

海富通添益货币市场基金
2018 年半年度报告
2018 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 债券回购融资情况	36
7.3 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.4 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	38
7.5“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	39
7.7 投资组合报告附注	39
§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末上市基金前十名持有人	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	错误!未定义书签。
§9 开放式基金份额变动	41

§10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	错误!未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变.....	错误!未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	错误!未定义书签。
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	43
10.9 其他重大事件.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息	44
§12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通添益货币市场基金	
基金简称	海富通添益货币	
基金主代码	004770	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2017 年 8 月 14 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	15,133,052,863.35 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通添益货币 A	海富通添益货币 B
下属分级基金的交易代码	004770	004771
报告期末下属分级基金的份额总额	291,930,424.90 份	14,841,122,438.45 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力争本金安全和保持基金资产较好流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金投资策略将审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，力求将各类风险降到最低，在控制投资组合良好流动性的前提下为投资者获取稳定的收益。
业绩比较基准	中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率（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，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、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		海富通基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	曾麓燕
	联系电话	021-38650891	021-52629999-212040
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	015292@cib.com.cn

客户服务电话	40088-40099	95561
传真	021-33830166	021-62535823
注册地址	上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层	福建省福州市湖东路154号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层	上海市江宁路168号兴业大厦20楼
邮政编码	200120	200041
法定代表人	张文伟	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	海富通基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

§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（2018年1月1日至2018年6月30日）	
	海富通添益货币 A	海富通添益货币 B
本期已实现收益	3,438,735.29	209,751,480.41
本期利润	3,438,735.29	209,751,480.41
本期净值收益率	2.2629%	2.3823%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	

	海富通添益货币 A	海富通添益货币 B
期末基金资产净值	291,930,424.90	14,841,122,438.45
期末基金份额净值	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
	海富通添益货币 A	海富通添益货币 B
累计净值收益率	3.4007%	2.6398%

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、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

3、本基金收益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

1. 海富通添益货币 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	0.3289%	0.0005%	0.0287%	0.0000%	0.3002%	0.0005%
过去三个月	1.0422%	0.0011%	0.0871%	0.0000%	0.9551%	0.0011%
过去六个月	2.2629%	0.0026%	0.1734%	0.0000%	2.0895%	0.0026%
自基金合同 生效起至今	3.4007%	0.0043%	0.3077%	0.0000%	3.0930%	0.0043%

2. 海富通添益货币 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	0.3487%	0.0006%	0.0287%	0.0000%	0.3200%	0.0006%

过去三个月	1.1023%	0.0011%	0.0871%	0.0000%	1.0152%	0.0011%
过去六个月	2.3823%	0.0026%	0.1734%	0.0000%	2.2089%	0.0026%
自基金合同生效起至今	2.6398%	0.0067%	0.3077%	0.0000%	2.3321%	0.0067%

