

华富天盈货币市场基金 2017 年半年度报告

2017-06-30

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2017-08-26

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

[重要提示](#)

[基金简介](#)

[基金基本情况](#)

[基金产品说明](#)

[基金管理人和基金托管人](#)

[信息披露方式](#)

[其他相关资料](#)

[主要财务指标和基金净值表现](#)

[主要会计数据和财务指标](#)

[基金净值表现](#)

[基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较](#)

[自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较](#)

[管理人报告](#)

[基金管理人及基金经理情况](#)

[基金管理人及其管理基金的经验](#)

[基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介](#)

[管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明](#)

[管理人对报告期内公平交易情况的专项说明](#)

[公平交易制度的执行情况](#)

[异常交易行为的专项说明](#)

[管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明](#)

[报告期内基金投资策略和运作分析](#)

[报告期内基金的业绩表现](#)

[管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望](#)

[管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明](#)

[管理人对报告期内基金利润分配情况的说明](#)

[管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明](#)

[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](#)

[托管人报告](#)

[报告期内本基金托管人遵规守信情况声明](#)

[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](#)

[托管人对半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见](#)

[半年度财务会计报告（未经审计）](#)

资产负债表
利润表
所有者权益（基金净值）变动表
报表附注
基金基本情况
会计报表的编制基础
遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
重要会计政策和会计估计
会计年度
记账本位币
金融资产和金融负债的分类
金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认
金融资产和金融负债的估值原则
金融资产和金融负债的抵销
实收基金
损益平准金
收入/(损失)的确认和计量
费用的确认和计量
基金的收益分配政策
其他重要的会计政策和会计估计
会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
会计政策变更的说明
会计估计变更的说明
差错更正的说明
税项
重要财务报表项目的说明
银行存款
交易性金融资产
衍生金融资产/负债
买入返售金融资产
各项买入返售金融资产期末余额
期末买断式逆回购交易中取得的债券
应收利息
其他资产
应付交易费用
其他负债
实收基金
未分配利润
存款利息收入
股票投资收益
股票投资收益——买卖股票差价收入
债券投资收益
债券投资收益项目构成
债券投资收益——买卖债券差价收入

债券投资收益——赎回差价收入
债券投资收益——申购差价收入
资产支持证券投资收益
衍生工具收益
衍生工具收益——买卖权证差价收入
衍生工具收益——其他投资收益
股利收益
公允价值变动收益
其他收入
交易费用
其他费用
或有事项、资产负债表日后事项的说明
或有事项
资产负债表日后事项
关联方关系
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
本报告期与基金发生关联交易的各关联方
本报告期及上年度可比期间的关联方交易
通过关联方交易单元进行的交易
股票交易
债券回购交易
权证交易
应支付关联方的佣金
关联方报酬
基金管理费
基金托管费
销售服务费
与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
各关联方投资本基金的情况
报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
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
由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
其他关联交易事项的说明
利润分配情况
利润分配情况——货币市场基金
期末本基金持有的流通受限证券
因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
期末持有的暂时停牌等流通受限股票
期末债券正回购交易中作为抵押的债券
银行间市场债券正回购
交易所市场债券正回购
金融工具风险及管理
风险管理政策和组织架构

信用风险
按短期信用评级列示的债券投资
按长期信用评级列示的债券投资
流动性风险
金融资产和金融负债的到期期限分析
市场风险
利率风险
利率风险敞口
利率风险的敏感性分析
外汇风险
外汇风险敞口
外汇风险的敏感性分析
其他价格风险
其他价格风险敞口
其他价格风险的敏感性分析
采用风险价值法管理风险
有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
投资组合报告
期末基金资产组合情况
债券回购融资情况
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明
基金投资组合平均剩余期限
投资组合平均剩余期限基本情况
报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明
期末投资组合平均剩余期限分布比例
期末按债券品种分类的债券投资组合
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
“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离
报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明
报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明
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
投资组合报告附注
基金计价方法说明
本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券说明
受到调查以及处罚情况
期末其他各项资产构成
投资组合报告附注的其他文字描述部分
基金份额持有人信息
期末基金份额持有人户数及持有人结构
期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
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
发起式基金发起资金持有份额情况
开放式基金份额变动
重大事件揭示

基金份额持有人大会决议
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
涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
基金投资策略的改变
为基金进行审计的会计师事务所情况
管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
基金租用证券公司交易单元的有关情况
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
偏离度绝对值超过 0.5%的情况
其他重大事件
重大事件揭示
基金份额持有人大会决议
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
涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
基金投资策略的改变
为基金进行审计的会计师事务所情况
管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
基金租用证券公司交易单元的有关情况
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
偏离度绝对值超过 0.5%的情况
其他重大事件
影响投资者决策的其他重要信息
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
影响投资者决策的其他重要信息
备查文件目录
备查文件目录
存放地点
查阅方式

