

# 华宝现金添益交易型货币市场基金 2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 月 31 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 4 月 22 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 04 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华宝添益
场内简称	华宝添益 ETF
基金主代码	511990
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 27 日
报告期末基金份额总额	190,170,695,269.15 份
投资目标	保持本金的安全性和基金财产的流动性，追求高于比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金通过对短期金融工具的积极稳健投资，在保持本金安全与资产充分流动性的前提下，追求稳定的现金收益。主要包括：久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、套利策略、逆回购策略、现金流管理策略。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）。

风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝添益	华宝添益 B
下属分级基金的场内简称	华宝添益 ETF	-
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	169,547,489,862.52 份	20,623,205,406.63 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。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日）	
	华宝添益	华宝添益 B
1. 本期已实现收益	815,389,989.23	218,460,856.42
2. 本期利润	815,389,989.23	218,460,856.42
3. 期末基金资产净值	169,547,489,862.52	20,623,205,406.63

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝添益

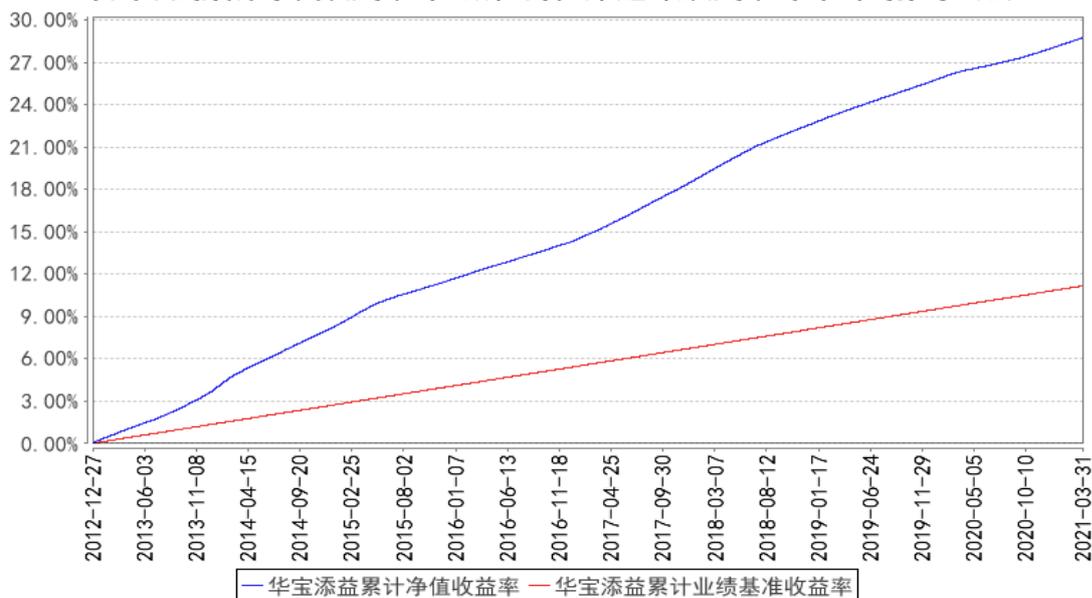
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5452%	0.0003%	0.3329%	0.0000%	0.2123%	0.0003%
过去六个月	1.0813%	0.0004%	0.6722%	0.0000%	0.4091%	0.0004%
过去一年	1.8601%	0.0010%	1.3472%	0.0000%	0.5129%	0.0010%
过去三年	7.4605%	0.0016%	4.0500%	0.0000%	3.4105%	0.0016%
过去五年	14.5952%	0.0021%	6.7472%	0.0000%	7.8480%	0.0021%
自基金合同生效起至今	28.7265%	0.0027%	11.1513%	0.0000%	17.5752%	0.0027%

