

华富天益货币市场基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 28 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 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
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
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.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 债券回购融资情况.....	37
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	37
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.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	39
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	39
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细.....	40
7.9 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	42
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	44
10.9 其他重大事件.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
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.....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	47

§12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富天益货币市场基金	
基金简称	华富天益货币	
基金主代码	004198	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 1 月 25 日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	28,440,374,350.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华富天益货币 A	华富天益货币 B
下属分级基金的交易代码:	004198	004199
报告期末下属分级基金的份额总额	1,025,906.34 份	28,439,348,443.90 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	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。
风险收益特征	同期七天通知存款利率（税后）。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘
	联系电话	021-68886996
	电子邮箱	manzh@hffund.com
客户服务电话	400-700-8001	95528
传真	021-68887997	021-63602540
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1000 号 31 层	上海市中山东一路 12 号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层	上海市北京东路 689 号
邮政编码	200120	200001

法定代表人	章宏韬	高国富
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	华富天益货币 A	华富天益货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,123.60	408,460,962.14
本期利润	7,123.60	408,460,962.14
本期净值收益率	1.2034%	1.3231%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	1,025,906.34	28,439,348,443.90
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	7.9944%	8.6318%

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。

2) 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。

3) 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。

4) 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	0.1722%	0.0006%	0.1110%	0.0000%	0.0612%	0.0006%
过去三个月	0.5662%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.2296%	0.0005%
过去六个月	1.2034%	0.0006%	0.6695%	0.0000%	0.5339%	0.0006%
过去一年	2.6086%	0.0012%	1.3500%	0.0000%	1.2586%	0.0012%
自基金合同生效起至今	7.9944%	0.0021%	3.2807%	0.0000%	4.7137%	0.0021%