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 2017 年 8 月 25 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 2017 年 3 月 3 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金名称

华富天盈货币市场基金

基金简称

华富天盈货币

场内简称

基金主代码

004285

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2017-03-03

基金管理人

华富基金管理有限公司

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

441,564,630.02

基金合同存续期

不定期

下属 2 级基金的基金简称

华富天盈货币 A

华富天盈货币 B

下属 2 级基金的场内简称

下属 2 级基金的交易代码

004285

004286

报告期末下属 2 级基金的份额总额

4,429,355.12

437,135,274.90

基金产品说明

投资目标

在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略

本基金在保持组合高度流动性的前提下，结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，采取主动性的投资策略和精细化的操作手法，发现和捕捉市场的机会，实现基金的投资目标。

业绩比较基准

同期七天通知存款利率（税后）。

风险收益特征

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其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。

下属分级基金的风险收益特征

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

华富基金管理有限公司

兴业银行股份有限公司

信息披露负责人

姓名

满志弘

张志永

联系电话

021-68886996

021-62677777-212004

电子邮箱

manzh@hffund.com

zhangzhy@cib.com.cn

客户服务电话

400-700-8001

95561

传真

021-68887997

021-62159217

注册地址

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1000 号 31 层

福州市湖东路 154 号

办公地址

上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 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

章宏韬

高建平

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》

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址

<http://www.hffund.com>

基金年度报告备置地点

基金管理人及基金托管人的办公场所

其他相关资料

项目
名称
办公地址
注册登记机构
华富基金管理有限公司
上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层
主要会计数据和财务指标
金额单位：人民币元
报告期
报告期(2017-03-03 至 2017-06-30)
华富天盈货币
华富天盈货币 A
华富天盈货币 B
本期已实现收益
9,071.10
3,672,076.61
本期利润
9,071.10
3,672,076.61
加权平均基金份额本期利润
本期加权平均净值利润率
-%
-%
-%
本期基金份额净值增长率
-%
-%
-%
本期净值收益率
-%
1.1937 %
1.2723 %
报告期末
报告期末(2017-06-30)
华富天盈货币
华富天盈货币 A
华富天盈货币 B
期末可供分配利润
期末可供分配基金份额利润
期末基金资产净值
4,429,355.12
437,135,274.90
期末基金份额净值

1

报告期末

报告期末(2017-06-30)

华富天盈货币

华富天盈货币 A

华富天盈货币 B

基金份额累计净值增长率

-%

-%

-%

累计净值收益率

-%

1.1937 %

1.2723 %

注:

1) 本基金合同生效未满一年。

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。

3) 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。

4) 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。

5) 本基金收益分配按日结转份额。

基金净值表现

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 A

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

过去一个月

0.3135 %

0.0009 %

0.1110 %

0.0000 %

0.2025 %

0.0009 %

过去三个月

0.9218 %

0.0006 %

0.3366 %

0.0000 %

0.5852 %

0.0006 %

自基金合同生效起至今

1.1937 %

0.0015 %

0.4438 %

0.0000 %

0.7499 %

0.0015 %

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 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

过去一个月

0.3326 %

0.0009 %

0.1110 %

0.0000 %

0.2216 %

0.0009 %

过去三个月

0.9817 %

0.0006 %

0.3366 %

0.0000 %

0.6451 %

0.0006 %

自基金合同生效起至今

1.2723 %

0.0014 %

0.4438 %

0.0000 %

0.8285 %

0.0014 %

注：业绩比较基准收益率=同期七天通知存款利率(税后)，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

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

比较 B

注：本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2017 年 3 月 3 日到 2017 年 9 月 3 日。本报告期内，本基金仍在建仓期。

基金管理人及基金经理情况

基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富保本混合型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富分级债券型证券投资基金、华富恒财分级债券型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富旺财保本混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享保本混合型证券投资基金、华富安福保本混合型证券投资基金、华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金三十三只基金。

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期限

证券从业年限

说明

任职日期

离任日期

胡伟

华富天盈货币市场基金经理、华富天益货币市场基金经理、华富弘鑫灵活配置混合型基金经理、华富保本混合型基金经理、华富收益增强债券型基金经理、华富恒富分级债券型基金经理、华富恒财分级债券型基金经理、华富恒稳纯债债券型基金经理、华富旺财保本混合型基金经理、华富恒利债券型基金经理、华富安福保本混合型基金经理、华富灵活配置混合型基金经理、公司公募投资决策委员会委员、公司总经理助理、固定收益部总监