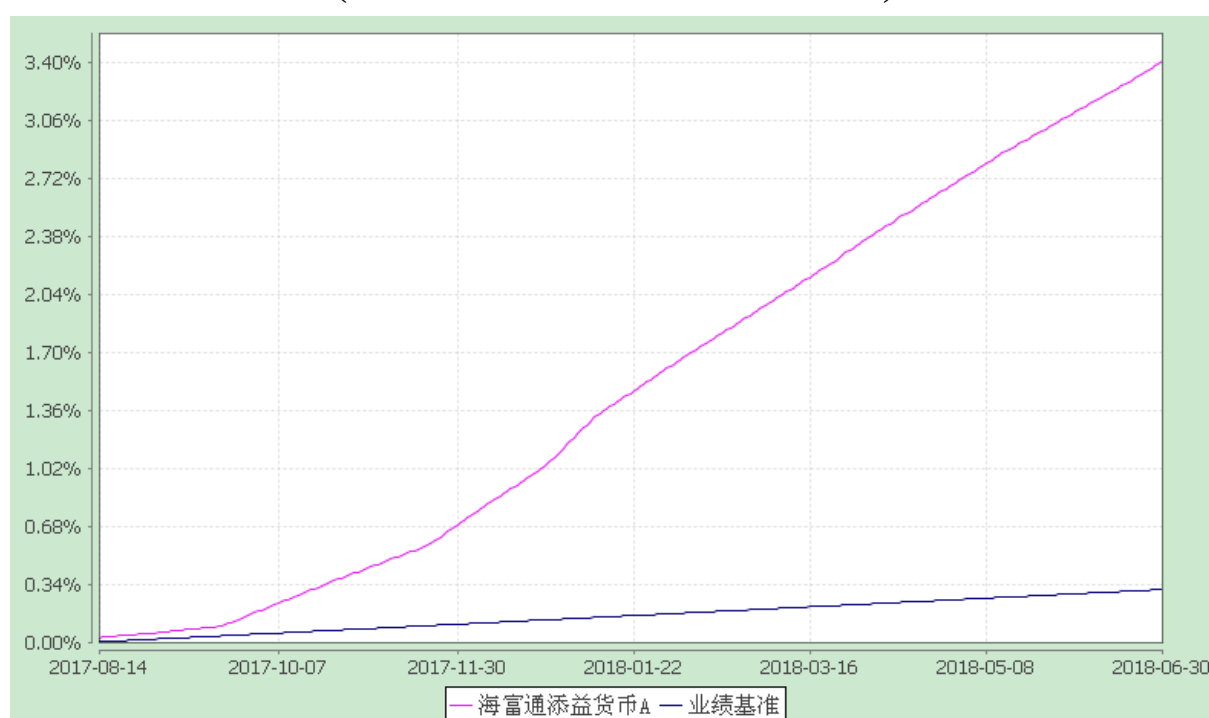
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通添益货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

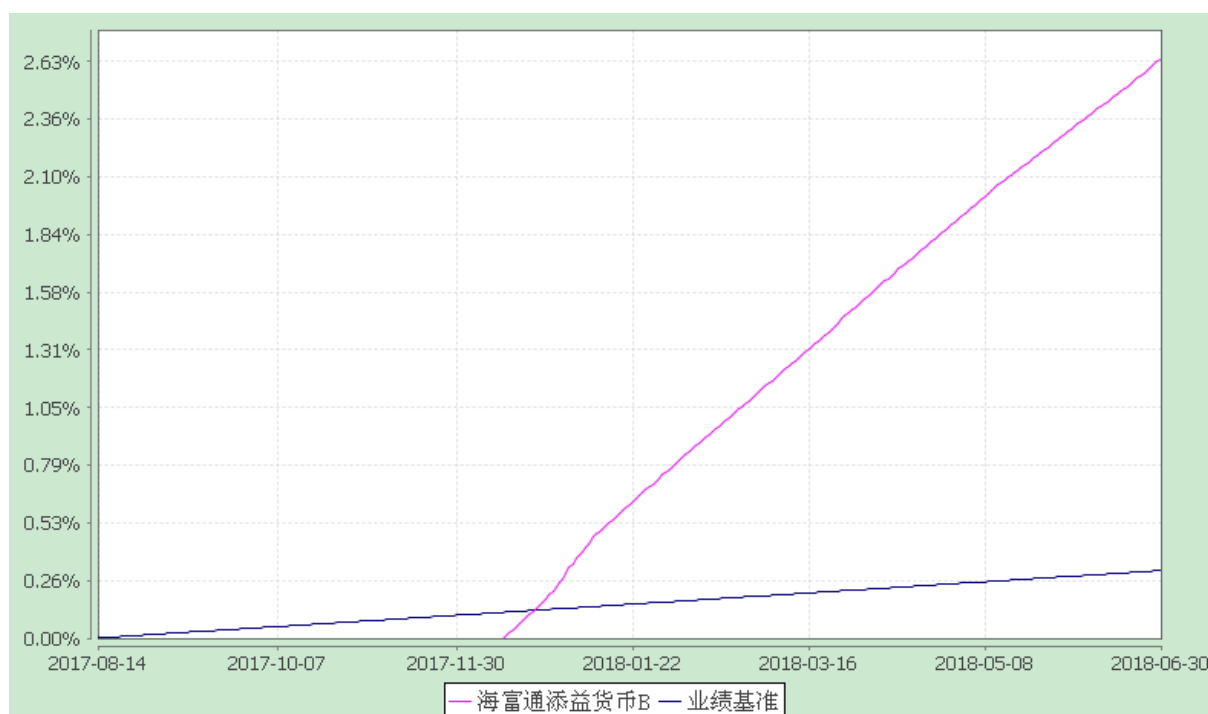
1. 海富通添益货币 A

(2017 年 8 月 14 日至 2018 年 6 月 30 日)