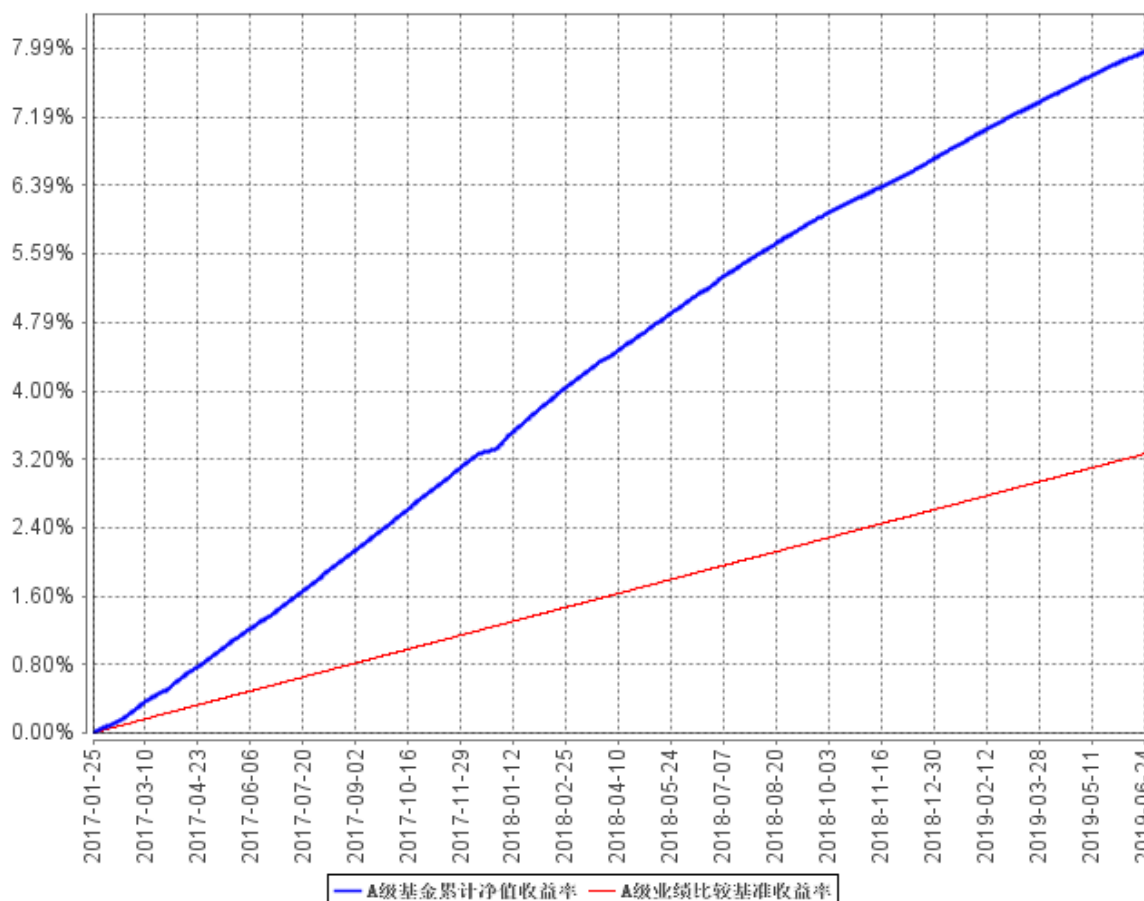
华富天益货币 B

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	0.1919%	0.0006%	0.1110%	0.0000%	0.0809%	0.0006%
过去三个月	0.6259%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.2893%	0.0005%
过去六个月	1.3231%	0.0006%	0.6695%	0.0000%	0.6536%	0.0006%
过去一年	2.8567%	0.0012%	1.3500%	0.0000%	1.5067%	0.0012%
自基金合同 生效起至今	8.6318%	0.0020%	3.2807%	0.0000%	5.3511%	0.0020%

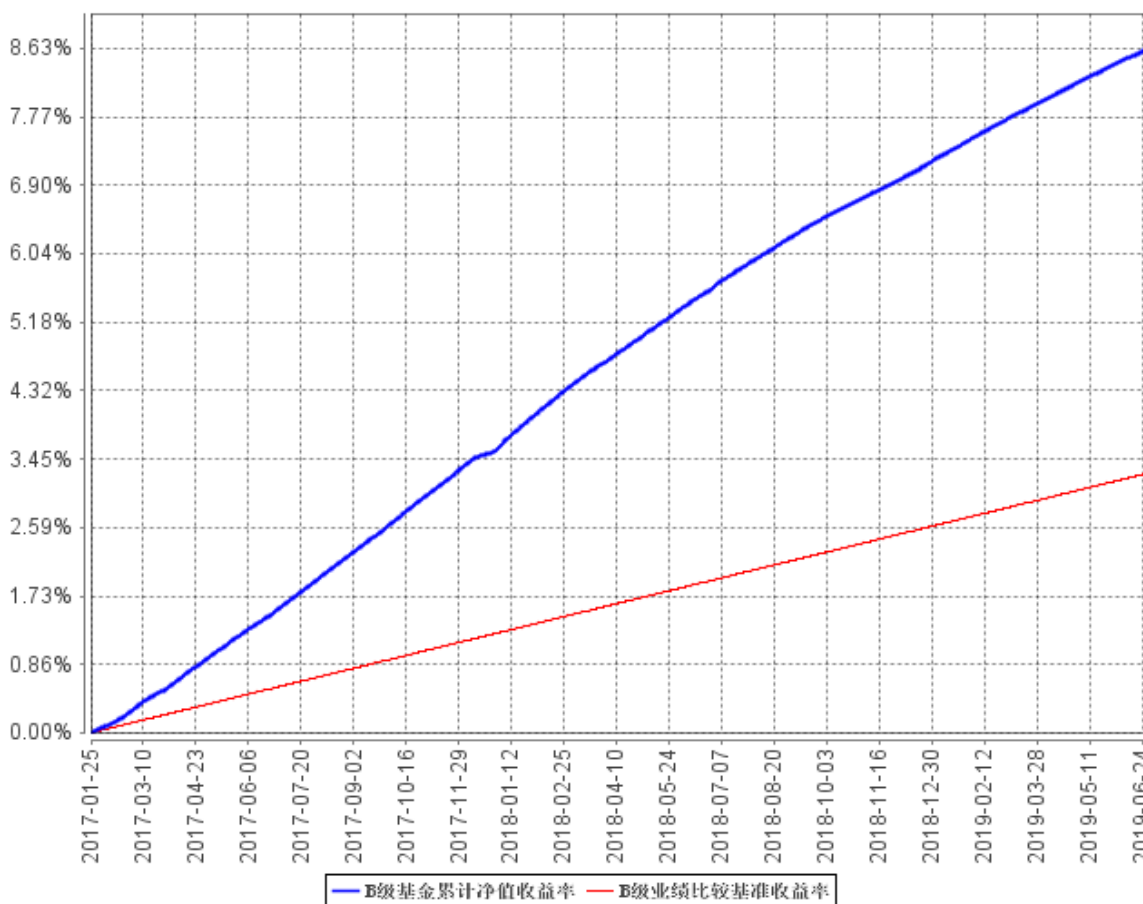
注：业绩比较基准收益率=同期七天通知存款利率（税后），业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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：根据《华富天益货币市场基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：（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。本基金建仓期为 2017 年 1 月 25 日到 2017 年 7 月 25 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。