华宝添益 B

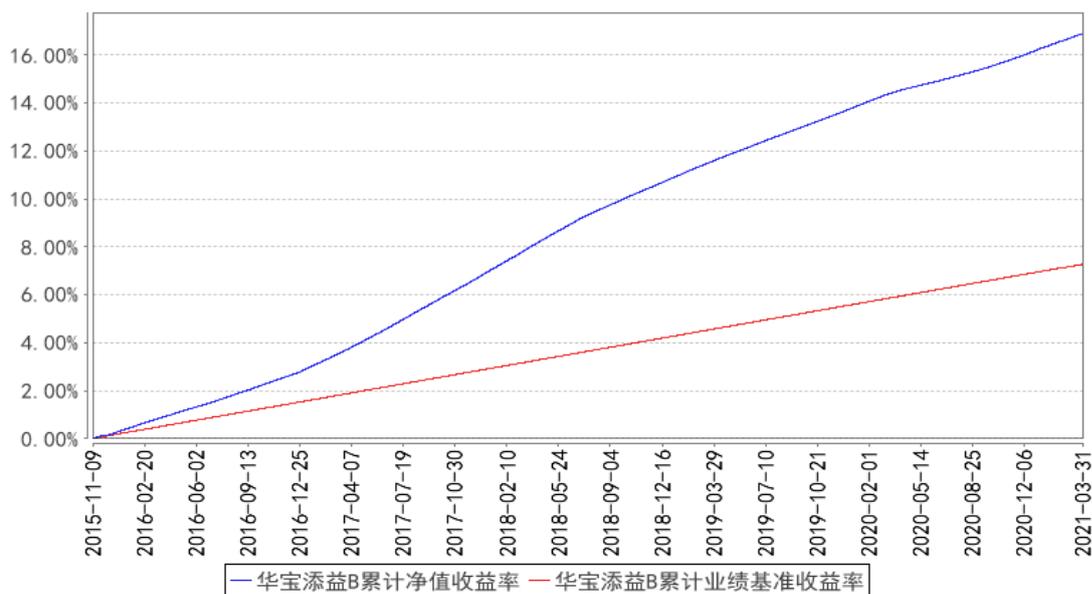
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6046%	0.0003%	0.3329%	0.0000%	0.2717%	0.0003%
过去六个月	1.2020%	0.0004%	0.6722%	0.0000%	0.5298%	0.0004%
过去一年	2.1039%	0.0010%	1.3472%	0.0000%	0.7567%	0.0010%
过去三年	8.2366%	0.0016%	4.0500%	0.0000%	4.1866%	0.0016%
过去五年	15.8609%	0.0021%	6.7472%	0.0000%	9.1137%	0.0021%
自基金合同生效起至今	16.9144%	0.0021%	7.2752%	0.0000%	9.6392%	0.0021%

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

华宝添益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



华宝添益B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 根据基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至 2013 年 6 月 27 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

2. 2015 年 11 月 9 日起，华宝现金添益基金新增场外基金份额（B 类基金份额，简称“华宝添益 B”），11 月 10 日起有资金进入申购，上图中其累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的数据的计算起始日期为 2015 年 11 月 10 日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈昕	固定收益部总经理、本基金基金经理、华宝现金宝货币、华宝浮动净值货币基金经理	2012 年 12 月 27 日	-	17 年	硕士。2003 年 8 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 月至 2021 年 3 月任华宝宝怡纯债债券型证券投资基金基金经理。2019 年 9 月起任华宝浮动净值型发起式货币市场基金基金经理。

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、华宝政金债债券基金经理	2019 年 7 月 19 日	-	10 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。2019 年 9 月起任华宝政策性金融债债券型证券投资基金基金经理。
-----	--	-----------------	---	------	--

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《货币市场基金监督管理办法》、《华宝现金添益交易型货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年一季度，国内经济呈现生产和出口较强、消费和投资偏弱格局。具体来看，1-2 月规模以上工业增加值同比增长 35.1%，两年平均增长 8.1%，外需偏强叠加就地过年，支撑工业生产处于高位。固定资产投资整体偏弱，内部结构表现为地产好于基建好于制造业。通胀方面，1-2 月 CPI 累计增速-0.3%，猪周期下行继续拖累 CPI，2 月 PPI 加速上行，在全球经济复苏以及低基数效应下，预计二季度 PPI 将继续回升。一季度资金面先紧后松，在年初资产价格泡沫迹象初显背景下，央行边际收紧流动性，并在跨节资金投放上较为谨慎，1 月末隔夜加权利率从年初 0.6% 一度大幅攀升至 3.4%。此后，市场流动性逐渐回归宽松，季末的资金面好于市场预期，更多是财政收支起伏带来的扰动。债市方面，受全球大宗商品价格快速上涨、全球疫情缓解后经济修复预期抬升等因素影响，一季度债券收益率先上后下，利率曲线平坦化上移，一季度 1 年期国债和国开债收益率分别上行 10BP 和 20BP，10 年期国债和国开债收益率分别上行 5BP 和 3BP。

