季度末受银行理财纳入 MPA 考核影响，市场面临较大的流动性压力。二季度在政治局维护金融安全会议的要求下，一行三会陆续出台防控金融风险的文件，央行要求提高穿透式监管、银监会发文“三套利”“四不当”、证监会摸底券商资金池产品和保监会规范万能险。监管声音的叠加、委外赎回的传闻和去杠杆的一致预期，对债券市场情绪造成巨大冲击。收益率曲线快速平坦化，甚至局部期限出现短暂的倒挂。10 年国债收益率最高攀升至 3.7%，10 年国开金融债收益率一度逼近 4.4%。与去年末相比，分别上行 60bp 和 70bp 左右。自 5 月份以来，前期的监管竞赛转向监管协调，流动性的持续充裕以及央行对 6 月流动性的预期管理，市场信心再度回暖，债券收益率自最高点普遍回落 20-40bp。银行存单在 6 月初触顶后回落更快幅度更大，3 个月期限的存单月内落差高达 70bp。

本基金上半年规模波动明显，一季度规模出现较为明显的萎缩，二季度规模略有增长。针对货币政策和监管形势的变化，组合对流动性管理更加严格谨慎，控制组合杠杆水平，灵活调整投资策略，合理控制债券比例。1 月份提高组合的信用债券比例，保持中性配置；2 月至 5 月连续降低组合的债券仓位，缩短组合剩余期限；6 月份应对规模增长适当提高组合的债券比例，存款铺排以短期限为主，以流动性管理作为重点。债券选择方面，以流动性较好的 AAA 债券和高评级同业存单为主，回避低资质和低流动性个券。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富添富通货币 A 的基金份额净值收益率为 1.5797%，本报告期汇添富添富通货币 B 的基金份额净值收益率为 1.7008%，本报告期汇添富添富通货币 E 的基金份额净值收益率为 1.5788%，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，债券市场面临的不确定因素仍然较多，但当前的收益率水平不必对后市过于担忧。前期的制造业景气度高峰已过，房地产投资下半年有望放缓，出口和消费不温不火，基本面

总体对债市有利。另一方面，监管环境依然是债券市场需要注意的最大风险点，防控金融风险推进金融去杠杆是很明确的监管目标。然而，一行三会对协调监管已达成共识，就算具体的政策路径存在变数，但节奏一定会更加温和有序。李克强总理在最近的经济形势专家和企业家座谈会上明确提出稳定宏观政策，稳定市场预期，稳定金融运行。在美元仍处于加息通道和美联储提前公布了“缩表”计划的形势下，稳定市场预期和稳定金融运行的重要性明显提升。在外汇占款企稳的背景下，央行稳定金融市场的能力也更加游刃有余，对流动性的管理也更加注重预期管理。在削峰填谷的操作思路下，下半年市场流动性环境预计好于上半年，市场资金利率的波幅有望缩窄。

证监会发布的《流动性管理征求意见稿》预计下半年能正式落地，其中对货币基金的流动性管理提出特别规定。我们将对此提前做好应对，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，保持投资组合充裕的流动性，严格控制组合的剩余期限和杠杆。具体操作上，投资策略更加灵活，合理配置组合的回购、同业存款、同业存单、短融和利率债的比例。在满足组合流动性和安全性的前提下，积极把握市场波动带来的机会，为持有人带来更好的收益。同时做好信用风险防范，对债券资质进行严格筛选，定期排查组合投资债券的信用风险。

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》以及中国证券监督管理委员会颁布的《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》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》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。

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、基金营运部和稽核监察部人员组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有丰富的证券基金行业从业经验，能够胜任估值决策工作，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理不介入基金日常估值业务，但可以参加估值小组会议，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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