§ 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 2019 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、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、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、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、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、华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金、华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒财定期开放债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金共三十七只基金。

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		
姚姣姣	华富天益货币市场基金基金经理、华富恒稳纯债债券型基金基金	2017 年 1 月 25 日	-	七年	复旦大学金融学硕士，研究生学历。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，2017 年 3 月 14 日至 2019 年 6 月 20 日任华

	经理、华富恒富 18 个月定期开放债券型基金基金经理、华富恒欣纯债债券型基金基金经理			富天盈货币市场基金基金经理、2017 年 1 月 4 日至 2019 年 6 月 20 日任华富货币市场基金基金经理。
--	--	--	--	---

注：任职日期指该基金成立之日。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，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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《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。

4.3.2 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

2019 年上半年国内需求端依然偏弱，宏观经济在下探中寻底。一季度经济有所改善，之后的 4 月-5 月制造业 PMI 和工业走势再度趋弱；而从 6 月至今经济再度出现企稳迹象。整体来看，出口进入下行周期，但衰退型顺差提升了净出口对 GDP 的贡献，固定资产投资整体平稳，基建投资

仍是稳内需的关键，消费支出在上半年没有明显起色，能否提振取决于政策能否持续改善预期。此外，上半年国内经济还面临通胀压力，以食品价格上涨为主要推动力，伴随生活资料价格上行，可能对货币政策造成制约。

2019 年上半年，国内资金面维持 2018 年的宽货币政策，整体保持宽松，央行维持短期流动性合理充裕。1 月份，央行在继 2018 年 4 月、6 月、10 月之后第四次降准，推动宽货币向宽信用传导以提升基本面回暖。进入二季度以来，央行有意控制银行间流动性总量，致使市场担忧央行将边际收紧流动性。但是这一预期并未兑现，随着 5 月下旬发生的包商银行被接管事件，银行间流动性受到了巨大冲击，市场流动性分层现象迅速扩散，同业信用收缩和同业负债压力上升，在资金价格走高的背景下，中小银行的同业存单发行难度迅速上升，同业存单的利差也在走阔。中小银行的负债端收紧进一步向非银端传导，货币基金首当其冲，被大量赎回引发市场流动性危机，进而再向专户私募等非银产品户传导。为了呵护市场流动性，央行在 6 月加大对公开市场的投放力度，投放资金总量超过万亿，在央行的大规模投放之下，货币利率降到了过去几年来低位，带动短端利率率先快速下行。

