

华富天盈货币市场基金 2017 年年度报告 摘要

2017 年 12 月 31 日

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

送出日期：2018 年 3 月 28 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 3 月 26 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。

本报告期自 2017 年 3 月 3 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富天盈货币	
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 年 3 月 3 日	
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	304,309,189.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华富天盈货币 A	华富天盈货币 B
下属分级基金的交易代码:	004285	004286
报告期末下属分级基金的份额总额	12,455,273.80 份	291,853,915.75 份

2.2 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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华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

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日		2016 年		2015 年	
	华富天盈货币 A	华富天盈货币 B	华富天盈货币 A	华富天盈货币 B	华富天盈货币 A	华富天盈货币 B
本期已实现收益	153,824.37	11,934,271.38	-	-	-	-
本期利润	153,824.37	11,934,271.38	-	-	-	-
本期净值收益率	3.2065%	3.4112%	-	-	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
	华富天盈货币 A	华富天盈货币 B	华富天盈货币 A	华富天盈货币 B	华富天盈货币 A	华富天盈货币 B
期末基金资产净值	12,455,273.80	291,853,915.75	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	-	-	-	-

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。

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

华富天盈货币 A

阶段	份额净值	业绩比较	业绩比较基	①—③	②—④
----	------	------	-------	-----	-----

	收益率①	收益率标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	1.0203%	0.0022%	0.3403%	0.0000%	0.6800%	0.0022%
过去六个月	1.9891%	0.0019%	0.6805%	0.0000%	1.3086%	0.0019%
自基金合同生效起至今	3.2065%	0.0018%	1.1244%	0.0000%	2.0821%	0.0018%