2017-03-03

-

十三年

中南财经政法大学经济学学士、本科学历，曾任珠海市商业银行资金营运部交易员，从事债券研究及债券交易工作，2006 年 11 月加入华富基金管理有限公司，曾任债券交易员、华富货币市场基金基金经理助理、固定收益部副总监、2009 年 10 月 19 日至 2014 年

11月17日任华富货币市场基金基金经理、2014年8月7日至2015年2月11日任华富灵活配置混合型基金基金经理。

姚姣姣

华富天盈货币市场基金经理、华富天益货币市场基金基金经理、华富货币市场基金基金经理、华富恒稳纯债债券型基金基金经理

2017-03-14

-

五年

复旦大学金融学研究生学历、硕士学位。先后任职于广发银行股份有限公司、上海农商银行股份有限公司，2016年11月加入华富基金管理有限公司。

注：胡伟任职日期指该基金成立之日，姚姣姣任职日期指公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上，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。

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》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在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%的情形。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金投资策略和运作分析

2017年上半年，中国宏观经济运行仍然较稳，工业生产总体平稳，CPI温和上涨，PPI高点回落并短期趋于稳定。总的来看，经济稳中有落趋势不改，但短期下行压力可控。政策方面，央行稳健中性（略紧）操作思路贯穿于上半年，加之去杠杆监管政策仍在路上，以及海外市场的偏鹰派货币政策拐点显现，资金面整体维持紧平衡。

上半年，债券市场收益率整体震荡上行，10年期国债收益率从去年末3.01%一度震荡上行至3.69%，收益率上行幅度接近70个bp，较去年收益率低位2.64%上行超过100个bp。回顾上半年债市走势，宏观经济的超预期增长是利率上行的基础性力量；同时，叠加货币政策持续偏紧，金融监管在4月和5月全面升级进一步加剧了债市调整。在债市收益率在5月调整至阶段性高点后，随着金融监管协调加强，货币政策又在边际上有所放松，加之人民币贬值压力缓解，6月资金面好于预期，这些变化都使得债券市场的悲观情绪有所缓和，6月份市场迎来了反弹行情。

本货币基金在预判资金面前提下，以合理安排现金流为主要目标，以短久期存款、存单以及短期融资券为主要投资标的，在保证流动性和安全性的前提下，实现一定的收益性。

报告期内基金的业绩表现

本基金于 2017 年 3 月 3 日正式成立。上半年华富天盈货币 A 类基金份额净值收益率为 1.1937%，期间业绩比较基准 0.4438%，期间年化收益率 3.6094%。华富天盈货币 B 类基金份额净值收益率为 1.2723%，期间业绩比较基准 0.4438%，期间年化收益率 3.8457%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，虽然上半年基本面表现强劲，但是下半年经济仍难言乐观。预计三季度固定资产投资增速面临较为明显的下行压力，尤其是房地产投资增速和基础设施建设投资增速的下行压力相对较大，而制造业投资年内有望能够继续保持温和增长。通胀方面，年初以来消费需求总体平稳，CPI 保持在低位运行，叠加原油等商品价格疲弱，经济进入去库存阶段，PPI 下行趋势不改，预计下半年很难看到通胀压力的上升。二季度以来的债券市场调整主要是受到金融去杠杆加快推进和货币政策偏紧的影响，债券市场对基本面的反映有所钝化，在三季度经济基本面尚未出现趋势性改变的阶段，金融去杠杆如何推进以及货币政策如何选择，仍然是决定市场变化的核心力量。

展望后市操作，在金融杠杆持续推进的背景下，货币政策也很难掉头转向明显宽松。本货币基金将维持资金面中性预期，以确保流动性为主要目标，合理安排现金流，增加预防性头寸管理，维持组合低久期、高流动性、低杠杆。

管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并按基金份额面值 1.00 元分配后转入持有人权益，每日结转当日收益到基金份额持有人基金账户。本基金在本半年度 A 级应分配收益 9,071.10 元，B 级应分配收益 3,672,076.61 元，已全部分配，符合法律法规和《基金合同》的相关规定。

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

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

从 2017 年 4 月 6 日起至本报告期末（2017 年 6 月 30 日），本基金份额持有人数量存在连续二十个工作日不满二百人的情形，至本报告期期末（2017 年 6 月 30 日）基金份额持有人数量仍不满二百人。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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。