海外方面，全球经济增长乏力，全球贸易冲突带来的不确定性持续发酵，全球央行转向宽松，一季度，美联储暂停加息并在年内结束缩表；二季度开始，美联储降息预期陡升，澳洲等其他国家也分别开启降息周期，全球流动性有望转向宽松。

上半年，本基金在产品运作上仍然以短久期高流动性资产为主，特别是二季度包商银行事件对货币基金流动性带来冲击时，更以流动性和安全性为主要运作目标，保证了产品在极端市场情况下的流动性应对需求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2017 年 1 月 25 日正式成立。上半年华富天益货币 A 类基金份额净值收益率为 1.2034%，期间业绩比较基准 0.6695%，期间年化收益率 2.4123%。华富天益货币 B 类基金份额净值收益率为 1.3231%，期间业绩比较基准 0.6695%，期间年化收益率 2.6507%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，国内经济仍处于下行区间，较难判断经济底部是否已经确认。但 6 月份的 G20 峰会有助于中美贸易摩擦短期缓和。通胀方面，6 月以来，猪价、水果价格涨幅缩窄，加上国内钢价、煤价回落，成品油价格滞后下调，预计下半年通胀将趋于回落，难以形成全面的通胀压力。海外，市场普遍预期美联储将于年内实施降息，也给国内货币政策提供了较为充分的空间应对，但是由于 6 月份市场总量流动性极大充裕，意味着后续继续总量放松的概率将下降。预计三季度，央行在相继抉择的政策思路下，将继续保持货币市场的资金面平稳，视基本面变化适时边际微调。

在操作上，依然以高等级存单和存款配置为主，更多关注银行主体信用风险，保证产品的流动性和安全性为第一，兼顾收益性。

4.6 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。

4.7 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 7,123.60 元，B 级应分配收益 408,460,962.14 元，已全部分配，符合法律法规和《基金合同》的相关规定。

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

从 2017 年 3 月 1 日起至本报告期末（2019 年 6 月 30 日），本基金持有人数存在连续六十个工作日不满二百人的情形，至本报告期期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有人数仍不满二百人。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对华富天益货币市场基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对华富天益货币市场基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金收益的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由华富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华富天益货币市场基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,348,344,242.46	10,891,316,038.45
结算备付金		141,900,000.00	90,909,090.91
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	11,008,366,835.72	11,822,542,865.30
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		11,008,366,835.72	11,822,542,865.30
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	9,900,981,961.47	7,461,333,067.00
应收证券清算款		2,455,294.65	-
应收利息	6.4.7.5	43,650,954.98	34,742,524.96
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		28,445,699,289.28	30,300,843,586.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		-	-
应付证券清算款		-	2,270,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,642,961.67	3,798,203.52
应付托管费		1,214,320.54	1,266,067.85
应付销售服务费		243,067.33	253,251.60
应付交易费用	6.4.7.7	123,808.94	146,308.19
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	100,780.56	359,000.00
负债合计		5,324,939.04	2,275,822,831.16
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	28,440,374,350.24	28,025,020,755.46
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		28,440,374,350.24	28,025,020,755.46
负债和所有者权益总计		28,445,699,289.28	30,300,843,586.62

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 28,440,374,350.24 份。A 级基金份额净值 1.0000 元，A 级份额 1,025,906.34 份，B 级基金份额净值 1.0000 元，B 级份额 28,439,348,443.90 份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：华富天益货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		445,519,449.27	688,501,199.45
1.利息收入		445,218,939.33	688,259,848.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	146,901,836.45	310,656,490.46
债券利息收入		189,057,407.19	209,650,226.90
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		109,259,695.69	167,953,131.42
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		300,509.94	1,325.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	300,509.94	1,325.67
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	240,025.00

列)			
减：二、费用		37,051,363.53	40,634,774.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	23,103,710.28	24,790,191.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,701,236.73	8,263,397.12
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,540,980.12	1,653,344.91
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		4,542,380.34	5,686,711.32
其中：卖出回购金融资产支出		4,542,380.34	5,686,711.32
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	163,056.06	241,129.90
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		408,468,085.74	647,866,424.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		408,468,085.74	647,866,424.89