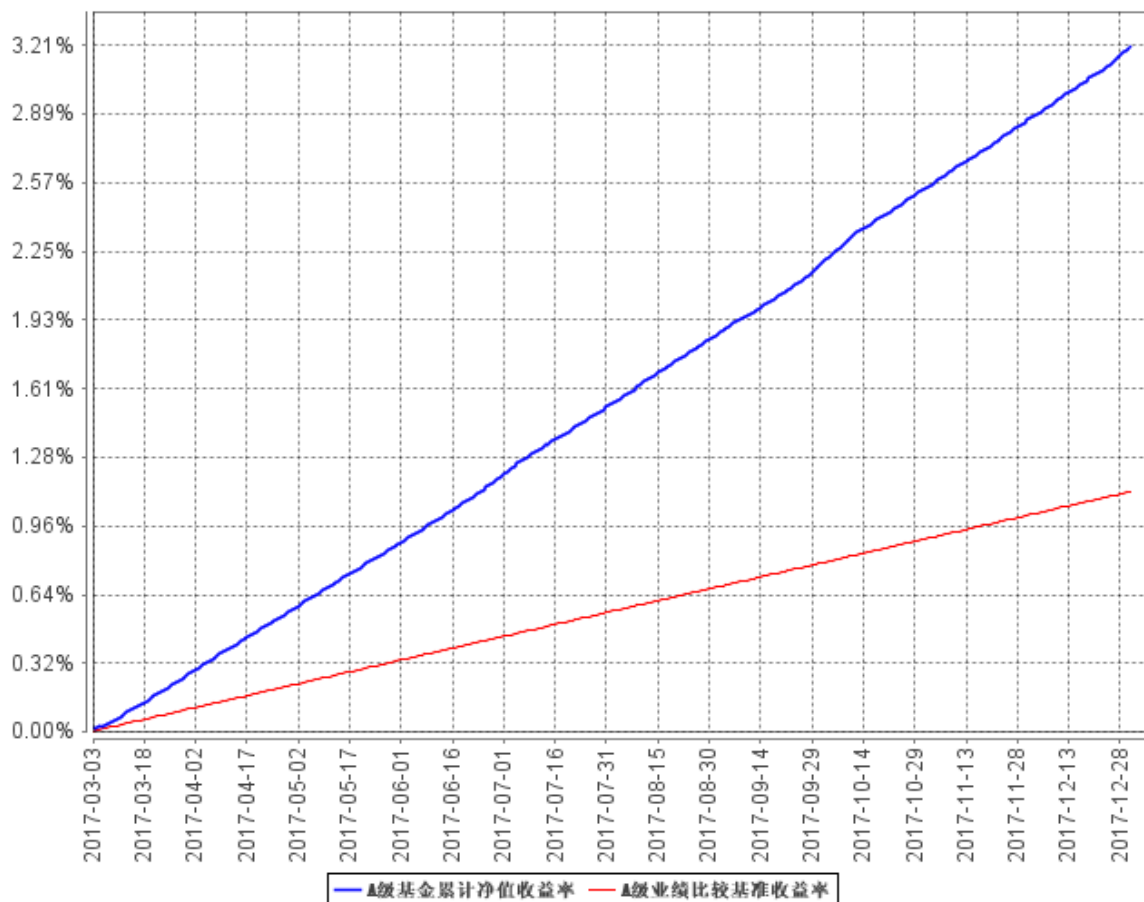
华富天盈货币 B

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
过去三个月	1.0811%	0.0022%	0.3403%	0.0000%	0.7408%	0.0022%
过去六个月	2.1120%	0.0019%	0.6805%	0.0000%	1.4315%	0.0019%
自基金合同生效起至今	3.4112%	0.0018%	1.1244%	0.0000%	2.2868%	0.0018%

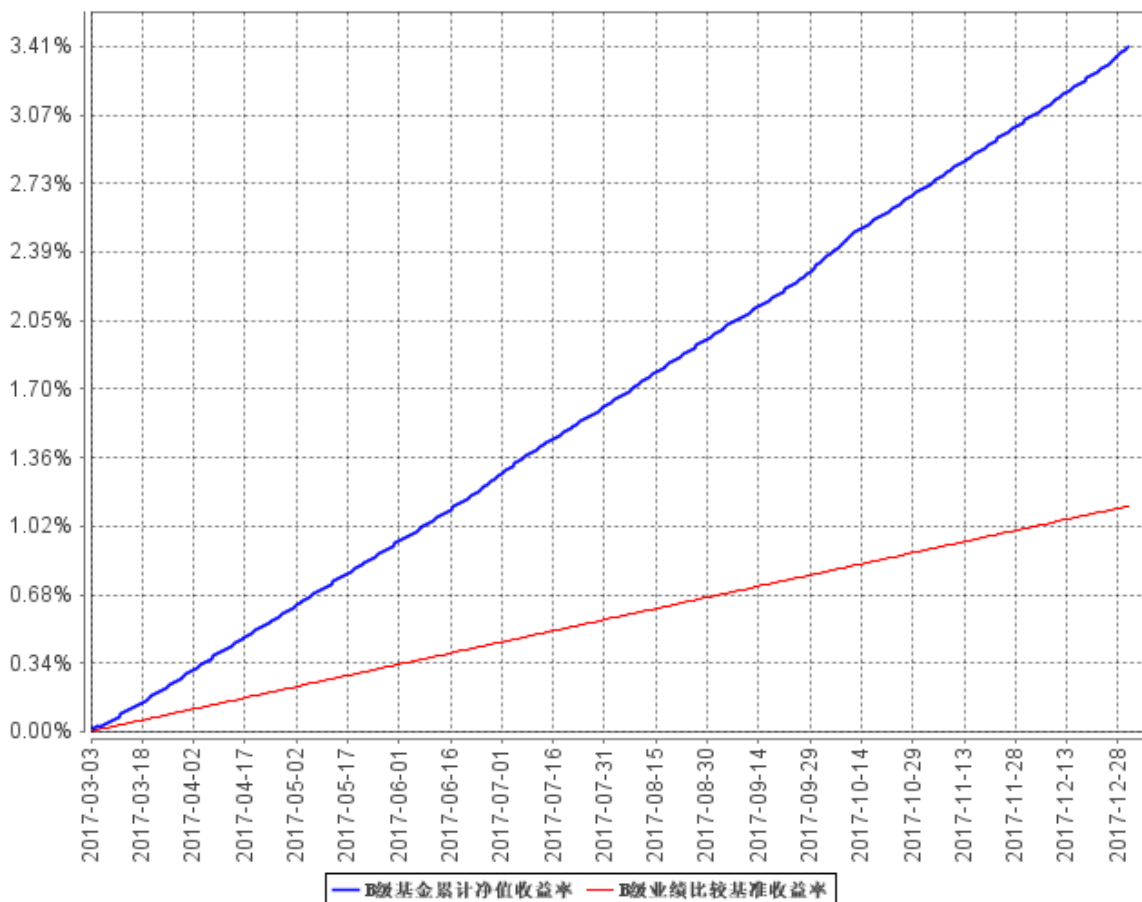
注：业绩比较基准收益率=同期七天通知存款利率(税后)，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