2. 海富通添益货币 B

(2017 年 8 月 14 日至 2018 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2017 年 8 月 14 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

§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

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 54 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券

投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双福债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通富睿混合型证券投资基金、海富通欣悦灵活配置混合型证券投资基金、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、海富通瑞福一年定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
何谦	本基金的基金经理；海富通集利债券基金经理；海富通纯债债券基金经理；海富通货币基金经理；海富通双福债券基金经理。	2017-08-14	-	7 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任平安银行资金交易员，华安基金管理有限公司债券交易员，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司，任海富通货币基金经理助理。2016 年 5 月至 2017 年 10 月兼任海富通双利债券基金经理。2016 年 5 月起任海富通纯债债券、海富通双福债券（原海富通双福分级债券）及海富通货币基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通集利债券基金经理。2017 年 8 月起兼任海富通添益货

					币基金经理。
刘田	本基金的基金经理助理；海富通聚利债券基金经理助理；海富通集利债券基金经理助理；海富通瑞利债券基金经理助理；海富通瑞合纯债基金经理助理；海富通瑞丰一年定开债券基金经理助理；海富通融丰定开债券基金经理助理。	2017-11-17	-	2 年	管理学学士，持有基金从业人员资格证书。曾任上海银行同业客户经理，2016 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，2016 年 8 月至 2017 年 11 月任海富通瑞益债券的基金经理助理。2016 年 8 月起任海富通瑞丰一年定开债券的基金经理助理。2016 年 9 月起兼任海富通聚利债券的基金经理助理。2016 年 12 月起兼任海富通集利债券的基金经理助理。2017 年 2 月起兼任海富通瑞利债券的基金经理助理。2017 年 4 月起兼任海富通瑞合纯债的基金经理助理。2017 年 11 月起兼任海富通添益货币的基金经理助理。2018 年 2 月起兼任海富通融丰定开债券的基金经理助理。

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生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

公司根据证监会 2011 年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度，公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部门、监察稽核部和风险管理部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证本报告期内公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年的债券市场呈现利率牛市、信用分化的特征。从宏观层面看，上半年政策仍延续“去杠杆”的思路，经济总体保持韧性但边际趋弱，通胀表现温和。具体来看，上半年工业生产相对旺盛，制造业投资尤其是中上游行业在盈利驱动下有所回暖，而基建投资受非标和融资渠道收紧的影响逐月下滑；房地产投资虽在前期土地购置费的支撑下保持高增速，但在政策和资金压力下动能也在转弱。融资方面，资管新规后表外融资渠道的收缩并未伴随着表内信贷增速的明显上行，社融增速出现下滑，“紧信用”对实体的压力正在逐步显现。此外，上半年中美贸易摩擦不断，外围环境的变化也对经济产生一定的不确定性。在这种宏观背景下，上半年央行货币政策态度产生了边际变化，为对冲金融收紧和经济下行的风险，央行实行稳健偏松的货币政策，并多次定向降准，缓解银行负债端压力和支持小微企业融资。

上半年,我们主动配置了高收益的存单,卖出了所有信用债,增加了回购占比,选择了哑铃型态以兼顾流动性和收益率,规模稳步增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值收益率为 2.2629%，同期业绩比较基准收益率为 0.1734%。本基金 B 类份额净值收益率为 2.3823%，同期业绩比较基准收益率为 0.1734%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从基本面看，下半年经济存在一些回落压力。土地购置费支撑房地产投资的效应大

概率在下半年逐步消退，在房地产企业融资渠道受限、棚户区改造规模增速放缓的背景下，下半年房地产投资或有所转弱。下半年财政支出和地方债发行或加速，基建投资增速或保持相对平稳甚至小幅反弹。而在中美贸易摩擦、欧美经济走势分化等背景下，外需存在一定的变数。通胀方面，下半年通胀中枢或较 2017 年温和抬升，市场对通胀的预期已明显弱化，关注原油价格和中美贸易摩擦等不确定因素的影响。政策方面，紧信用环境下实体经济融资难度和成本提高，为对冲经济的下滑，下半年货币政策或延续稳健偏松和灵活操作，定向降准仍有空间，但在美联储加息和人民币汇率可能承压的背景下，货币政策或面临一定制约。上半年受资本充足率、信贷额度和行业等方面的限制，表外融资渠道转表内的过程并不顺畅，下半年信贷政策存在结构性放松的可能。在上述判断下，我们认为下半年利率仍有进一步下行的机会和空间，可积极参与利率债交易，但要把握节奏，密切关注资管新规细则落地的影响和人民币汇率的走势。