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富天益货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	28,025,020,755.46	-	28,025,020,755.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	408,468,085.74	408,468,085.74
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)	415,353,594.78	-	415,353,594.78
其中：1. 基金申购款	11,215,058,155.81	-	11,215,058,155.81
2. 基金赎回款	-10,799,704,561.03	-	-10,799,704,561.03
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)	-	-408,468,085.74	-408,468,085.74

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。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，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。

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 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〔2016〕140 号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56 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）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税〔2017〕90 号）及其他相关税务法规和实务操

作，主要税项列示如下：

(一) 自 2018 年 1 月 1 日起，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% 的征税率缴纳增值税。

(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。

主要税种及税率列示如下：

税 种	计 税 依 据	税 率
增值税	金融服务销售额	3%
城市维护建设税	应缴流转税税额	7%
教育费附加	应缴流转税税额	3%
地方教育附加[注]	应缴流转税税额	2%、1%

[注]：接地方税务局通知，自 2018 年 7 月 1 日起下调地方教育附加税税率，由原来的 2% 下调为 1%。

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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	8,344,242.46
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	7,340,000,000.00
合计：	7,348,344,242.46

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019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	11,008,366,835.72	11,015,111,000.00	6,744,164.28	0.0237%
	合计	11,008,366,835.72	11,015,111,000.00	6,744,164.28	0.0237%
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	11,008,366,835.72	11,015,111,000.00	6,744,164.28	0.0237%

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。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/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 2019年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,700,000,000.00	-
银行间市场	1,200,981,961.47	-
合计	9,900,981,961.47	-

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无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 2019年6月30日
应收活期存款利息	2,992.36

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	6,817,888.93
应收结算备付金利息	63,855.00
应收债券利息	34,785,482.09
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,980,736.60
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	43,650,954.98

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。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019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	123,808.94
合计	123,808.94

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	19,835.79
预提信息披露费	71,944.77
预提中债帐户维护费	4,500.00
预提上清所帐户维护费	4,500.00
合计	100,780.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华富天益货币 A		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	186,508.77	186,508.77
本期申购	1,131,738.82	1,131,738.82
本期赎回(以“-”号填列)	-292,341.25	-292,341.25
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,025,906.34	1,025,906.34

金额单位：人民币元

华富天益货币 B		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,024,834,246.69	28,024,834,246.69
本期申购	11,213,926,416.99	11,213,926,416.99
本期赎回(以“-”号填列)	-10,799,412,219.78	-10,799,412,219.78
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	28,439,348,443.90	28,439,348,443.90

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华富天益货币 A			
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	7,123.60	-	7,123.60
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	-7,123.60	-	-7,123.60
本期末	-	-	-

单位：人民币元

华富天益货币 B			
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	408,460,962.14	-	408,460,962.14
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	-408,460,962.14	-	-408,460,962.14
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,074,610.19
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	141,854,638.88
结算备付金利息收入	972,587.38
其他	-
合计	146,901,836.45

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。

6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期无股票投资收益

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	300,509.94
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	300,509.94

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	28,198,762,516.67
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	28,187,720,006.73
减：应收利息总额	10,742,000.00
买卖债券差价收入	300,509.94

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益

6.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期内无公允价值变动收益

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

注：本基金本报告期内无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	71,944.77

银行汇划费用	52,675.50
债券帐户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	163,056.06

注：其他所列金额为上清所查询服务费。

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

无

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金管理人、注册登记人、销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

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

注：本报告期内和上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本报告期内和上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本报告期内和上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期内和上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本报告期内和上年度可比期间内本基金无应付关联方佣金。

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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	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	23,103,710.28	24,790,191.31
其中：支付销售机构的客户维护费	7.59	30.47

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	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	7,701,236.73	8,263,397.12