A级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



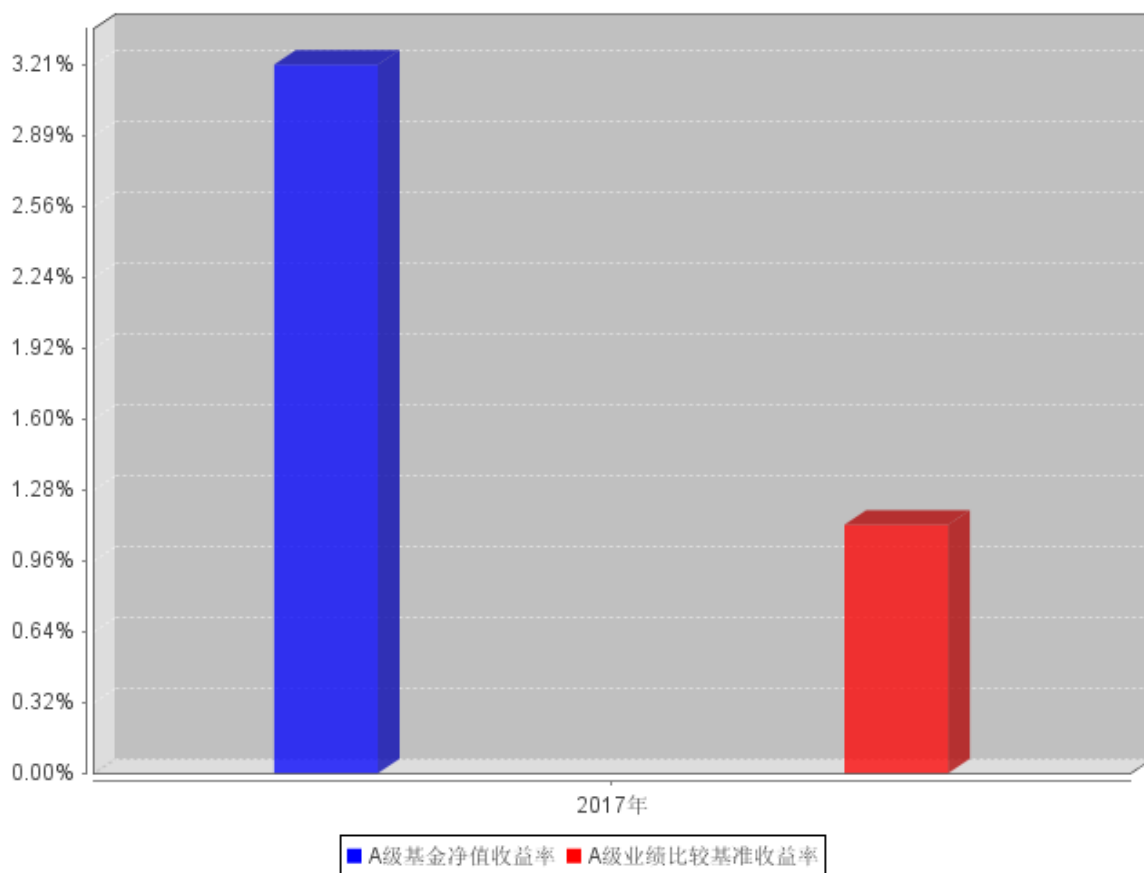
B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