本基金在报告期内规模继续增长，在资产配置上，本基金在一季度增加了同业存款的配置比重，组合平均剩余期限有所提升，整体运行平稳。展望二季度，4 月缴税期和地方政府债的发行或会对资金面和短端资产收益率产生较大的影响。本基金将继续本着谨慎、稳健、安全的原则，保持高流动性资产的同时我们将严格控制风险，兼顾流动性和收益性目标，对组合资产进行积极调整。在做好流动性管理的同时，债券配置上仍将着重关注短久期、高等级品种，保证较高的安全边际，为投资者谋取稳定回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期华宝添益 A 的基金份额净值收益率为 0.5452%，本报告期华宝添益 B 的基金份额净值收益率为 0.6046%，同期业绩比较基准收益率为 0.3329%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	41,826,361,027.14	21.18
	其中：债券	41,526,361,027.14	21.03
	资产支持证 券	300,000,000.00	0.15
2	买入返售金融资产	24,706,601,164.30	12.51
	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	124,091,096,622.69	62.85
4	其他资产	6,827,653,101.57	3.46
5	合计	197,451,711,915.70	100.00

### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	1.93	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值 比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	7,155,990,882.01	3.76
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 5.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	94
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	94
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	55

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

## 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	41.26	3.76
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	13.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	7.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	7.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	34.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	103.28	3.76

## 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

## 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	5,025,731,230.74	2.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,592,023,252.91	4.52
	其中：政策性金融债	8,592,023,252.91	4.52
4	企业债券	1,470,000,000.00	0.77
5	企业短期融资券	220,000,061.39	0.12
6	中期票据	-	-
7	同业存单	26,218,606,482.10	13.79
8	其他	-	-
9	合计	41,526,361,027.14	21.84
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

## 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产
----	------	------	---------	---------	-------

					净值比例 (%)
1	112109032	21 浦发银行 CD032	46,500,000	4,639,527,531.56	2.44
2	112110078	21 兴业银行 CD078	25,000,000	2,492,162,265.40	1.31
3	112013124	20 浙商银行 CD124	25,000,000	2,484,139,004.67	1.31
4	112110077	21 兴业银行 CD077	15,000,000	1,495,296,086.18	0.79
5	112074404	20 徽商银行 CD142	15,000,000	1,490,881,200.60	0.78
6	112116006	21 上海银行 CD006	15,000,000	1,488,498,326.42	0.78
7	200206	20 国开 06	14,500,000	1,449,275,008.95	0.76
8	200010	20 付息国债 10	14,200,000	1,419,405,935.67	0.75
9	112015183	20 民生银行 CD183	13,500,000	1,348,371,335.83	0.71
10	091918001	19 农发清发 01	11,300,000	1,131,780,398.94	0.60

### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0156%
报告期内偏离度的最低值	-0.0189%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0069%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

### 5.8 报告期末按摊余成本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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本（元）	占基金资产净值 比例（%）
1	169821	致远 02A1	3,000,000	300,000,000.00	0.16

### 5.9 投资组合报告附注

#### 5.9.1

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

## 5.9.2

华宝添益货币基金截至 2021 年 3 月 31 日持仓前十名证券中的 21 浦发银行 CD032(112109032) 的发行人上海浦东发展银行股份有限公司于 2020 年 08 月 11 日公告, 因公司存在 2013 年至 2018 年存在下列违法违规事实: 1. 未按专营部门制规定开展同业业务; 2. 同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目; 3. 延迟支付同业投资资金吸收存款; 4. 为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保; 5. 未按规定进行贷款资金支付管理与控制; 6. 个人消费贷款贷后管理未尽职; 7. 通过票据转贴现业务调节信贷规模; 8. 银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职; 9. 办理无真实贸易背景的贴现业务; 10. 委托贷款资金来源审查未尽职; 11. 未按权限和程序办理委托贷款业务; 12. 未按权限和程序办理非融资性保函业务; 于 2020 年 08 月 10 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正, 并处罚款共计 2100 万元的处罚。