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

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。

托管人对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。

资产负债表

会计主体：华富天盈货币市场基金

报告截止日：2017-06-30

单位：人民币元

资产

本期末

2017-06-30

资产：

银行存款

126,603,859.33

结算备付金

-

存出保证金

-

交易性金融资产

99,246,329.59

其中：股票投资

-

基金投资

-

债券投资

99,246,329.59

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

214,898,072.35

应收证券清算款

-

应收利息

1,066,189.85

应收股利

-
应收申购款
-
递延所得税资产
-
其他资产
-
资产总计
441,814,451.12
负债和所有者权益
本期末
2017-06-30
负债：
短期借款
-
交易性金融负债
-
衍生金融负债
-
卖出回购金融资产款
-
应付证券清算款
-
应付赎回款
-
应付管理人报酬
72,082.90
应付托管费
18,020.73
应付销售服务费
4,102.45
应付交易费用
5,145.93
应交税费
-
应付利息
-
应付利润
-
递延所得税负债
-
其他负债
150,469.09
负债合计

249,821.10

所有者权益：

-

实收基金

441,564,630.02

未分配利润

-

所有者权益合计

441,564,630.02

负债和所有者权益总计

441,814,451.12

注：本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，无上年度可比期间。报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 441,564,630.02 份。A 级基金份额净值 1.0000 元，A 级份额 4,429,355.12 份，B 级基金份额净值 1.0000 元，B 级份额 437,135,274.90 份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

利润表

会计主体：华富天盈货币市场基金

本报告期：2017-03-03 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

一、收入

4,082,244.61

1.利息收入

4,082,244.61

其中：存款利息收入

2,958,630.98

 债券利息收入

553,661.65

 资产支持证券利息收入

-

 买入返售金融资产收入

569,951.98

 其他利息收入

-

2.投资收益（损失以“-”填列）

-

其中：股票投资收益

-

 基金投资收益

-

 债券投资收益

-

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	
401,096.90	
1. 管理人报酬	
187,248.97	
2. 托管费	
46,812.23	
3. 销售服务费	
9,887.03	
4. 交易费用	
-	
5. 利息支出	
1,426.58	
其中：卖出回购金融资产支出	
1,426.58	
6. 其他费用	
155,722.09	
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	
3,681,147.71	
减：所得税费用	
-	
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	
3,681,147.71	

注：本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，无上年度可比期间。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富天盈货币市场基金

本报告期：2017-03-03 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

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）

210,067,722.89

-

210,067,722.89

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

3,681,147.71

3,681,147.71

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）

231,496,907.13

-

231,496,907.13

其中：1.基金申购款

265,613,631.15

-

265,613,631.15

2.基金赎回款

-34,116,724.02

-

-34,116,724.02

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）

-

-3,681,147.71

-3,681,147.71

五、期末所有者权益（基金净值）

441,564,630.02

-

441,564,630.02

注：本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，无上年度可比期间。

本报告第 6.1 页至第 6.4 页财务报表由下列负责人签署；

基金管理人负责人：章宏韬

主管会计工作负责人：余海春

会计机构负责人：

陈大毅

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注

基金基本情况

华富天盈货币市场基金（以下简称本基金或基金）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]111号）核准，基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具《验资报告》（天健验（2017）6-21号）。有关基金设立文件已

按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《华富天盈货币市场基金基金合同》的规定，本基金的投资范围限于

以下金融工具，包括：（一）现金；（二）期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；（三）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；（四）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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

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，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

重要会计政策和会计估计

本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，无上年度可比期间。

会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期会计报表的实际编制期间为 2017 年 3 月 3 日至 2017 年 06 月 30 日。

记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产在初始确认时划分为以下四类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项、可供出售金融资产。

金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

(2) 金融负债在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（包括交易性金融负债和在初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债）、其他金融负债。

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

本基金按照公允价值对金融资产进行后续计量，且不扣除将来处置该金融资产时可能发生的交易费用，但下列情况除外：(1) 持有至到期投资以及贷款和应收款项采用实际利率法，按摊余成本计量；(2) 在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，按照成本计量。

本基金采用实际利率法，按摊余成本对金融负债进行后续计量，但下列情况除外：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值计量，且不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用；(2) 与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量

的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量；(3) 不属于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，或没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益并将以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：1) 按照《企业会计准则第 13 号——或有事项》确定的金额；2) 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第 14 号——收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，除与套期保值有关外，按照如下方法处理：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，计入公允价值变动收益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利，确认为投资收益；处置时，将实际收到的金额与初始入账金额之间的差额确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。(2) 可供出售金融资产的公允价值变动计入其他综合收益；持有期间按实际利率法计算的利息，计入投资收益；可供出售权益工具投资的现金股利，于被投资单位宣告发放股利时计入投资收益；处置时，将实际收到的金额与账面价值扣除原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额之后的差额确认为投资收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；当金融负债的现时义务全部或部分解除时，相应终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产和金融负债的估值原则

(1) 估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

- 1) 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 2) 第二层次输入值是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，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；
- 3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据做出的财务预测等。

(2) 估值方法及关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- 1) 对于特殊事项停牌股票，本基金根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告〔2008〕38号），参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》进行估值。
- 2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》（基金部通知〔2006〕37号），若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。
- 3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会《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》（证监会计字〔2007〕21号）采用估