下半年,将继续关注存款、存单的配置机会。维持稳定的收益率，规避风险。

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》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会下设估值工作小组，估值工作小组对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、本基金本报告期内应分配：货币 A 级 3,438,735.29 元，货币 B 级 209,751,480.41 元。

二、已实施的利润分配：货币 A 级已分配 3,368,413.40 元，货币 B 级已分配 205,962,414.60 元。

三、应分配但尚未实施的利润：已分配但未支付的 3,859,387.70 元。应于收益支付日 2018 年 7 月 1 日按 1.000 元的份额面值结转为基金份额。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，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

本托管人认真复核了本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、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：海富通添益货币市场基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	8,613,356,994.14	789,390,916.82
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	3,752,640,385.19	851,896,289.92
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,752,640,385.19	851,896,289.92
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,969,499,334.23	700,734,811.10
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	101,124,576.04	6,952,712.13
应收股利		-	-
应收申购款		64,000.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		16,436,685,289.60	2,348,974,729.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,296,151,472.17	338,011,892.97
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		177,995.31	-
应付管理人报酬		1,982,520.78	128,192.44
应付托管费		660,840.25	42,730.84
应付销售服务费		200,211.64	69,660.53
应付交易费用	6.4.7.7	159,231.56	32,684.40
应交税费		-	-
应付利息		241,637.34	177,048.10
应付利润		3,859,387.70	1,103,067.25
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	199,129.50	178,875.25
负债合计		1,303,632,426.25	339,744,151.78

所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	15,133,052,863.35	2,009,230,578.19
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		15,133,052,863.35	2,009,230,578.19
负债和所有者权益总计		16,436,685,289.60	2,348,974,729.97

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 15,133,052,863.35 份，其中 A 级基金份额 291,930,424.90 份，其中 B 级基金份额 14,841,122,438.45 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通添益货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		227,040,784.60
1.利息收入		219,165,530.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	105,599,469.12
债券利息收入		56,732,289.58
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		56,833,772.22
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,855,189.68
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	7,855,189.68
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
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）	6.4.7.14	20,064.00

减：二、费用		13,850,568.90
1. 管理人报酬		7,027,050.14
2. 托管费		2,342,349.99
3. 销售服务费		662,411.46
4. 交易费用	6.4.7.15	-
5. 利息支出		3,565,155.59
其中：卖出回购金融资产支出		3,565,155.59
6.税金及附加		7,203.04
7. 其他费用	6.4.7.16	246,398.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		213,190,215.70
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		213,190,215.70

注：本基金合同成立于 2017 年 8 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通添益货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,009,230,578.19	-	2,009,230,578.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	213,190,215.70	213,190,215.70
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）	13,123,822,285.16	-	13,123,822,285.16
其中：1.基金申购款	26,162,642,356.73	-	26,162,642,356.73
2.基金赎回款	-13,038,820,071.57	-	-13,038,820,071.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-213,190,215.70	-213,190,215.70

净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	15,133,052,863.35	-	15,133,052,863.35

本基金合同成立于 2017 年 8 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

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：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：陶网雄，会计机构负责人：胡正万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通添益货币市场基金(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[2017]第 739 号《关于准予海富通添益货币市场基金注册的批复》注册，由海富通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《海富通添益货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 250,002,452.54 元，已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 798 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通添益货币市场基金基金合同》于 2017 年 8 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 250,002,452.77 份基金份额，其中认购资金利息折合 0.23 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)。

根据《海富通添益货币市场基金招募说明书》，本基金根据基金份额持有人持有本基金的份额数量，对基金份额持有人持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费，并因此形成不同的基金份额类别。按照 0.25%年费率计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；按照 0.01%年费率计提销售服务费的基金份额类别的，称为 B 类基金份额。A 类、B 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告两类基金每万份基金已实现收益和七日年化收益率。投资者可自行选择认购或申购基金份额类别。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《海富通添益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；一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；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中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2018 年 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通添益货币市场基金基金合同》和中国证监会、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 2018 年上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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政