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

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		
	2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富天益货币 A	华富天益货币 B	合计
华富基金管理有限公司（管理人）	626.31	1,540,014.06	1,540,640.37
上海浦东发展银行（托管人）	-	-	-
华安证券股份有限公司（管理人股东）	136.98	-	136.98

合计	763.29	1,540,014.06	1,540,777.35
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	华富天益货币 A	华富天益货币 B	合计
华富基金管理有限公司 (管理人)	156.54	1,652,351.40	1,652,507.94
上海浦东发展银行(托管人)	-	-	-
华安证券股份有限公司 (管理人股东)	536.53	-	536.53
合计	693.07	1,652,351.40	1,653,044.47

注：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。

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

单位：人民币元

本期 2019年1月1日至2019年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上海浦东发展银行	-	-	-	-	379,136,000.00	126,283.40
上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上海浦东发展银行	-	-	-	-	-	-

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

注：本基金本报告期和上年度可比期间内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

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

华富天益货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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
上海浦东发展银行总行	27,373,861,411.62	96.2500%	27,012,333,110.39	96.3900%

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。

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	8,344,242.46	4,074,610.19	75,785,841.17	6,476,392.61

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.10.6 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

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

华富天益货币 A

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
7,104.38	19.22	-	7,123.60	-

华富天益货币 B

已按再投资形式转实收基	直接通过应付	应付利润	本期利润分配合	备注
-------------	--------	------	---------	----

金	赎回款转出金额	本年变动	计	
407,874,801.79	586,160.35	-	408,460,962.14	-

6.4.12 期末（2019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

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

本基金本报告期末无正回购余额。

6.4.12.3.2 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。

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。

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，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发行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。

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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	15,000,256.62	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	15,000,256.62	0.00

注：数据按摊余成本计算，未包括应收利息。列示对象包括短期融资券等货币基金可投资的短期信用产品。信用等级按期末评级结果列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
AA+	0.00	0.00
未评级	9,367,034,452.77	10,242,832,906.89
合计	9,367,034,452.77	10,242,832,906.89

6.4.13.2.4 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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
其中低于 AA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	0.00	0.00
----	------	------

注：数据按摊余成本计算，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、企业债、商业银行债、非银行金融债等货币基金可投资的信用产品。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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	6,138,410,534.88	8,550,790,998.23
AAA 以下	3,228,623,917.89	1,692,041,908.66
AA+	1,788,688,707.04	1,692,041,908.66
其中低于 AA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	9,367,034,452.77	10,242,832,906.89

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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。

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，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	8,344,242.46	7,340,000,000.00	-	-	-	-	7,348,344,242.46
结算备付金	141,900,000.00	-	-	-	-	-	141,900,000.00
交易性金融资产	40,056,543.09	9,783,533,673.00	1,184,776,619.63	-	-	-	11,008,366,835.72
买入返售金融资产	9,900,981,961.47	-	-	-	-	-	9,900,981,961.47
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,455,294.65	2,455,294.65
应收利息	-	-	-	-	-	43,650,954.98	43,650,954.98
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	10,091,282,747.02	17,123,533,673.00	1,184,776,619.63	-	-	46,106,249.63	28,445,699,289.28
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,642,961.67	3,642,961.67
应付托管费	-	-	-	-	-	1,214,320.54	1,214,320.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-	243,067.33	243,067.33
应付交易费用	-	-	-	-	-	123,808.94	123,808.94
其他负债	-	-	-	-	-	100,780.56	100,780.56
负债总计	-	-	-	-	-	5,324,939.04	5,324,939.04
利率敏感度缺口	10,091,282,747.02	17,123,533,673.00	1,184,776,619.63	-	-	40,781,310.59	28,440,374,350.24
上年度末 2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,291,316,038.45	6,600,000,000.00	-	-	-	-	10,891,316,038.45
结算备付金	90,909,090.91	-	-	-	-	-	90,909,090.91
交易性金融资产	609,653,438.94	9,863,260,133.57	1,349,629,292.79	-	-	-	11,822,542,865.30
买入返售金融资产	7,461,333,067.00	-	-	-	-	-	7,461,333,067.00
应收利息	-	-	-	-	-	34,742,524.96	34,742,524.96
资产总计	12,453,211,635.30	16,463,260,133.57	1,349,629,292.79	-	-	34,742,524.96	30,300,843,586.62
负债							