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：场外基金份额的收益分配原则为“本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每日分配所得收益参与下一日的收益分配，每月集中进行支付，收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。”场内基金份额的收益分配原则为“本基金根据每日基金收益情况，以每百份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，计入投资人收益账户。收益分配方式为红利再投资，计入投资人收益账户，免收再投资的费用。投资人收益账户里的累计未付收益和其持有的基金份额一起参加当日的收益分配，并享有同等收益分配。” 本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日期间累计分配收益 353,784,566.72 元，均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，本基金托管人在对汇添富添富通货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，汇添富添富通货币市场基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富添富通货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富添富通货币市场基金 2017 年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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：汇添富添富通货币市场基金

报告截止日： 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	10,996,645,932.13	23,438,540,162.79
结算备付金	473,324,300.00	24,275,469.76
存出保证金	-	-
交易性金融资产	4,253,207,358.49	11,615,223,664.72
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	4,253,207,358.49	11,615,223,664.72
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	2,696,832,068.23	6,586,695,759.21
应收证券清算款	-	-
应收利息	61,468,496.37	194,751,348.57
应收股利	-	-
应收申购款	52,461,875.74	49,081,041.76
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	18,533,940,030.96	41,908,567,446.81
负债和所有者权益	**本期末 2017 年 6 月 30 日**	**上年度末 2016 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	299,914,430.13	849,596,750.15
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	4,186,327.75	13,090,153.24
应付托管费	1,395,442.57	4,363,384.40
应付销售服务费	872,751.88	3,041,488.25
应付交易费用	95,095.67	216,374.01

应交税费	-	-
应付利息	32,948.81	192,885.95
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	327,490.07	389,300.00
负债合计	306,824,486.88	870,890,336.00
所有者权益：		
实收基金	18,227,115,544.08	41,037,677,110.81
未分配利润	-	-
所有者权益合计	18,227,115,544.08	41,037,677,110.81
负债和所有者权益总计	18,533,940,030.96	41,908,567,446.81

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，本基金 A、B 类基金份额净值为 1.00 元，基金份额总额为 14,138,468,529.16 份，其中，A 类份额 242,970,734.77 份，B 类份额 13,854,198,329.59 份。本基金 E 类基金份额净值为 100 元，基金份额总额为 41,299,464.80 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富添富通货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	416,090,598.06	838,576,628.49
1.利息收入	419,373,364.21	838,602,166.93
其中：存款利息收入	300,487,397.13	620,710,549.79
债券利息收入	107,469,146.02	215,421,169.68
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	11,416,821.06	2,470,447.46
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-3,282,766.15	-25,538.44
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,282,766.15	-25,538.44
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	62,306,031.34	66,271,442.89
1．管理人报酬	33,023,599.71	-
2．托管费	11,007,866.55	28,497,482.41
3．销售服务费	8,288,001.33	30,246,540.19
4．交易费用	-	-
5．利息支出	9,675,244.17	7,137,477.26
其中：卖出回购金融资产支出	9,675,244.17	7,137,477.26
6．其他费用	311,319.58	389,943.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	353,784,566.72	772,305,185.60

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富添富通货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	41,037,677,110.81	-	41,037,677,110.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	353,784,566.72	353,784,566.72
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）	-22,810,561,566.73	-	-22,810,561,566.73
其中：1.基金申购款	64,278,200,745.81	-	64,278,200,745.81
2.基金赎回款	-87,088,762,312.54	-	-87,088,762,312.54
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）	-	-353,784,566.72	-353,784,566.72
五、期末所有者权益（基金净值）	18,227,115,544.08	-	18,227,115,544.08

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	17,494,225,152.42	-	17,494,225,152.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	772,305,185.60	772,305,185.60
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）	60,236,938,229.76	-	60,236,938,229.76
其中：1.基金申购款	152,065,336,644.56	-	152,065,336,644.56
2.基金赎回款	-91,828,398,414.80	-	-91,828,398,414.80
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）	-	-772,305,185.60	-772,305,185.60
五、期末所有者权益(基金净值)	77,731,163,382.18	-	77,731,163,382.18