府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(d) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	1,356,994.14
定期存款	8,612,000,000.00
存款期限 1-3 个月	4,670,000,000.00
存款期限 3 个月以上	3,942,000,000.00
其他存款	-
合计	8,613,356,994.14

注：定期存款的存款期限为定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	3,752,640,385.19	3,755,672,000.00	3,031,614.81	0.0200
	合计	3,752,640,385.19	3,755,672,000.00	3,031,614.81	0.0200

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	3,969,499,334.23	-
合计	3,969,499,334.23	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	31,014.15
应收定期存款利息	70,785,000.58
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	19,932,846.58
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	10,375,714.73
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	101,124,576.04

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	159,231.56
合计	159,231.56

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	190,736.60
其他应付款	8,392.90
合计	199,129.50

6.4.7.9 实收基金**海富通添益货币 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,925,601.20	3,925,601.20
本期申购	2,196,719,437.66	2,196,719,437.66
本期赎回（以“-”号填列）	-1,908,714,613.96	-1,908,714,613.96
本期末	291,930,424.90	291,930,424.90

海富通添益货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,005,304,976.99	2,005,304,976.99
本期申购	23,965,922,919.07	23,965,922,919.07
本期赎回（以“-”号填列）	-11,130,105,457.61	-11,130,105,457.61
本期末	14,841,122,438.45	14,841,122,438.45

注：申购含红利再投及分级份额调增份额；赎回含分级份额调减份额。

6.4.7.10 未分配利润

海富通添益货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	3,438,735.29	-	3,438,735.29
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,438,735.29	-	-3,438,735.29
本期末	-	-	-

海富通添益货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	209,751,480.41	-	209,751,480.41
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-209,751,480.41	-	-209,751,480.41
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	82,667.37
定期存款利息收入	105,516,801.75
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	-
其他	0.00
合计	105,599,469.12

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,690,756,408.32
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,591,754,651.63
减：应收利息总额	91,146,567.01
买卖债券差价收入	7,855,189.68

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	20,064.00
合计	20,064.00

6.4.7.15 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	32,670.89
信息披露费	148,765.71
债券托管账户维护费	18,600.00
其他	275.00
银行划款手续费	46,087.08

合计	246,398.68
----	------------

6.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9关联方关系

6.4.9.1 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
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

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。

6.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易，基金合同成立于 2017 年 8 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易，基金合同成立于 2017 年 8 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方佣金。基金合同成立于 2017 年 8 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.2关联方报酬

6.4.10.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
----	----------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	7,027,050.14
其中：支付销售机构的客户维护费	36,099.88

注：1、支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 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 $\times$ 0.15% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2017 年 8 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,342,349.99

注：1、支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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 $\times$ 0.05% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2017 年 8 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通添益货币 A	海富通添益货币 B	合计
海通证券	110,631.83	266.95	110,898.78
海富通	24,314.63	459,029.32	483,343.95
合计	134,946.46	459,296.27	594,242.73

注：1、支付基金销售机构的 A 级基金份额和 B 级基金份额的销售服务费分别按前一日该类基金资产净值 0.25% 和 0.01% 的年费率计提。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 $\times$ 约定年费率 / 当年天数。

2、基金合同成立于 2017 年 8 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

基金合同成立于 2017 年 8 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 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 2018年1月1日至2018年6月30日	
	海富通添益货币A	海富通添益货币B
基金合同生效日 (2017年8月14日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	156,770,982.43
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	101,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	55,770,982.43
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.38%

注：1、申购含红利再投

2、基金合同成立于 2017 年 8 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.4.2 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

海富通添益货币 B

份额单位：份

关联方名称	海富通添益货币B本期末 2018年6月30日		海富通添益货币B上年度末 2017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

海通证券	775,617,624.68	5.23%	20,099,820.37	1.00%
------	----------------	-------	---------------	-------

6.4.10.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	1,356,994.14	82,667.37
兴业银行-定期	249,000,000.00	3,311,555.96