值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限公司独立提供。

金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以红利再投资形式分配。当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益，当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分配权益。“每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以各类基金份额的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，每日进行支付。

其他重要的会计政策和会计估计

-

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1号）、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2012〕85号）、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2015〕101号）、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36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〕46号）、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》（财税〔2016〕70号）及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（一）2016年5月1日前，发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收营业税。

（二）2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

（三）对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税；

（四）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

活期存款

6,603,859.33

定期存款

-

其中：存款期限 1-3 个月

-

其他存款

120,000,000.00

合计

126,603,859.33

注：其他存款所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

交易性金融资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

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
99,246,329.59
99,352,000.00
105,670.41
0.0239
合计
99,246,329.59
99,352,000.00
105,670.41
0.0239

注：注 1：偏离金额=影子定价-摊余成本；

注 2：偏离度=偏离金额/摊余成本确定的基金资产净值。

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-
-
-
-

货币衍生工具

-
-
-
-

权益衍生工具

-
-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

买入返售金融资产

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

2017-06-30

账面余额

其中：买断式逆回购

买入返售证券_银行间

154,895,072.35

-

买入返售证券_固定平台

60,003,000.00

-

合计

214,898,072.35

-

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

应收利息

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

应收活期存款利息

1,913.03

应收定期存款利息

-

应收其他存款利息

281,249.86

应收结算备付金利息

-

应收债券利息

636,002.74

应收买入返售证券利息

147,024.22

应收申购款利息

-

应收黄金合约拆借孳息

-

其他

-

合计

1,066,189.85

注：应收其他存款利息所列金额为基金投资于有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息。

其他资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

其他应收款

-

待摊费用

-

合计

-

注：本基金本报告期末无其他资产。

应付交易费用

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

交易所市场应付交易费用

-
银行间市场应付交易费用
5,145.93
合计
5,145.93
其他负债
单位：人民币元
项目
本期末
2017-06-30
应付券商交易单元保证金
-
应付赎回费
-
预提费用
147,457.20
应付汇划费
3,011.89
合计
150,469.09
实收基金
单位：人民币元
项目
本期
2017-03-03 至 2017-06-30
华富天盈货币 A
华富天盈货币 B
基金份额（份）
账面金额
基金份额（份）
账面金额
基金合同生效日
48,722.89
48,722.89
210,019,000.00
210,019,000.00
本期申购
4,403,347.52
4,403,347.52
261,210,283.63
261,210,283.63
本期赎回（以“-”号填列）
-22,715.29
-22,715.29