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

汇添富添富通货币市场基金(以下简称“本基金”)是由汇添富新收益债券型证券投资基金转型而来。原汇添富新收益债券型证券投资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[2013]1197 号文《关于核准汇添富新收益债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人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 2013 年 12 月 10 日正式生效，首次设立募集规模为 398,350,312.89 基金份额。2015 年 1 月 9 日，汇添富新收益债券型证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论通过了关于汇添富新收益债券型证券投资基金转型相关事项的议案。该大会决议自该日起生效，基金管理人在五日内向

中国证监会履行相应备案手续。2015 年 1 月 15 日，基金管理人对汇添富新收益债券型证券投资基金进行份额折算。自汇添富新收益债券型证券投资基金基金份额折算日次日（即 2015 年 1 月 16 日）起，《汇添富添富通货币市场基金基金合同》生效，《汇添富新收益债券型证券投资基金基金合同》同时失效，汇添富新收益债券型证券投资基金正式变更为汇添富添富通货币市场基金。自 2015 年 1 月 16 日起，《汇添富添富通货币市场基金基金合同》正式生效，由汇添富新收益债券型证券投资基金基金净资产折算为汇添富添富通货币市场基金 A 类 16,411,447.28 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，注册登记机构为汇添富基金管理股份有限公司与中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经中国证监会 2015 年 9 月 25 日《关于准予汇添富添富通货币市场基金变更注册批复》，汇添富添富通货币市场基金进行变更注册，增设 E 类基金份额。增设基金份额后，本基金将分设 A 类基金份额、B 类基金份额和 E 类基金份额。其中 A 类、B 类基金份额为场外基金份额，注册登记机构为汇添富基金管理股份有限公司。A 类、B 类基金份额的基金账户最低余额为分别为 0.01 份和 5,000,000.00 份。若 A 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过 5,000,000.00 份时，本基金的登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额；若 B 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 5,000,000.00 份时，本基金的登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额。E 类基金份额为场内份额，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 类份额和 B 类份额基金收益为“每日分配，按月支付”，E 类份额基金收益为“每日分配、利随本清”。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/每百份基金已实现收益和七日年化收益率。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单，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，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、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。本基金的业绩比较基准为：活期存款利率（税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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

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、国家税务总局财税字[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。

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、基金销售机构、基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
东方证券股份有限公司	-	-	460,000,000.00	100.00%

注：本基金本报告期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：本基金本报告期和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：本基金本报告期末及上年度可比期间均无应支付关联方佣金。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	33,023,599.71	-
其中：支付销售机构的客户维护费	253,651.26	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.30%/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 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。

自 2015 年 9 月 25 日起至 2016 年 6 月 30 日止，本基金管理人不收取本基金的管理费；自 2016 年 7 月 1 日起，本基金管理人重新开始收取本基金的管理费。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,007,866.55	28,497,482.41

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。

计算方法如下： H=E×0.10%/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，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 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			
	汇添富添富通货币 A	汇添富添富通货币 B	汇添富添富通货币 E	合计
汇添富基金管理股份有限公司	70,042.78	795,396.92	1,698,217.39	2,563,657.09
东方证券股份有限公司	22.07	620.47	489,238.19	489,880.73
中国工商银行股份有限公司	148,928.68	794.64	0.00	149,723.32
合计	218,993.53	796,812.03	2,187,455.58	3,203,261.14
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	汇添富添富通货币 A	汇添富添富通货币 B	汇添富添富通货币 E	合计
汇添富基金管理股份有限公司	54,399.20	1,622,303.49	9,097,113.54	10,773,816.23
东方证券股份有限公司	832.39	0.00	773,512.94	774,345.33
中国工商银行股份有限公司	289,567.37	869.71	0.00	290,437.08
合计	344,798.96	1,623,173.20	9,870,626.48	11,838,598.64

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级的确认日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级的确认日起享受 B 类基金份额的费率。E 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%。三类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