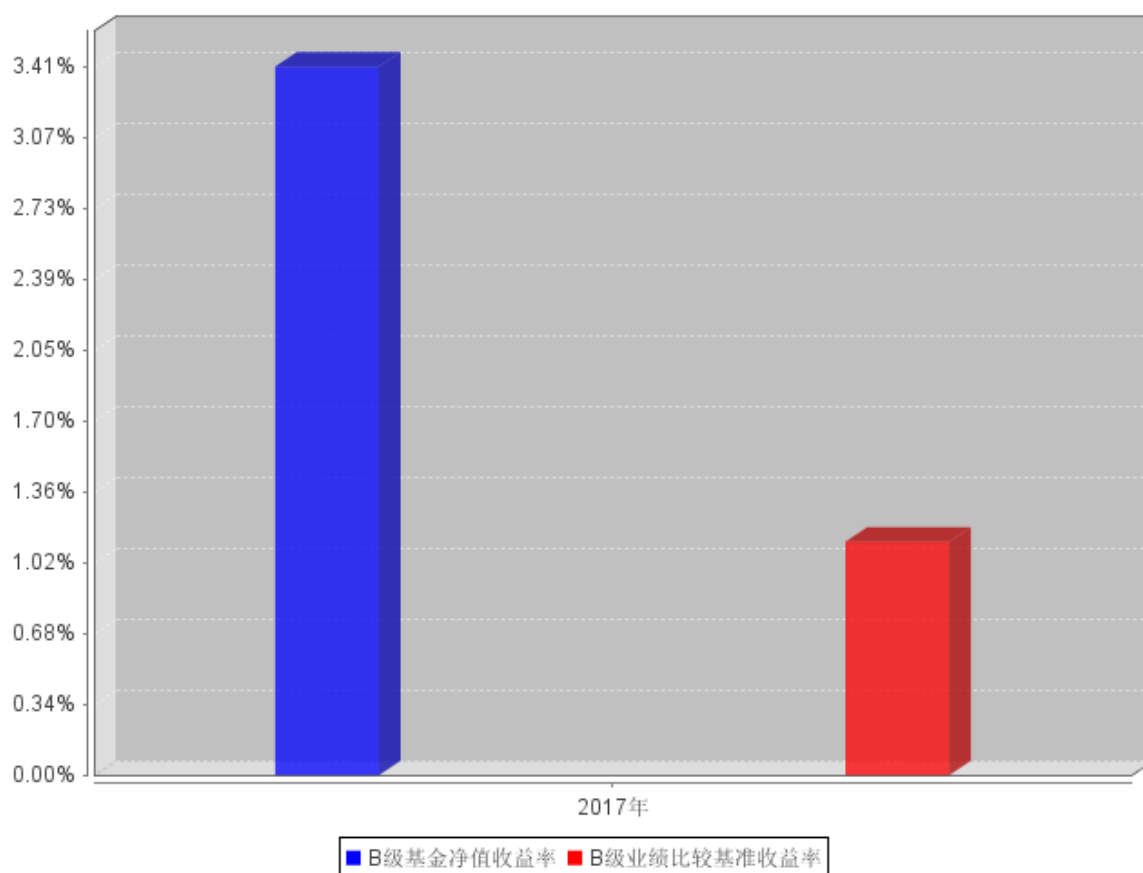
注：本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2017 年 3 月 3 日到 2017 年 9 月 3 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了基金合同的相关规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1) 上述比较期间为 2017 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日。

2) 合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

华富天盈货币 A					
年度	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	年度利润 分配合计	备注
2017	153,543.50	280.87	-	153,824.37	注：-
合计	153,543.50	280.87	-	153,824.37	注：-
华富天盈货币 B					
年度	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	年度利润 分配合计	备注
2017	11,900,280.79	33,990.59	-	11,934,271.38	注：-
合计	11,900,280.79	33,990.59	-	11,934,271.38	注：-

§ 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 12 月 31 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 18 个月定期开放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、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金，共三十四只基金。

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		
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	2017 年 3 月 3 日	-	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

	<p>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 18 个月定期开放债券型基金经理、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、华富星玉衡一年定期开放混合型基金经理、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</p>				<p>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经理，2016 年 6 月 28 日至 2017 年 7 月 4 日任华富灵活配置混合型基金经理。</p>
姚姣姣	华富天盈	2017 年 3 月	-	五年	复旦大学金融学研究生