华宝添益货币基金截至 2021 年 3 月 31 日持仓前十名证券中的 21 兴业银行 CD078 (112110078)、21 兴业银行 CD077 (112110077) 的发行人兴业银行股份有限公司于 2020 年 09 月 11 日公告, 因公司存在以下违规行为: 1. 为无证机构提供转接清算服务, 且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定; 2. 为支付机构超范围(超业务、超地域)经营提供支付服务, 且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性; 3. 违规连通上、下游支付机构, 提供转接清算服务, 且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性; 4. 违反银行卡收单外包管理规定; 5. 未按规定履行客户身份识别义务; 于 2020 年 09 月 04 日收到中国人民银行福州中心支行给予警告, 没收违法所得 10,875,088.15 元, 并处 13,824,431.23 元罚款的处罚。

华宝添益货币基金截至 2021 年 3 月 31 日持仓前十名证券中的 20 浙商银行 CD124(112013124) 的发行人浙商银行股份有限公司于 2020 年 09 月 04 日公告, 因公司存在以下违规行为: (一) 关联交易未经关联交易委员会审批; (二) 未严格执行关键岗位轮岗制度; (三) 对上海分行理财业务授权混乱; (四) 以保险类资产管理公司为通道, 违规将存放同业款项倒存为一般性存款; (五) 通过保险资管计划协助他行将存放同业款项转为一般性存款; (六) 通过投资他行一般企业存单收益权的方式为他行虚增一般性存款; (七) 以投资虚假底层债权并要求客户以存单质押的方式虚增存款; (八) 黄金租赁业务未按监管要求计提风险加权资产; (九) 不良资产虚假出表; (十) 信贷资产虚假转让, 违规削减信贷规模; (十一) 向资金掮客销售私募信贷资产证券化产品次级份额, 并以该次级份额受益权为质押溢价开立信用证; (十二) 向资金掮客虚假代销信托产品, 并以代销的信托产品收益权质押开立无真实贸易背景的信用证; (十三) 债券主承销业务未按规定纳入统一授信管理; (十四) 为个人提供以股票质押的融资不审慎; (十五) 违规向客户提供融资用于参与

定向增发；（十六）通过同业票据不当交易规避信贷规模管控；（十七）违规以投资代替贴现，少计风险加权资产；（十八）以类资产证券化方式开展信贷资产转让，少计风险加权资产；（十九）以存放同业质押并指令交易对手以委托投资的方式收购本行资产，实现资产虚假出表；（二十）向他行卖出债券并承诺回购，少计风险加权资产；（二十一）通过特殊目的载体向他行存款并提供质押担保，由他行向本行授信客户提供融资；（二十二）同业投资接受金融机构回购承诺；（二十三）购买银行违规发行的同业委托投资计划用于承接该银行资产，并接受信用担保；（二十四）同业投资承接他行资产并接受他行存单质押担保；（二十五）通过违规发售理财产品实现本行资产虚假出表；（二十六）通过违规发售理财产品帮助交易对手实现资产虚假出表；（二十七）转让理财资产违规提供回购承诺；（二十八）理财资金违规用于保险公司增资；（二十九）违规向土地储备机构融资；（三十）向房地产开发企业提供融资，用于偿还股东垫付的土地出让金；（三十一）通过理财非标投资向房地产开发企业提供融资，用于缴纳土地出让金；于 2020 年 07 月 13 日收到中国银行保险监督管理委员会罚款 10120 万元的处罚。

华宝添益货币基金截至 2021 年 3 月 31 日持仓前十名证券中的 20 徽商银行 CD142(112074404) 的发行人徽商银行股份有限公司于 2020 年 12 月 25 日公告，因公司存在以下违规行为：一、同业业务专营部门管理不到位；二、信贷资产非真实转让；三、同业投资严重不审慎；四、同业投资风险分类不实；于 2020 年 09 月 30 日收到中国银行保险监督管理委员会安徽监管局罚款 290 万元的处罚。