-34,094,008.73

-34,094,008.73

本期末

4,429,355.12

4,429,355.12

437,135,274.90

437,135,274.90

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

未分配利润

华富天盈货币 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

基金合同生效日

-

-

-

本期利润

9,071.10

-

9,071.10

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

-9,071.10

-

-9,071.10

本期末

-

-

-

华富天盈货币 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

基金合同生效日

-

-

-

本期利润

3,672,076.61

-

3,672,076.61

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

-3,672,076.61

-

-3,672,076.61

本期末

-

-

-

存款利息收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

活期存款利息收入

94,939.44

定期存款利息收入

-

其他存款利息收入

2,863,691.54

结算备付金利息收入

-

其他

-

合计

2,958,630.98

注：其他存款利息收入所列金额为基金投资于有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入。

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

卖出股票成交总额

-

减：卖出股票成本总额

-

买卖股票差价收入

-

债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入

-

债券投资收益——赎回差价收入

-

债券投资收益——申购差价收入

-

合计

-

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额

50,000,000.00

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额

50,000,000.00

减：应收利息总额

-

买卖债券差价收入

-

债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

赎回基金份额对价总额

-

减：现金支付赎回款总额

-

减：赎回债券成本总额

-

减：赎回债券应收利息总额

-

赎回差价收入

-

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

申购基金份额对价总额

-

减：现金支付申购款总额

-

减：申购债券成本总额

-

减：申购债券应收利息总额

-

申购差价收入

-

资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

卖出资产支持证券成交总额

-

减：卖出资产支持证券成本总额

-

减：应收利息总额

-

资产支持证券投资收益

-

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

卖出权证成交总额

-

减：卖出权证成本总额

-

买卖权证差价收入

-

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

衍生工具收益——其他投资收益

项目

本期收益金额

2017-03-03 至 2017-06-30

国债期货投资收益

-

股指期货-投资收益

-

股利收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

股票投资产生的股利收益

-

基金投资产生的股利收益

-

合计

-

公允价值变动收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

1.交易性金融资产

-

——股票投资

-

——债券投资

-

——资产支持证券投资

-

——基金投资

-

——贵金属投资

-

——其他

-

2.衍生工具

-

——权证投资

-

3.其他

-

合计

-

注：本基金本报告期内无公允价值变动收益

其他收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

基金赎回费收入

-

合计

-

注：注：本基金本报告期内无其他收入。

交易费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

交易所市场交易费用

-

银行间市场交易费用

-

合计

-

注：本基金本报告期内无交易费用。

其他费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

审计费用

19,736.40

信息披露费

118,420.80

银行汇划费用

7,864.89

债券帐户维护费

9,000.00

上清所查询服务费

300.00

其他

400.00

合计

155,722.09

注：其他为开股东账户费用

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

无

资产负债表日后事项

无

关联方关系

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

本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，无上年度可比期间。

基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构

兴业银行股份有限公司

基金托管人、代销机构

华安证券股份有限公司（华安证券）

基金管理人的股东、代销机构

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-03-03(基金合同生效日)至 2017-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

注：本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，无上年度可比期间。本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的股票交易。

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-03-03(基金合同生效日)至 2017-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

华安证券

60,003,000.00

100.00 %

注：本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，无上年度可比期间。

权证交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-03-03(基金合同生效日)至 2017-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

注：本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，无上年度可比期间。本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

注：本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，无上年度可比期间。本报告期内未产生佣金。

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

当期发生的基金应支付的管理费

187,248.97

其中：支付销售机构的客户维护费

12,315.06

注：本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，无上年度可比期间。支付基金管理人华富基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.20%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：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 ×0.20% / 当年天数。

基金托管费

单位：人民币元

项目

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

当期发生的基金应支付的托管费

46,812.23

注：本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，无上年度可比期间。支付基金托管人中国建设银行的基金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：

日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

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

2017-03-03 至 2017-06-30

当期发生的基金应支付的销售服务费

华富天盈货币 A

华富天盈货币 B

合计

华安证券

35.88

6,525.59

6,561.47

华富基金管理有限公司

510.54

2,815.02

3,325.56

合计

546.42

9,340.61

9,887.03

注：本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，无上年度可比期间。支付基金销售机构的基金销售服务费，本基金 A 类按前一日基金资产净值的 0.25%计提，B 类按前一日基金资产净值的 0.01%计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

A 类日基金销售服务费=A 类前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数

B 类日基金销售服务费=B 类前一日基金资产净值 × 0.01% / 当年天数。

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

2017-03-03 至 2017-06-30

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

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

各关联方投资本基金的情况

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

2017-03-03 至 2017-06-30

份额级别

华富天盈货币 A

华富天盈货币 B

基金合同生效日（2017-03-03）持有的基金份额

-

-

期初持有的基金份额

0.00

110,000,000.00

期间申购/买入总份额

0.00

1,253,998.22

期间因拆分增加的份额

0.00

0.00

减：期间赎回/卖出总份额

0.00

20,000,000.00

期末持有的基金份额

0.00

91,253,998.22

期末持有的基金份额占基金总份额比例

0.00 %

20.67 %

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求，申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。

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

份额单位：份

关联方名称

华富天盈货币 A

本期末

2017-06-30

持有的基金份额

持有的基金份额占基金总份额的比例

关联方名称

华富天盈货币 B

本期末

2017-06-30

持有的基金份额

持有的基金份额占基金总份额的比例

上海华富利得资产管理有限公司

30,209,593.86

6.84 %

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

本表列示“持有的基金份额占基金总份额的比例”为占期末基金份额总额的比例。

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

2017-03-03 至 2017-06-30

期末余额

当期利息收入

兴业银行股份有限公司

6,603,859.33

94,939.44

注：本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，无上年度可比期间。本表仅列示活期存款余额及产生利息。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期

2017-03-03 至 2017-06-30

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券

其他关联交易事项的说明

无

利润分配情况

利润分配情况——货币市场基金华富天盈货币 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

9,071.10

-

-

9,071.10

-

利润分配情况——货币市场基金华富天盈货币 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

3,672,076.61

-

-

3,672,076.61

-

期末（2017-06-30）本基金持有的流通受限证券

因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

受限证券类别：股票

证券代码

证券名称

成功认购日

可流通日

流通受限类型

认购价格

期末估值单价

数量（单位：股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

受限证券类别：债券

证券代码

证券名称

成功认购日

可流通日

流通受限类型

认购价格

期末估值单价

数量（单位：股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码

股票名称

停牌日期

停牌原因

期末估值单价

复牌日期

复牌开盘单价

数量（股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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

注：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所债券正回购余额。

金融工具风险及管理

-

风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、

评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

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

2017-06-30

A-1

0.00

A-1 以下

0.00

未评级

0.00

合计

-

注：注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括短期融资券、一年期以内的资产支持证券等债券基金可投资的短期信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。信用等级按期末评级结果列示。