	货币市场基金基金经理、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、华富恒富 18 个月定期开放债券型基金基金经理	14 日			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。
倪莉莎	华富天盈货币市场基金基金经理、华富恒财分级债券型基金基金经理	2017 年 9 月 12 日	-	三年	英国曼彻斯特大学管理学收硕士，研究生学历。2014 年 2 月加入华富基金管理有限公司，先后担任集中交易部助理交易员、交易员，固定收益部华富货币市场基金、华富天益货币市场基金、华富益鑫灵活配置混合型基金、华富恒财分级债券型基金的基金经理助理。

注：胡伟任职日期指该基金成立之日，姚姣姣、倪莉莎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。

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》及相关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在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 公平交易制度和控制方法

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》，公司制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公司的公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、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。具体控制措施如下：

在研究分析和投资决策环节，公司通过建立规范、完善的研究管理平台，为所有的投资组合经理提供公平的研究服务和支持。公司的各类投资组合，在保证其决策相对独立的同时，在获取投资信息、投资建议及决策实施方面均享有公平的机会。各投资组合经理根据其管理的投资组合的投资风格和投资策略，制定客观、完整的交易决策规则，并按照这些规则进行投资决策，保证各投资组合投资决策的客观性和独立性。

在交易执行环节，公司设立独立的集中交易部门，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易执行的公平原则：“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。公司通过完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，确保各投资组合获得公平的交易机会。

在行为监控和分析评估环节，公司将公平交易作为日常交易监控的重要关注内容，加强对投资交易行为的监察稽核力度，公司集中交易部、监察稽核部等相关部门严格按照公司关于异常交易的界定规则对违反公平交易原则的异常交易进行识别、监控与分析。每日交易时间结束后，集中交易部对每一笔公平交易的执行结果进行登记，逐笔备注发生公平交易各指令的先后顺序及实际执行结果，由具体执行的交易员签字确认留档，并交监察稽核部备案。公司监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，根据纳入样本内的数据分析结果，未发现明显异常情况。

4.3.2 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。

4.3.3 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。

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 年全年，规模以上工业增加值比上年增长 6.6%。增速比上年加快 0.6 个百分点。房地产库存持续下降，商品房销售增速继续回落。固定资产投资增速缓步下行，其中，2017 年基建投资承托了总体投资增速。消费品零售市场仍然稳健，新增消费额增加平稳，消费增速保持在 10.3%，成为经济增长的重要支撑。出口形势受全球经济复苏形势同步向好影响明显改善。

2017 年，债券市场走势是对金融体系加杠杆带动收益率下行超过基本面的修复，收益率中枢的进一步抬升、曲线的平坦化；绝对收益水平从过低回归到相对合理的水平，并且在充分预期政策执行力度后，叠加去杠杆以及资金面扰动，部分高评级债券有估值超调可能，债市的配置价值已经出现。

2017 年债券市场走势从年初开始至 4 月中旬，由于资金面紧张、加息，引发债市调整；之后到 6 月中旬，监管趋严的态势及预期主导利率波动上行走势；6 月下旬至三季度末，债市窄幅调整引发预期逐渐转乐观；10 月至年末，经济韧性超预期后，市场进一步调整上行。

本基金在全年操作上，以安全性和流动性管理为主要目标，根据对资金面的预判以及货币市场工具的选择，在符合《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》前提下，优化资产配置结构，取得稳定与合理的收益。

4.4.2 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。2017 年华富天盈货币 A 类基金份额净值收益率为 3.2065%，期间业绩比较基准 1.1244%，期间年化收益率 3.7897%。华富天盈货币 B 类基金份额净值收益率为 3.4112%，期间业绩比较基准 1.1244%，期间年化收益率 4.0276%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，年初资金面短期边际放松，但整体流动性依然将保持紧平衡状况。叠加严监管的持续推进，更加细化的金融去杠杆监管政策出台与落地，债市资金供给将持续承压，长端利率易上难下，收益率曲线预计陡峭化。而从绝对回报角度，债券收益率已至历史分位较高水平，配置价值也已具备。但趋势性机会仍需要等待，短期交易性机会可期但级别较小。