华宝添益货币基金截至 2021 年 3 月 31 日持仓前十名证券中的 21 上海银行 CD006(112116006) 的发行人上海银行股份有限公司于 2020 年 08 月 14 日公告，因公司存在以下违规行为：2014 年至 2019 年，上海银行存在下列违法违规行为：一、违规向资本金不足、“四证”不全的房地产项目发放贷款，以其他贷款科目发放房地产开发贷款；二、并购贷款管理严重违反审慎经营规则；三、经营性物业贷款管理严重违反审慎经营规则；四、个人贷款业务严重违反审慎经营规则；五、流动资金贷款业务严重违反审慎经营规则；六、违规向关系人发放信用贷款；七、发放贷款用于偿还银行承兑汇票垫款；八、贷款分类不准确；九、违规审批转让不符合不良贷款认定标准的信贷资产；十、虚增存贷款；十一、违规收费；十二、票据业务严重违反审慎经营规则；十三、同业资金投向管理严重违反审慎经营规则；十四、理财业务严重违反审慎经营规则；十五、委托贷款业务严重违反审慎经营规则；十六、内保外贷业务严重违反审慎经营规则；十七、衍生品交易人员管理严重违反审慎经营规则；十八、监事会履职严重不到位；十九、未经任职资格许可实际履行高级管理人员职责；二十、关联交易管理严重不审慎；二十一、押品估值管理严重违反审慎经营规则；二十二、未按规定保存重要信贷档案，导致分类信息不准确、不完整；二十三、未按

规定报送统计报表；于 2020 年 08 月 14 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正，没收违法所得 27.155092 万元，罚款 1625 万元，罚没合计 1652.155092 万元。的处罚。

华宝添益货币基金截至 2021 年 3 月 31 日持仓前十名证券中的 20 民生银行 CD183(112015183) 的发行人中国民生银行股份有限公司于 2020 年 09 月 04 日公告，因公司存在以下违规行为：（一）违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资；（二）为“四证”不全的房地产项目提供融资；（三）违规为土地储备中心提供融资；（四）违规为地方政府提供融资，接受地方政府担保或承诺；（五）多名股东在已派出董事的情况下，以推荐代替提名方式推举独立董事及监事；（六）多名股东在股权质押超比例的情况下违规在股东大会上行使表决权，派出董事在董事会上的表决权也未受限；（七）股东持股份额发生重大变化未向监管部门报告；（八）多名拟任高管人员及董事未经核准即履职；（九）关联交易不合规；（十）理财产品风险信息披露不合规；（十一）年报信息披露不真实；（十二）贷款资金被挪用，虚增贷款；（十三）以贷转存，虚增存款；（十四）贸易背景审查不尽职；（十五）向关系人发放信用贷款；（十六）违规转让正常类信贷资产；（十七）违规转让不良资产；（十八）同业投资他行非保本理财产品审查不到位，接受对方机构违规担保，少计风险加权资产；（十九）同业投资未穿透底层资产计提资本拨备，少计风险加权资产；（二十）同业存放业务期限超过一年；（二十一）违规开展票据转贴现交易；（二十二）个别理财产品管理费长期未入账；（二十三）理财业务风险隔离不充分；（二十四）违规向非高净值客户销售投向股权类资产的理财产品；（二十五）非标准化资产纳入标准化资产统计，实际非标债权资产比例超监管要求；（二十六）违规出具补充协议及与事实不符的投资说明；（二十七）以代销名义变相向本行授信客户融资，并承担兜底风险；（二十八）向不符合条件的借款人办理收益权转让再融资业务；（二十九）代理福费廷业务违规承担风险，会计处理不规范；（三十）迟报瞒报多起案件（风险信息）；于 2020 年 07 月 14 日收到中国银行保险监督管理委员会没收违法所得 296.47 万元，罚款 10486.47 万元，罚没合计 10782.94 万元的处罚。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余四名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	5,774,926,872.44

3	应收利息	1,052,726,229.13
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	6,827,653,101.57

#### 5.9.4 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝添益	华宝添益 B
报告期期初基金份额总额	135,350,319,302.36	11,624,223,318.38
报告期期间基金总申购份额	43,137,934,379.91	72,858,860,986.16
报告期期间基金总赎回份额	8,940,763,819.75	63,859,878,897.91
报告期期末基金份额总额	169,547,489,862.52	20,623,205,406.63

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

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

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	分红再投资	2021-01-04	1,464.00	-	-
2	分红再投资	2021-01-05	378.00	-	-
3	强制调减	2021-01-05	-5,654,092.00	-565,449,278.64	-
4	申购	2021-01-06	5,654,493.00	565,449,300.00	-
5	分红再投资	2021-01-07	371.00	-	-
6	强制调减	2021-01-07	-5,016,548.00	-501,695,932.38	-