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

2017-06-30

AAA

0.00

AAA 以下

0.00

未评级

0.00

合计

0.00

注：注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括期末本基金所投资的所有信用产品，具体包括短期融资券、公司债、企业债、资产支持证券、可转债、分离交易可转债、

商业银行债、非银行金融债等债券基金可投资的信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。短期信用产品的长期信用评级指主体评级，长期信用产品的长期信用评级指债券评级。信用等级按期末评级结果列示。

流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

-

流动性净额

-

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，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

利率风险敞口

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

1 个月以内

1-3 个月

3 个月-1 年

不计息

合计

资产

银行存款
6,603,859.33
40,000,000.00
80,000,000.00
-
126,603,859.33
交易性金融资产
9,993,686.54
89,252,643.05
-
-
99,246,329.59
买入返售金融资产
214,898,072.35
-
-
-
214,898,072.35
应收利息
-
-
-
1,066,189.85
1,066,189.85
其他资产
-
-
-
-
-
资产总计
231,495,618.22
129,252,643.05
80,000,000.00
1,066,189.85
441,814,451.12
负债
应付管理人报酬
-
-
-
72,082.90
72,082.90
应付托管费

-
-
-
18,020.73
18,020.73
应付销售服务费
-
-
-
4,102.45
4,102.45
应付交易费用
-
-
-
5,145.93
5,145.93
其他负债
-
-
-
150,469.09
150,469.09
负债总计
-
-
-
249,821.10
249,821.10
利率敏感度缺口
231,495,618.22
129,252,643.05
80,000,000.00
816,368.75
441,564,630.02

注：注： 本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

利率风险的敏感性分析

假设

除利率外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：人民币元）

本期末

2017-06-30

市场利率下降 25 基点

40,922.64

市场利率上升 25 基点

-40,806.71

外汇风险

-

外汇风险敞口

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债

负债合计

-

-

-

-

资产负债表外汇风险敞口净额

-

-

-

-

外汇风险的敏感性分析

假设

-

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：人民币元）

本期末

2017-06-30

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其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

公允价值

占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资

-

-

交易性金融资产—基金投资

-

-

交易性金融资产—债券投资

-

-

交易性金融资产—贵金属投资

-

-

衍生金融资产—权证投资

-

-

其他

-

-

合计

-

-

注：本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，因此无重大其他价格风险。

其他价格风险的敏感性分析

假设

-

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：人民币元）

本期末

2017-06-30

注：本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，因此无重大其他价格风险。

采用风险价值法管理风险

-

假设

95%

1年

分析

风险价值（金额单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

合计

25,766,341.69

有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
无。

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

99,246,329.59

22.46

其中：债券

99,246,329.59

22.46

资产支持证券

-

-

2

买入返售金融资产

214,898,072.35

48.64

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

126,603,859.33

28.66

4

其他各项资产

1,066,189.85

0.24

5

合计

441,814,451.12

100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 7.9.3 期末其他各项资产构成。

债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号

项目

占基金总资产的比例（%）

1

报告期内债券回购融资余额

0.07

其中：买断式回购融资

-

序号

项目

金额

占基金总资产的比例（%）

2

报告期末债券回购融资余额

-

-

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%

基金投资组合平均剩余期限

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

45

报告期内投资组合平均剩余期限最高值

78

报告期内投资组合平均剩余期限最低值

14

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

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

52.43

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

2

30 天(含)—60 天

2.27

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

3

60 天(含)—90 天

27

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

4

90 天(含)—120 天

18.12

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

5

120 天(含)—397 天（含）

-

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

合计

99.82

-

报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 240 天的情况。

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	
20,007,802.17	
4.53	
其中：政策性金融债	
20,007,802.17	
4.53	
4	
企业债券	
-	
-	
5	
企业短期融资券	
-	
-	
6	
中期票据	
-	
-	
7	
同业存单	
79,238,527.42	
17.94	
8	
其他	
-	
-	
9	
合计	
99,246,329.59	
22.48	
10	
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	

-
-
注：上表中，债券的成本包括债券面值和溢折价。
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
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
111719173
17 恒丰银行 CD173
200,000
19,813,018.03
4.49

1
111799292
17 宁波银行 CD101
200,000
19,813,018.03
4.49

2
111717122
17 光大银行 CD122
200,000
19,806,245.68
4.49

2
111710277
17 兴业银行 CD277
200,000
19,806,245.68
4.49

3
140220
14 国开 20
100,000
10,014,115.63
2.27

4
160419
16 农发 19

100,000

9,993,686.54

2.26

“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

0.0251 %

报告期内偏离度的最低值

-0.0022 %

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值

0.0036 %

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

序号

发生日期

偏离度

原因

调整期

注：报告期内不存在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

序号

发生日期

偏离度

原因

调整期

注：报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

投资组合报告附注

基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持为人民币 1.00 元。

本基金所持有的债券（包括票据）的估值采用摊余成本法，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，在其剩余存续期期内按实际利率法进行摊销，每日计提收益或损失。