应付证券清算款	-	-	-	-	2,270,000,000.00	2,270,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,798,203.52	3,798,203.52
应付托管费	-	-	-	-	1,266,067.85	1,266,067.85
应付销售服务费	-	-	-	-	253,251.60	253,251.60
应付交易费用	-	-	-	-	146,308.19	146,308.19
其他负债	-	-	-	-	359,000.00	359,000.00
负债总计	-	-	-	-	2,275,822,831.16	2,275,822,831.16
利率敏感度缺口	12,453,211,635.30	16,463,260,133.57	1,349,629,292.79	-	-2,241,080,306.20	28,025,020,755.46

注：本表各期限按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早作为期限分类标准。

6.4.13.4.1.2 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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率下降 25 基点	6,334,627.09	6,804,612.33
市场利率上升 25 基点	-6,324,994.77	-6,791,311.97	

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

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。

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

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。

6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间 95%
	2. 观察期 1年

分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2019 年 6 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
		合计	884,977,558.02

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	11,008,366,835.72	38.70
	其中:债券	11,008,366,835.72	38.70
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	9,900,981,961.47	34.81
	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	7,490,244,242.46	26.33
4	其他各项资产	46,106,249.63	0.16
5	合计	28,445,699,289.28	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。

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	1.21	
	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%

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	56
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	10

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。

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比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	35.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	0.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	59.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	1.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	2.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.87	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 240 天。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,639,890,566.14	5.77
	其中：政策性金融债	1,639,890,566.14	5.77
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	9,368,476,269.58	32.94
8	其他	-	-

9	合计	11,008,366,835.72	38.71
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。

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	180312	18 进出 12	8,200,000	820,198,284.61	2.88
2	111915253	19 民生银行 CD253	5,000,000	497,080,545.58	1.75
3	111903077	19 农业银行 CD077	5,000,000	497,022,882.88	1.75
4	111916166	19 上海银行 CD166	5,000,000	497,022,565.13	1.75
4	111981058	19 广州农村商业银行 CD075	5,000,000	497,022,565.13	1.75
5	111981018	19 重庆农村商业银行 CD144	5,000,000	496,987,963.68	1.75
6	111916164	19 上海银行 CD164	5,000,000	496,976,664.35	1.75
7	111980969	19 苏州银行 CD151	5,000,000	496,964,584.23	1.75
8	111906170	19 交通银行 CD170	5,000,000	496,944,509.99	1.75
9	111916159	19 上海银行 CD159	5,000,000	496,944,061.05	1.75
10	111980854	19 东莞农村商业银行 CD059	5,000,000	496,919,352.83	1.75

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0393%
报告期内偏离度的最低值	-0.0031%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0182%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本报告期内本基金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

注：本报告期内本基金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前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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，在其剩余存续期内按实际利率法进行摊销，每日计提收益或损失。

7.9.2 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的情况的说明

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。

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	2,455,294.65
3	应收利息	43,650,954.98
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	46,106,249.63

7.9.4 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。

§ 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
华富天益货币 A	44	23,316.05	781,646.80	76.19%	244,259.54	23.81%
华富天益货币 B	6	4,739,891,407.31	28,439,348,443.90	100.00%	0.00	0.00%
合计	50	568,807,487.00	28,440,130,090.70	100.00%	244,259.54	0.00%