7	申购	2021-01-07	1,400,000.00	140,000,000.00	-
8	分红再投资	2021-01-08	128.00	-	-
9	申购	2021-01-08	5,016,959.00	501,695,900.00	-
10	分红再投资	2021-01-11	1,247.00	-	-
11	强制调减	2021-01-11	-7,055,781.00	-705,633,064.60	-
12	申购	2021-01-12	7,056,331.00	705,633,100.00	-
13	分红再投资	2021-01-13	426.00	-	-
14	强制调减	2021-01-13	-7,057,578.00	-705,807,203.05	-
15	申购	2021-01-14	7,058,072.00	705,807,200.00	-
16	分红再投资	2021-01-15	402.00	-	-
17	强制调减	2021-01-15	-876,586.00	-87,674,378.55	-
18	分红再投资	2021-01-18	999.00	-	-
19	强制调减	2021-01-18	-114,361.00	-11,436,786.16	-
20	申购	2021-01-18	876,744.00	87,674,400.00	-
21	分红再投资	2021-01-19	376.00	-	-
22	申购	2021-01-19	114,368.00	11,436,800.00	-
23	分红再投资	2021-01-20	386.00	-	-
24	分红再投资	2021-01-21	393.00	-	-
25	分红再投资	2021-01-22	402.00	-	-
26	强制调减	2021-01-22	-1,430,325.00	-143,058,245.85	-
27	分红再投资	2021-01-25	1,014.00	-	-
28	申购	2021-01-25	1,430,582.00	143,058,200.00	-
29	分红再投资	2021-01-26	424.00	-	-
30	强制调减	2021-01-26	-200,000.00	-19,999,400.00	-
31	分红再投资	2021-01-27	421.00	-	-
32	分红再投资	2021-01-28	418.00	-	-
33	分红再投资	2021-01-29	421.00	-	-
34	分红再投资	2021-02-01	1,310.00	-	-

35	分红再投资	2021-02-02	431.00	-	-
36	分红再投资	2021-02-03	436.00	-	-
37	强制调减	2021-02-03	-5,266,555.00	-526,704,535.76	-
38	分红再投资	2021-02-04	102.00	-	-
39	强制调减	2021-02-04	-1,600,198.00	-160,033,162.38	-
40	申购	2021-02-04	5,267,045.00	526,704,500.00	-
41	分红再投资	2021-02-05	331.00	-	-
42	强制调减	2021-02-05	-5,267,147.00	-526,893,656.52	-
43	申购	2021-02-05	1,600,331.00	160,033,100.00	-
44	分红再投资	2021-02-08	302.00	-	-
45	强制调减	2021-02-08	-1,600,662.00	-160,100,627.96	-
46	申购	2021-02-08	5,788,937.00	578,893,700.00	-
47	分红再投资	2021-02-09	367.00	-	-
48	申购	2021-02-09	1,601,006.00	160,100,600.00	-
49	分红再投资	2021-02-10	472.00	-	-
50	强制调减	2021-02-10	-7,316,271.00	-732,213,128.92	-
51	分红再投资	2021-02-18	38.00	-	-
52	强制调减	2021-02-18	-4,074,813.00	-407,514,490.10	-
53	强制调增	2021-02-18	4,000,000.00	399,999,000.00	-
54	申购	2021-02-19	7,397,586.00	739,758,600.00	-
55	分红再投资	2021-02-22	1,414.00	-	-
56	强制调减	2021-02-22	-4,583,600.00	-458,396,668.80	-
57	分红再投资	2021-02-23	185.00	-	-
58	强制调减	2021-02-23	-1,563,600.00	-156,372,739.11	-
59	申购	2021-02-23	4,583,966.00	458,396,600.00	-
60	分红再投资	2021-02-24	365.00	-	-
61	强制调减	2021-02-24	-2,240,632.00	-224,081,125.06	-
62	申购	2021-02-24	1,563,728.00	156,372,800.00	-