H＝E×该类基金份额的年销售服务费率÷当年天数

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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 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	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-	844,000,000.00	129,660.28
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
中国工商银行股份有限公司	-	51,954,362.02	-	-	2,327,000,000.00	550,163.01

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：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比区间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

汇添富添富通货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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
东方证券股份有限公司	200,000,000.00	1.45%	0.00	0.00%

汇添富添富通货币 E

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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
东方证券股份有限公司	3,129,191.00	7.58%	3,087,409.00	4.27%

注：1、本基金关联方东方证券股份有限公司本报告期累计运用 1,200,000,000.00 元，申购本基金 B 类份额 1,200,000,000.00 份，申购费为 0；累计赎回 1,000,675,847.16 份，赎回费为 0。均符合招募说明书的规定。期间累计获得分红转投份额 675,847.16 份。

2、本基金关联方东方证券股份有限公司本报告期累计运用 2,115,479,800.00 元，申购本基金 E 类份额 21,154,798.00 份，申购费为 0，均符合招募说明书的规定。期间累计获得分红转投份额 46,984.00 份，从二级市场累计卖出 21,160,000.00 份。

3、本基金 E 类基金份额面值为人民币 100 元。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
中国工商银行股份有限公司	2,645,932.13	59,566.00	66,911,469.42	209,213.56

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.9 期末（ 2017 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

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 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

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
130216	13国开16	2017年7月7日	99.51	3,157,000	314,145,348.82
合计				3,157,000	314,145,348.82

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有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

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	4,253,207,358.49	22.95
	其中：债券	4,253,207,358.49	22.95
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,696,832,068.23	14.55
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	171,372,000.03	0.92
3	银行存款和结算备付金合计	11,469,970,232.13	61.89
4	其他各项资产	113,930,372.11	0.61
5	合计	18,533,940,030.96	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	3.12	
	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	299,914,430.13	1.65
	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	70
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	84
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本货币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	26.49	1.65
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	17.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	15.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.36	-
4	90 天(含)—120 天	33.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.09	-
5	120 天(含)—397 天（含）	7.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		101.06	1.65

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：本报告期内本货币基金投资组合平均剩余存续期未超过 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	977,302,415.81	5.36
	其中：政策性金融债	977,302,415.81	5.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	748,938,991.10	4.11
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,526,965,951.58	13.86
8	其他	-	-
9	合计	4,253,207,358.49	23.33
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	629,025,975.88	3.45

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	130242	13 国开 42	4,300,000	430,460,756.92	2.36
2	130216	13 国开 16	3,500,000	348,276,439.93	1.91
3	120227	12 国开 27	2,000,000	198,565,218.96	1.09
4	111696553	16 成都农商银行 CD018	2,000,000	198,168,216.67	1.09
5	111780316	17 盛京银行 CD133	2,000,000	197,901,727.45	1.09
6	111710297	17 兴业银行 CD297	2,000,000	197,885,522.58	1.09
7	111717116	17 光大银行 CD116	2,000,000	197,726,044.27	1.08
8	111698224	16 长沙银行 CD089	2,000,000	196,580,388.39	1.08
9	111715213	17 民生银行 CD213	1,900,000	188,029,386.23	1.03
10	011698635	16 河钢 SCP004	1,500,000	150,479,317.65	0.83

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	0.1698%
报告期内偏离度的最低值	-0.0392%

报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0696%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内无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

注：本基金本报告期内无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每日计提利息，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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

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	61,468,496.37
4	应收申购款	52,461,875.74
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	113,930,372.11

§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
汇添富添富通货币 A	6,610	36,758.05	66,877,741.90	27.53%	176,092,992.87	72.47%
汇添富添富通货币 B	86	161,095,329.41	13,842,937,862.06	99.92%	11,260,467.53	0.08%
汇添富添富通货币 E	2,235	18,478.51	34,228,255.95	82.88%	7,071,208.85	17.12%
合计	8,931	1,583,077.88	13,944,043,859.91	98.62%	194,424,669.25	1.38%