2018 年，本基金将继续把流动性管理和风险控制放在首位，认真研究各个潜在投资领域的机会，通过适当择时与资产品种选择，获取合理收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2017 年度，为加强公司内部控制，监察稽核工作从制度建设和内部监察稽核入手为公司持续发展奠定坚实的基础。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，独立、客观、公正地开展基金运作和公司管理的合规性监察，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

1、加强内部控制制度建设，完善内部控制环境。2017 年，为了确保公司旗下基金投资同业存单的行为合法合规、科学有效正常运转，防范和化解基金投资运作过程中可能发生的超过基金资产风险承受能力的投资行为，制定了《同业存单投资管理办法》；为保护基金持有人利益，规范基金的投资与研究业务，有效地控制风险，修订了《股票池管理办法》；为建立压力测试的风险监测与预警制度，规范旗下基金压力测试的流程，制定了《压力测试工作管理办法》；为规范公司网上交易和柜台直销行为，确保基金和专户销售的投资者适当性管理，维护投资者合法权益，制定了《投资者适当性管理制度》；为进一步加强内部控制，预防洗钱活动，规范公司可疑交易报告行为，修订了《大额交易和可疑交易报告制度》与《反洗钱内部控制制度》；为规范公司拟管理的交易型开放式指数证券投资基金的投资与运营活动，防范该种类型基金运作中的风险，制定了《ETF 基金风险管理办法》与《ETF 投资管理业务流程》；为加强公司内部合规管理，实现持续规范发展，保障公司依法合规、稳健经营，制定了《华富基金管理有限公司合规管理制度》，并修订了《华富基金管理有限公司监察稽核制度》和《华富基金管理有限公司总经理工作细则》；为规范与子公司的关系，加强对子公司的管理、监督、指导和支持，进一步完善子公司的法人治理结构、促进子公司按现代企业制度规范运作，全面落实公司的经营方针，保障股东权益、提高投资效益，制定了《华富基金管理有限公司子公司管理制度》；为进一步规范公司的财务行为，加强财务管理的监督职能，建立规范的财务工作秩序，提高经营效益，修订了《华富基金管理有

限公司财务管理制度》；为进一步维护基金投资人利益，加强公司基金销售业务管理，促进诚信、合法、有效开展基金销售业务，修订了《华富基金管理有限公司基金销售管理制度》。

2、多方位开展监察稽核工作，不断提高稽核覆盖面和检查力度。通过定期和不定期监察稽核工作的开展，公司的各个部门、各项业务的规范性和完善性都得到了较大的提高，各部门及时发现和弥补了制度建设中的漏洞和缺陷，实际业务操作流程更加科学有效。

3、加强风险监控，严格控制投资风险，通过对各基金的运行状况、投资比例、相关指标进行监控和跟踪，及时报告异常情况，确保基金投资规范运作。

4、扩大风险控制工作的覆盖面。风险控制工作不再局限于投资管理，从公司运营整体规范要求，风险控制渗透在业务的各个环节和所有部门，每月定时向风险控制委员会报告，进行及时的风险揭示。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 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。报告期内相关基金估值政策由天健会计师事务所（特殊普通合伙）进行审核并出具报告，由托管银行进行复核。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。

4.8 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。本基金在本年度 A 级应分配收益 153,824.37 元，B 级应分配收益 11,934,271.38 元，已全部分配，符合法律法规和《基金合同》的相关规定。

4.9 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。

§ 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

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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审（2018）6-48 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华富天盈货币市场基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了华富天盈货币市场基金（以下简称华富天盈货币基金）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日的利润表、持有人权益（基金净值）变动表，以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华富天盈货币基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日的经营成果和持有人权益（基金净值）变动。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华富天盈货币基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>华富天盈货币基金管理人（以下简称管理层）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估华富天盈货币基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经</p>

	<p>营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督华富天盈货币基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华富天盈货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华富天盈货币基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>

	我们与治理层就基金的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	曹小勤	林晶
会计师事务所的地址	浙江省杭州市钱江路 1366 号华润大厦 B 座 31 层	
审计报告日期	2018 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		80,642,654.89	-
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		169,193,139.28	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		169,193,139.28	-
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		53,475,440.21	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		1,441,374.08	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		304,752,608.46	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		50,748.95	-
应付托管费		12,687.24	-
应付销售服务费		4,953.58	-
应付交易费用		13,185.29	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		361,843.85	-
负债合计		443,418.91	-
所有者权益:			
实收基金		304,309,189.55	-
未分配利润		-	-
所有者权益合计		304,309,189.55	-
负债和所有者权益总计		304,752,608.46	-