63	分红再投资	2021-02-25	320.00	-	-
64	强制调减	2021-02-25	-5,159,450.00	-516,003,427.38	-
65	申购	2021-02-25	2,240,811.00	224,081,100.00	-
66	分红再投资	2021-02-26	140.00	-	-
67	强制调减	2021-02-26	-600,000.00	-60,013,005.30	-
68	申购	2021-02-26	5,160,034.00	516,003,400.00	-
69	分红再投资	2021-03-01	1,241.00	-	-
70	申购	2021-03-01	600,130.00	60,013,000.00	-
71	分红再投资	2021-03-02	448.00	-	-
72	强制调减	2021-03-02	-7,402,676.00	-740,373,126.28	-
73	申购	2021-03-03	7,563,732.00	756,373,200.00	-
74	分红再投资	2021-03-04	455.00	-	-
75	强制调减	2021-03-04	-7,564,180.00	-756,555,363.64	-
76	申购	2021-03-04	500,000.00	50,000,000.00	-
77	分红再投资	2021-03-05	30.00	-	-
78	申购	2021-03-05	7,565,553.00	756,555,300.00	-
79	分红再投资	2021-03-08	1,404.00	-	-
80	分红再投资	2021-03-09	465.00	-	-
81	分红再投资	2021-03-10	464.00	-	-
82	分红再投资	2021-03-11	463.00	-	-
83	强制调减	2021-03-11	-3,943,552.00	-394,382,804.88	-
84	分红再投资	2021-03-12	240.00	-	-
85	强制调减	2021-03-12	-2,000,000.00	-200,040,000.00	-
86	申购	2021-03-12	3,943,800.00	394,380,000.00	-
87	分红再投资	2021-03-15	1,074.00	-	-
88	强制调减	2021-03-15	-3,000,000.00	-300,021,000.00	-
89	申购	2021-03-15	2,000,428.00	200,042,800.00	-
90	分红再投资	2021-03-16	300.00	-	-

91	强制调减	2021-03-16	-5,070,824.00	-507,118,895.77	-
92	申购	2021-03-16	3,000,210.00	300,021,000.00	-
93	分红再投资	2021-03-17	176.00	-	-
94	强制调减	2021-03-17	-427,776.00	-42,780,594.43	-
95	申购	2021-03-17	5,071,189.00	507,118,900.00	-
96	分红再投资	2021-03-18	446.00	-	-
97	强制调减	2021-03-18	-6,667,479.00	-666,801,599.46	-
98	申购	2021-03-18	427,806.00	42,780,600.00	-
99	分红再投资	2021-03-19	81.00	-	-
100	强制调减	2021-03-19	-1,404,872.00	-140,513,269.09	-
101	申购	2021-03-19	6,668,016.00	666,801,600.00	-
102	分红再投资	2021-03-22	1,165.00	-	-
103	强制调减	2021-03-22	-2,000,000.00	-200,014,000.01	-
104	申购	2021-03-22	1,405,133.00	140,513,300.00	-
105	分红再投资	2021-03-23	351.00	-	-
106	强制调减	2021-03-23	-2,237,700.00	-223,785,663.90	-
107	申购	2021-03-23	2,000,180.00	200,018,000.00	-
108	分红再投资	2021-03-24	337.00	-	-
109	强制调减	2021-03-24	-3,000,000.00	-300,021,000.00	-
110	申购	2021-03-24	2,237,856.00	223,785,600.00	-
111	分红再投资	2021-03-25	291.00	-	-
112	申购	2021-03-25	3,000,210.00	300,021,000.00	-
113	分红再投资	2021-03-26	465.00	-	-
114	分红再投资	2021-03-29	1,408.00	-	-
115	分红再投资	2021-03-30	473.00	-	-
116	分红再投资	2021-03-31	481.00	-	-
117	强制调减	2021-03-31	-4,226,535.00	-422,683,285.75	-
合计			-1,800,416.00	-184,648,859.73	

注：交易日期为确认日期，交易金额为确认金额。

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

以上均为华宝添益（511990）交易流水。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2021 年 3 月 12 日发布《华宝基金管理有限公司关于华宝现金添益交易型货币市场基金变更申赎简称的公告》，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；  
华宝现金添益交易型货币市场基金基金合同；  
华宝现金添益交易型货币市场基金招募说明书；  
华宝现金添益交易型货币市场基金托管协议；  
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；  
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；  
基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

### 9.3 查阅方式

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

华宝基金管理有限公司  
2021 年 4 月 22 日