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情况的说明

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

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	1,066,189.85
4	
应收申购款	-
5	
其他应收款	-
6	
待摊费用	-
7	
其他	-
8	
合计	1,066,189.85

投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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

华富天盈货币 A

104

42,589.95

4,387,994.08

99.07 %

41,361.04

0.93 %
 华富天盈货币 B
 5
 87,427,054.98
 437,135,274.90
 100.00 %
 0.00
 0.00 %
 合计
 109
 4,051,051.65
 441,523,268.98
 99.99 %
 41,361.04
 0.01 %

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

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

华富天盈货币 A

0.00

0.0000 %

华富天盈货币 B

0.00

0.0000 %

合计

0.00

0.0000 %

注：本期末基金管理人的从业人员未持有本基金

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金

华富天盈货币 A

0

华富天盈货币 B

0

合计

0

本基金基金经理持有本开放式基金

华富天盈货币 A

0

华富天盈货币 B

0

合计

0

注：本期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本开放式基金

发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-

-%

-

-%

-

基金管理人高级管理人员

-

-%

-

-%

-

基金经理等人员

-

-%

-

-%

-

基金管理人股东

-

-%

-

-%

-

其他

-

-%

-
-%
-
合计
-
-%
-
-%
-

开放式基金份额变动

单位：份

项目

华富天盈货币

华富天盈货币 A

华富天盈货币 B

基金合同生效日（2017-03-03）基金份额总额

-
48,722.89

210,019,000.00

本报告期期初基金份额总额

-
本报告期期间总申购份额

-
4,403,347.52

261,210,283.63

本报告期期间基金总赎回份额

-
22,715.29

34,094,008.73

本报告期期末基金份额总额

441,564,630.02

4,429,355.12

437,135,274.90

注：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。

基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

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、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘姚姣姣女士为华富货币市场基金基金经理。

2、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘姚姣姣女士为华富恒稳纯债债券型证券投资基金基金经理。

3、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘姚姣姣女士为华富天益货币市场基金基金经理。

4、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王翔先生不再担任华

富成长趋势混合型证券投资基金基金经理的职务。

5、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘陈启明先生为华富成长趋势混合型证券投资基金基金经理。

6、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘姚姣女士为华富天盈货币市场基金基金经理。

7、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，刘文正先生不再担任华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

8、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，刘文正先生不再担任华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

9、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘高靖瑜女士为华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

10、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，翁海波先生不再担任华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

11、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘高靖瑜女士为华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

12、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，翁海波先生不再担任华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

13、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘龚炜先生为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

14、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘龚炜先生为华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

15、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘翁海波先生为华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

16、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘龚炜先生为华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

17、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘翁海波先生为华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

18、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。

涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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

基金交易

债券交易

债券回购交易
 权证交易
 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
 成交金额
 占当期基金成交总额的比例
 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
 佣金
 占当期佣金总量的比例
 华安证券

2

-

-%

-

-%

-

-%

60,003,000.00

100.00 %

-

-%

-

-%

-

注：注：1)根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的券商租用了基金专用交易单元。

2)本报告期本基金新增华安证券二个交易单元。

3)此处的佣金指基金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。注：债券交易中企业债及可分离债券的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计。

偏离度绝对值超过 0.5%的情况

项目

发生日期

偏离度

法定披露报刊

法定披露日期

报告期内偏离度绝对值在 0.5%（含）以上

-

-

-

-

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

《华富天盈货币市场基金基金合同生效公告》

在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告

2017-03-06

2

《华富天盈货币市场基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告》

在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告

2017-03-11

3

《华富基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告》

在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告

2017-03-16

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

3.3-6.30

110,000,000.00

1,253,998.22

20,000,000.00

91,253,998.22

20.670000 %

2

3.3-6.30

100,000,000.00

1,266,932.28

0.00

101,266,932.28

22.930000 %

3

5.24-6.30

0.00

200,806,662.91

0.00

200,806,662.91

45.480000 %

个人

-

-

-

-

-

-

-

产品特有风险

无

影响投资者决策的其他重要信息

无

备查文件目录

- 1、华富天盈货币市场基金基金合同
- 2、华富天盈货币市场基金托管协议
- 3、华富天盈货币市场基金招募说明书
- 4、报告期内华富天盈货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告

存放地点

基金管理人、基金托管人处

查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。