8.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富添富通货币 E

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	幸福人寿保险股份有限公司－万能险	3,239,630.00	7.84%

2	东方证券股份有限公司	3,129,191.00	7.58%
3	国泰人寿保险股份有限公司－自有资金	2,904,285.00	7.03%
4	天安财产保险股份有限公司	2,527,028.00	6.12%
5	天安财产保险股份有限公司－14 次级定期债务	2,122,308.00	5.14%
6	大信资产运用株式会社－大信中国安盈私募基金	1,251,573.00	3.03%
7	上海东方证券创新投资有限公司	1,000,171.00	2.42%
8	黑龙江联合石油化工有限公司	1,000,000.00	2.42%
9	狄艳平	1,000,000.00	2.42%
10	申万菱信基金－工商银行－申万菱信－汇成 3 号资产管理计划	930,322.00	2.25%

8.3 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	汇添富添富通货币 A	202.08	0.00%
	汇添富添富通货币 B	0.00	0.00%
	汇添富添富通货币 E	0.00	0.00%
	合计	202.08	0.00%

8.4 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	汇添富添富通货币 A	0
	汇添富添富通货币 B	0
	汇添富添富通货币 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富添富通货币 A	0
	汇添富添富通货币 B	0
	汇添富添富通货币 E	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇添富添富通货币 A	汇添富添富通货币 B	汇添富添富通货币 E
基金合同生效日（2015 年 1 月 16 日）基金份额总额	16,411,447.28	-	-
本报告期期初基金份额总额	306,254,630.24	33,497,805,092.54	72,336,173.88
本报告期基金总申购份额	297,948,573.77	54,676,521,845.33	93,037,303.27
减:本报告期基金总赎回份额	361,232,469.24	74,320,128,608.28	124,074,012.35
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	242,970,734.77	13,854,198,329.59	41,299,464.80

注：其中“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.《汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 25 日正式生效，韩贤旺先生任该基金的基金经理。

2.基金管理人于 2017 年 2 月 4 日公告，增聘欧阳沁春先生和杨瑨先生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，与韩贤旺先生共同管理该基金。

3.《汇添富鑫利债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 13 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。

4.基金管理人于 2017 年 3 月 10 日公告，李骁先生任基金管理人副总经理。

5.《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基金合同》于 2017 年 3 月 15 日正式生效，顾耀强先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。

6.基金管理人于 2017 年 3 月 16 日公告，增聘吴江宏先生担任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的基金经理，与顾耀强先生共同管理该基金。

7.《汇添富中国高端制造股票型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 20 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。

8.《汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 14 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。

9.《汇添富精选美元债债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，何旻先生和高欣先生任该基金的基金经理。

10.《汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。

11.《汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。

12.《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 15 日正式生效，曾刚先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。

13.基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，聘任郑慧莲女士为汇添富年年丰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和汇添富 6 月红添利定期开放债券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。

14.基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理该基金。

15.基金管理人 2017 年 6 月 21 日公告，雷鸣先生不再担任汇添富新兴消费股票型证券投资基金的基金经理，由刘伟林先生单独管理该基金。

16.《汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 6 月 23 日正式生效，吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。

17.本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。
本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

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。
本报告期内托管人及其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		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	
东方证券	3	-	-	-	-	-

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		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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
东方证券	-	-	-	-	-	-

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：本基金本报告期内未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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年3月3日至2017年3月6日，2017年4月6日	3,014,126,880.00	31,955,841.27	3,046,082,721.00	0.00	0.00%
	2	2017年4月7日至	0.00	4,010,880,484.00	3,000,000,000.00	1,010,880,484.00	7.16%

		2017 年 4 月 13 日					
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险
1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。 2、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。 3、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。 4、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。 5、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

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

2017 年 8 月 26 日