注：1、本基金的活期银行存款及部分定期银行存款由基金托管人兴业银行保管，按约定利率计息。于 2018 年 6 月 30 日，本基金存放于兴业银行的银行存款占基金资产净值的比例为 1.65%。

2、基金合同成立于 2017 年 8 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未通过关联方购买其承销的证券，基金合同成立于 2017 年 8 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况**1、海富通添益货币 A**

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
3,328,934.28	41,556.99	68,244.02	3,438,735.29	-

2、海富通添益货币 B

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
205,275,572.44	1,787,831.54	2,688,076.43	209,751,480.	-

			41	
--	--	--	----	--

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金在本报告期内未因新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

6.4.12.2 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暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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 1,296,151,472.17 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
111713095	17 浙商银行 CD095	2018-07-02	99.07	500,000	49,536,237.61
111890314	18 长沙银行 CD001	2018-07-02	99.83	1,000,000	99,827,757.73
111890786	18 重庆农村 商行 CD018	2018-07-02	97.56	1,000,000	97,563,385.81
111893186	18 江西银行 CD030	2018-07-02	99.06	200,000	19,811,449.29
111893952	18 贵州银行 CD013	2018-07-02	96.72	70,000	6,770,486.23
111894145	18 天津银行 CD095	2018-07-02	96.84	1,000,000	96,841,363.24
111898338	18 成都银行 CD136	2018-07-02	99.21	1,000,000	99,209,468.63
111898411	18 郑州银行 CD067	2018-07-02	95.82	1,000,000	95,824,623.95
111899944	18 贵阳银行 CD111	2018-07-02	96.75	75,000	7,255,972.02
130229	13 国开 29	2018-07-02	100.04	1,000,000	100,036,297.25
150418	15 农发 18	2018-07-02	100.03	300,000	30,010,243.73
170207	17 国开 07	2018-07-02	100.01	2,100,000	210,025,672.31
170410	17 农发 10	2018-07-02	100.02	500,000	50,012,330.31
189916	18 贴现国债 16	2018-07-02	99.89	700,000	69,923,902.51

189918	18 贴现国债 18	2018-07-02	99.84	82,000	8,187,040.67
189919	18 贴现国债 19	2018-07-02	99.78	1,500,000	149,664,013.14
111891761	18 广州银行 CD018	2018-07-03	99.55	1,520,000	151,320,417.61
合计				13,547,000	1,341,820,662.0 4

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和监察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的

银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的企业债券或长期信用评级在 AA+ 以下的其他债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
A-1	-	10,043,480.31
A-1 以下	-	-
未评级	879,669,213.21	109,968,818.38
合计	879,669,213.21	120,012,298.69

注：未评级部分为国债、政策性金融债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,872,971,171.98	672,115,571.16
合计	2,872,971,171.98	672,115,571.16

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-

未评级	-	59,768,420.07
合计	-	59,768,420.07

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2018 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 1,296,151,472.17 元将在 1 个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本

基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2018 年 6 月 30 日，本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 45.77%，本基金投资组合的平均剩余期限为 84 天，平均剩余存续期为 84 天。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	不计息	合计
资产				
银行存款	7,469,356,994.14	1,144,000,000.00	-	8,613,356,994.14
交易性金融资产	1,773,034,067.08	1,979,606,318.11	-	3,752,640,385.19
买入返售金融资产	3,969,499,334.23	-	-	3,969,499,334.23
应收利息	-	-	101,124,576.04	101,124,576.04
应收申购款	-	-	64,000.00	64,000.00
资产总计	13,211,890,395.45	3,123,606,318.11	101,188,576.04	16,436,685,289.60
负债				
卖出回购金融资产款	1,296,151,472.17	-	-	1,296,151,472.17
应付赎回款	-	-	177,995.31	177,995.31
应付管理人报酬	-	-	1,982,520.78	1,982,520.78
应付托管费	-	-	660,840.25	660,840.25
应付销售服务费	-	-	200,211.64	200,211.64
应付交易费用	-	-	159,231.56	159,231.56
应付利息	-	-	241,637.34	241,637.34
应付利润	-	-	3,859,387.70	3,859,387.70
其他负债	-	-	199,129.50	199,129.50
负债总计	1,296,151,472.17	-	7,480,954.08	1,303,632,426.25
利率敏感度缺口	11,915,738,923.28	3,123,606,318.11	93,707,621.96	15,133,052,863.35
上年度末 2017 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	不计息	合计
资产				
银行存款	739,390,916.82	50,000,000.00	-	789,390,916.82
交易性金融资产	851,896,289.92	-	-	851,896,289.92
买入返售金融资	700,734,811.10	-	-	700,734,811.10