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 12 月 31 日，华富天盈货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 12,455,273.80 份；华富天盈货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 29,185,915.75 份。华富天盈货币份额总额合计为 304,309,189.55 份。

7.2 利润表

会计主体：华富天盈货币市场基金

本报告期：2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 3 月 3 日(基金 合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		13,507,461.01	-
1.利息收入		13,476,000.72	-
其中：存款利息收入		5,028,815.35	-
债券利息收入		6,246,645.07	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,200,540.30	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		31,460.29	-
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		31,460.29	-
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		1,419,365.26	-
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	591,154.12	-
2. 托管费	7.4.8.2.2	147,788.42	-
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	38,810.44	-
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		241,093.07	-
其中：卖出回购金融资产支出		241,093.07	-
6. 其他费用		400,519.21	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,088,095.75	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,088,095.75	-

注：本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，无上年度可比期间。

7.3 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 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 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）	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）	-	12,088,095.75	12,088,095.75
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）	94,241,466.66	-	94,241,466.66
其中：1. 基金申购款	822,268,343.52	-	822,268,343.52
2. 基金赎回款	-728,026,876.86	-	-728,026,876.86
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）	-	-12,088,095.75	-12,088,095.75
五、期末所有者权益（基金净值）	304,309,189.55	-	304,309,189.55
	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
项目	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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

注：本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效，无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>章宏韬</u>	<u>余海春</u>	<u>陈大毅</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 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，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。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

7.4.6 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）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。

（二）对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税；

（三）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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	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
上海华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

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。

7.4.8.1.2 债券交易

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

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
华安证券	5,000,000.00	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。

7.4.8.1.4 权证交易

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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 3 日(基金合同生效 日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	591,154.12	-
其中：支付销售机构的 客户维护费	29,516.14	-

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 3 月 3 日(基金合同生效 日)至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的托管费	147,788.42	-

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。

7.4.8.2.3 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 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		
	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	607.77	15,512.17	16,119.94
华富基金管理有限公司	8,493.85	13,654.23	22,148.08
合计	9,101.62	29,166.40	38,268.02
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 12 月 31 日		
	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

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017年3月3日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	华富天盈货币 A	华富天盈货币 B
基金合同生效日（ 2017年3月3日）持有的 基金份额	0.00	110,011,000.00
期初持有的基金份额	0.00	110,011,000.00
期间申购/买入总份额	0.00	3,094,768.79
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	35,000,000.00
期末持有的基金份额	0.00	78,105,768.79
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	25.6800%

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。此表份额统计的份额为年末最后一个交易日 2017 年 12 月 29 日。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

华富天盈货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年12月31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
上海华富利得 资产管理有限 公司	38,837,647.68	12.7700%	-	-

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。此表份额统计的份额为年末最后一个交易日 2017 年 12 月 29 日。

7.4.8.5 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3月3日(基金合同生效日)至 2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	642,654.89	121,342.11	-	-

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。

7.4.8.6 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

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金没有因认购新发/增发证券而于本报告期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所债券正回购余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据“财政部关于执行企业会计准则的上市公司和非上市企业做好 2010 年年报工作的通知（财会〔2010〕25 号）”（以下简称“通知”）要求，本基金对年末持有的以公允价值计量的金融资产按照公允价值的取得方式分为三层：第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，

以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。根据通知要求，年末本基金持有的以公允价值计量的资产分层列示如下：

类别	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	-	169,193,139.28
第三层次	-	-
合计	169,193,139.28	-

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24 号）的要求，本基金自 2015 年 3 月 30 日起，对交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种采用第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格数据进行估值（估值标准另有规定的除外），本基金持有的以公允价值计量的上述资产计入第二层次。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	169,193,139.28	55.52
	其中：债券	169,193,139.28	55.52
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	53,475,440.21	17.55
	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	80,642,654.89	26.46
4	其他各项资产	1,441,374.08	0.47
5	合计	304,752,608.46	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 8.9.3 期末其他各项资产构成。