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。

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	27,373,861,411.62	96.25%
2	银行类机构	614,810,050.66	2.16%
3	银行类机构	203,844,232.53	0.72%
4	信托类机构	200,000,000.00	0.70%
5	信托类机构	30,865,770.47	0.11%
6	基金类机构	10,017,808.99	0.04%
7	保险类机构	741,282.70	0.00%
8	个人	220,594.86	0.00%
9	银行类机构	40,364.10	0.00%
10	个人	18,088.98	0.00%

8.3 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。

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

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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	华富天益货币 A	华富天益货币 B
基金合同生效日（2017 年 1 月 25 日）基金份额总额	79,717.58	200,002,000.00
本报告期期初基金份额总额	186,508.77	28,024,834,246.69
本报告期期间基金总申购份额	1,131,738.82	11,213,926,416.99
减：本报告期期间基金总赎回份额	292,341.25	10,799,412,219.78
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,025,906.34	28,439,348,443.90

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

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、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天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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，翁海波先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

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，翁海波先生不再担任华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

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，翁海波先生不再担任华富物联世界灵活配置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，增聘张惠女士为华富弘鑫灵活配置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第六届董事会第一次会议审议通过，因工作需要，余海春先生不再担任公司总经理职务，聘任曹华玮先生担任公司总经理。

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，增聘张亮先生为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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，增聘倪莉莎女士为华富货币市场基金基金经理。

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，增聘郦彬先生为华富量子生命力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，尹培俊先生、姚姣姣女士不再担任华富货币市场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，姚姣姣女士不再担任华富天盈货币市场基金基金经理的职务。

12、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、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。

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	
民生证券	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），我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，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几家券商租用了基金专用交易单元。

2) 本报告期本基金租用券商交易单元无变更。

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		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
民生证券	-	-	140,595,000,000.00	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。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

注：无

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	《华富天益货币市场基金 2018 年第 4 季度报告》	上证报及公司网站	2019 年 1 月 21 日
2	《华富天益货币市场基金招募说明书(更新)(2019 年第 1 号)》	公司网站	2019 年 3 月 9 日
3	《华富天益货币市场基金招募说明书(更新)(摘要)(2019 年第 1 号)》	上证报及公司网站	2019 年 3 月 9 日
4	《华富基金管理有限公司关于旗下所有基金在直销渠道面向养老金客户开展费率优惠的公告》	上证报及公司网站	2019 年 3 月 15 日
5	《华富天益货币市场基金 2018 年度报告》	公司网站	2019 年 3 月 26 日
6	《华富天益货币市场基金 2018 年度报告摘要》	上证报及公司网站	2019 年 3 月 26 日
7	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加奕丰基金销售有限公司为代销机构的公告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 11 日
8	《关于华富基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与奕丰基金销售有限公司费率优惠活动的公告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 11 日
9	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加南京苏宁基金销售有限公司为代销机构的公告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 11 日
10	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 17 日
11	《关于华富基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 17 日
12	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华安证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 18 日
13	《华富天益货币市场基金 2019 年第 1 季度报告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 20 日
14	《华富基金管理有限公司关于变更总经理的公告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 23 日
15	《华富基金管理有限公司关于	上证报及公司网站	2019 年 4 月 23 日

	旗下部分开放式基金增加阳光人寿保险股份有限公司为代销机构的公告》		
16	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海利得基金销售有限公司为代销机构的公告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 29 日
17	《华富基金管理有限公司关于旗下基金在浙江金观诚基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告》	上证报及公司网站	2019 年 5 月 7 日
18	《华富基金管理有限公司澄清公告》	上证报及公司网站	2019 年 5 月 14 日
19	《华富基金管理有限公司关于系统暂停网上交易服务的通知》	上证报及公司网站	2019 年 5 月 25 日
20	《华富基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告》	上证报及公司网站	2019 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	1.1-6.30	27,012,333,110.39	361,528,301.23	0.00	27,373,861,411.62	96.25%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、华富天益货币市场基金基金合同
- 2、华富天益货币市场基金托管协议
- 3、华富天益货币市场基金招募说明书
- 4、报告期内华富天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

基金管理人、基金托管人处

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, 相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。