产				
应收利息	-	-	6,952,712.13	6,952,712.13
资产总计	2,292,022,017.84	50,000,000.00	6,952,712.13	2,348,974,729.97
负债				
卖出回购金融资产款	338,011,892.97	-	-	338,011,892.97
应付管理人报酬	-	-	128,192.44	128,192.44
应付托管费	-	-	42,730.84	42,730.84
应付销售服务费	-	-	69,660.53	69,660.53
应付交易费用	-	-	32,684.40	32,684.40
应付利息	-	-	177,048.10	177,048.10
应付利润	-	-	1,103,067.25	1,103,067.25
其他负债	-	-	178,875.25	178,875.25
负债总计	338,011,892.97	-	1,732,258.81	339,744,151.78
利率敏感度缺口	1,954,010,124.87	50,000,000.00	5,220,453.32	2,009,230,578.19

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 4,130	增加约 50
	市场利率上升 25 个基点	减少约 4,113	减少约 50

注：金额为约数，精确到万元。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 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	3,752,640,385.19	22.83
	其中：债券	3,752,640,385.19	22.83
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,969,499,334.23	24.15
	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	8,613,356,994.14	52.40
4	其他各项资产	101,188,576.04	0.62
5	合计	16,436,685,289.60	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	3.75	
	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	1,296,151,472.17	8.57
	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银行间市场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	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	101
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	64

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内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	43.62	8.57
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	23.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	17.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	1.25	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天（含）	24.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	107.95	8.57

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

本基金本报告期内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	319,565,531.84	2.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	560,103,681.37	3.70
	其中：政策性金融债	560,103,681.37	3.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,872,971,171.98	18.98
8	其他	-	-
9	合计	3,752,640,385.19	24.80

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	111899944	18 贵阳银行 CD111	6,000,000	580,477,761.64	3.84
2	111880250	18 广东顺德农商行 CD054	3,000,000	290,301,795.37	1.92
3	170207	17 国开 07	2,700,000	270,033,007.26	1.78
4	111891761	18 广州银行 CD018	2,000,000	199,105,812.65	1.32
5	111898485	18 广东顺德农商行 CD052	2,000,000	193,909,125.56	1.28
6	189919	18 贴现国债 19	1,500,000	149,664,013.14	0.99
7	130229	13 国开 29	1,000,000	100,036,297.25	0.66
8	111890314	18 长沙银行 CD001	1,000,000	99,827,757.73	0.66

9	111806142	18 交通银行 CD142	1,000,000	99,390,703.57	0.66
10	111898328	18 宁波银行 CD103	1,000,000	99,209,468.63	0.66

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0584%
报告期内偏离度的最低值	-0.0102%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0166%

注：以上数据按交易日统计。

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

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

2007 年 7 月 1 日基金实施新会计准则后，本基金所持有的债券(包括票据)采用摊余成本法进行估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

7.9.2 报告期内本基金投资的 18 宁波银行 CD103（111898328）的发行人因深圳分行的商业汇票线下转贴现业务未按照规定记账、票据代理转贴现业务未按规定记账并计量风险加权资产等行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、《中华人民共和国商业银行法》第七十五条的法律规定，公司于 2017 年 7 月 14 日被中国银监会深圳银监局罚款 170 万元人民币。

对该证券的投资决策程序的说明：2017 年以来同业存单收益处于较高水平，信用风险很低，剩余期限较短，是理想的配置资产。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，

该证券被纳入本基金的实际投资组合。

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。

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	101,124,576.04
4	应收申购款	64,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	101,188,576.04