8.2 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	2.28	
	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	-	-
	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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	38
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	97
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。

8.3.2 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	50.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	19.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	22.89	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮	-	-

	动利率债		
5	120 天(含)—397 天(含)	6.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.67	-

8.4 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。

8.5 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	19,989,153.65	6.57
	其中：政策性金融债	19,989,153.65	6.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,009,214.58	9.86
6	中期票据	-	-
7	同业存单	119,194,771.05	39.17
8	其他	-	-
9	合计	169,193,139.28	55.60
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。

8.6 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	011754099	17 陕煤化 SCP004	200,000	20,009,928.06	6.58
2	111708348	17 中信银行 CD348	200,000	19,956,861.40	6.56
3	111709483	17 浦发银行 CD483	200,000	19,826,481.22	6.52

4	111714260	17 江苏银行 CD260	200,000	19,824,893.26	6.51
5	071721011	17 渤海证券 CP011	100,000	9,999,286.52	3.29
6	170306	17 进出 06	100,000	9,997,584.08	3.29
7	170204	17 国开 04	100,000	9,991,569.57	3.28
8	111711443	17 平安银行 CD443	100,000	9,971,720.24	3.28
9	111717256	17 光大银行 CD256	100,000	9,969,127.96	3.28
10	111715388	17 民生银行 CD388	100,000	9,954,572.29	3.27

8.7 “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	0.0515%
报告期内偏离度的最低值	-0.0615%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0169%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

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

注：报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

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，在其剩余存续期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益或损失。

8.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

8.9.3 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	1,441,374.08
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,441,374.08

8.9.4 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华富天盈货币 A	99	125,810.85	12,270,571.00	98.52%	184,702.80	1.48%
华富天盈货币 B	7	41,693,416.54	291,853,915.75	100.00%	0.00	0.00%
合计	106	2,870,841.41	304,124,486.75	99.94%	184,702.80	0.06%

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。此表份额统计的份额为年末最后一个交易日 2017 年 12 月 29 日。

9.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	基金类机构	78,105,768.79	25.68%
2	保险类机构	50,890,015.92	16.73%
3	保险类机构	50,019,415.39	16.45%
4	保险类机构	50,011,197.55	16.44%
5	基金类机构	38,837,647.68	12.77%
6	基金类机构	13,821,058.25	4.54%
7	券商类机构	10,026,475.28	3.30%
8	基金类机构	4,473,746.35	1.47%
9	基金类机构	4,283,198.94	1.41%
10	其他机构	3,103,776.62	1.02%

注：此表份额统计的份额为年末最后一个交易日 2017 年 12 月 29 日。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	华富天盈货币 A	华富天盈货币 B
基金合同生效日（2017 年 3 月 3 日）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	-	-
基金合同生效日起至报告期末基金总申购	15,828,062.73	803,344,237.19

份额		
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,421,511.82	721,509,321.44
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	12,455,273.80	291,853,915.75

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 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、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、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，增聘倪莉莎女士为华富恒财分级债券型证券投资基金基金经理。

19、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恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

20、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量子生命力混合型证券投资基金基金经理。

21、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，增聘倪莉莎女士为华富天盈货币市场基金基金经理。

22、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中小板指数增强型证券投资基金基金经理。

23、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中证 100 指数证券投资基金基金经理。

24、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，朱蓓女士不再担任华富中小板指数增强型证券投资基金基金经理的职务。

25、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，朱蓓女士不再担任华富中证 100 指数证券投资基金基金经理的职务。

26、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，朱蓓女士不再担任华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理的职务。

27、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，孔庆卿先生不再担任华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理的职务。

28、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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 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。本基金本年度需支付给审计机构天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 5 万元人民币。天健会计师事务所（特殊普通合伙）从 2012 年起为本公司提供审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
华安证券	2	-	-	-	-	-

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华安证券	-	-	5,000,000.00	100.00%	-	-

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。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	3.3-12.31	110,011,000.00	3,094,768.79	35,000,000.00	78,105,768.79	25.68%
个人	-	-	-	-	-	-	-

-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

注：此表份额统计的份额为年末最后一个交易日 2017 年 12 月 29 日。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