§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
海富通添益货币 A	4,933	59,179.08	59,686,073.25	20.45%	232,244,351.65	79.55%
海富通添益货币 B	94	157,884,281.26	14,790,986,705.97	99.66%	50,135,732.48	0.34%
合计	5,027	3,010,354.66	14,850,672,779.22	98.13%	282,380,084.13	1.87%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、B 级比例分母为各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 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	银行类机构	1,005,730,916.78	6.65%
2	银行类机构	1,002,648,472.19	6.63%
3	银行类机构	1,000,492,911.90	6.61%
4	银行类机构	801,828,384.28	5.30%
5	券商类机构	775,617,624.68	5.13%
6	券商类机构	505,583,907.36	3.34%
7	银行类机构	503,753,691.36	3.33%
8	保险类机构	501,267,625.06	3.31%
9	券商类机构	424,635,198.51	2.81%
10	保险类机构	402,063,410.12	2.66%

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	海富通添益货币 A	1,925,215.67	0.6595%
	海富通添益货币 B	-	-
	合计	1,925,215.67	0.0127%

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	海富通添益货币 A	10~50
	海富通添益货币 B	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通添益货币 A	0
	海富通添益货币 B	0
	合计	0

8.9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通添益货币 A	海富通添益货币 B
基金合同生效日（2017 年 8 月 14 日）基金份额总额	250,002,452.77	-
本报告期期初基金份额总额	3,925,601.20	2,005,304,976.99
本报告期基金总申购份额	2,196,719,437.66	23,965,922,919.07
减：本报告期基金总赎回份额	1,908,714,613.96	11,130,105,457.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	291,930,424.90	14,841,122,438.45

注：总申购含红利再投及分级份额调增份额；总赎回含分级份额调减份额。

§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、本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、本报告期内，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

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内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

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

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

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关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	
海通证券	1	-	-	0.00	0.00%	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算。

2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分,进行主观性评议,独立的评分,形成证券公司排名及交易单元租用意见。

(2)交易单元的选择程序本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择:

<1>推荐。投资部业务人员推荐,经投资部部门会议讨论,形成重点评估的证券公司备选池,从中进行甄选。原则上,备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

<2>甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定,进行主观性评议,独立的评分,形成证券公司排名及交易单元租用意见,并报公司总经理办公会核准。

<3>核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后,由基金管理人的总经理办公会核准。

3、本报告期内,本基金租用的券商交易单元未发生变更。

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		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
海通证券	-	-	580,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值未超过 0.5%。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司旗下基金 2017 年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-01-01
2	海富通基金管理有限公司关于海富通添益货币市场基金新增海通证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-01-04
3	海富通基金管理有限公司关于海富通添益货币市场基金新增上海天天基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-01-23
4	海富通基金管理有限公司关于代销机构暂停销售海富通添益货币市场基金 B 类份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-02-06
5	海富通添益货币市场基金春节长假前两个工作日暂停申购业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-02-09
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同、托管协议的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-03-24
7	海富通添益货币市场基金清明假期前两个工作日暂停申购业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-03-29
8	海富通基金管理有限公司关于海富通添益货币市场基金 A 类份额在海通证券股份有限公司暂停申购的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-03-30
9	海富通基金管理有限公司关于海富通添益货币市场基金 A 类份额在海通证券股份有限公司恢复申购的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-04-18
10	关于调整海富通添益货币市场基金 A 类份额单笔申购最低金额和单个基金账户最低持有份额限制的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-04-18

§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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 61 只公募基金。截至 2018 年 6 月 30

日，海富通管理的公募基金资产规模超过 574.03 亿元人民币。

2004 年末开始，海富通及子公司为 QFII（合格境外机构投资者）及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问，截至 2018 年 6 月 30 日，投资咨询及海外业务规模超过 32 亿元人民币。

作为国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，截至 2018 年 6 月 30 日，海富通为近 80 家企业超过 401 亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司，截至 2018 年 6 月 30 日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模超过 443 亿元。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 2 月，海富通资产管理（香港）有限公司已募集发行了首只 RQFII 产品。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2016 年 3 月，国内权威财经媒体《中国证券报》授予海富通基金管理有限公司“固定收益投资金牛基金公司”。2018 年 3 月，国内权威财经媒体《证券时报》授予海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金为第十三届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准设立海富通添益货币市场基金的文件
- （二）海富通添益货币市场基金基金合同
- （三）海富通添益货币市场基金招募说明书
- （四）海富通添益货币市场基金托管协议
- （五）中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- （六）报告期内海富通添益货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇一八年八月二十四日