

# 华富天盈货币市场基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 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

报告送出日期：2019 年 10 月 22 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为 2019 年 7 月 1 日至 2019 年 9 月 30 日。

## § 2 基金产品概况

|                 |  |                  |
|-----------------|--|------------------|
| 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   |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 108,330,048.05 份   |                  |
| 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。   |                  |
| 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   |                  |
| 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 | 1,038,681.74 份   | 107,291,366.31 份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标      | 报告期（2019年7月1日—2019年9月30日） |                |
|-------------|---------------------------|----------------|
|             | 华富天盈货币 A                  | 华富天盈货币 B       |
| 1. 本期已实现收益  | 6,501.78                  | 510,793.99     |
| 2. 本期利润     | 6,501.78                  | 510,793.99     |
| 3. 期末基金资产净值 | 1,038,681.74              | 107,291,366.31 |

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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    | 净值收益率①  | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④     |
|-------|---------|-----------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.5461% | 0.0028%   | 0.3403%    | 0.0000%       | 0.2058% | 0.0028% |

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。

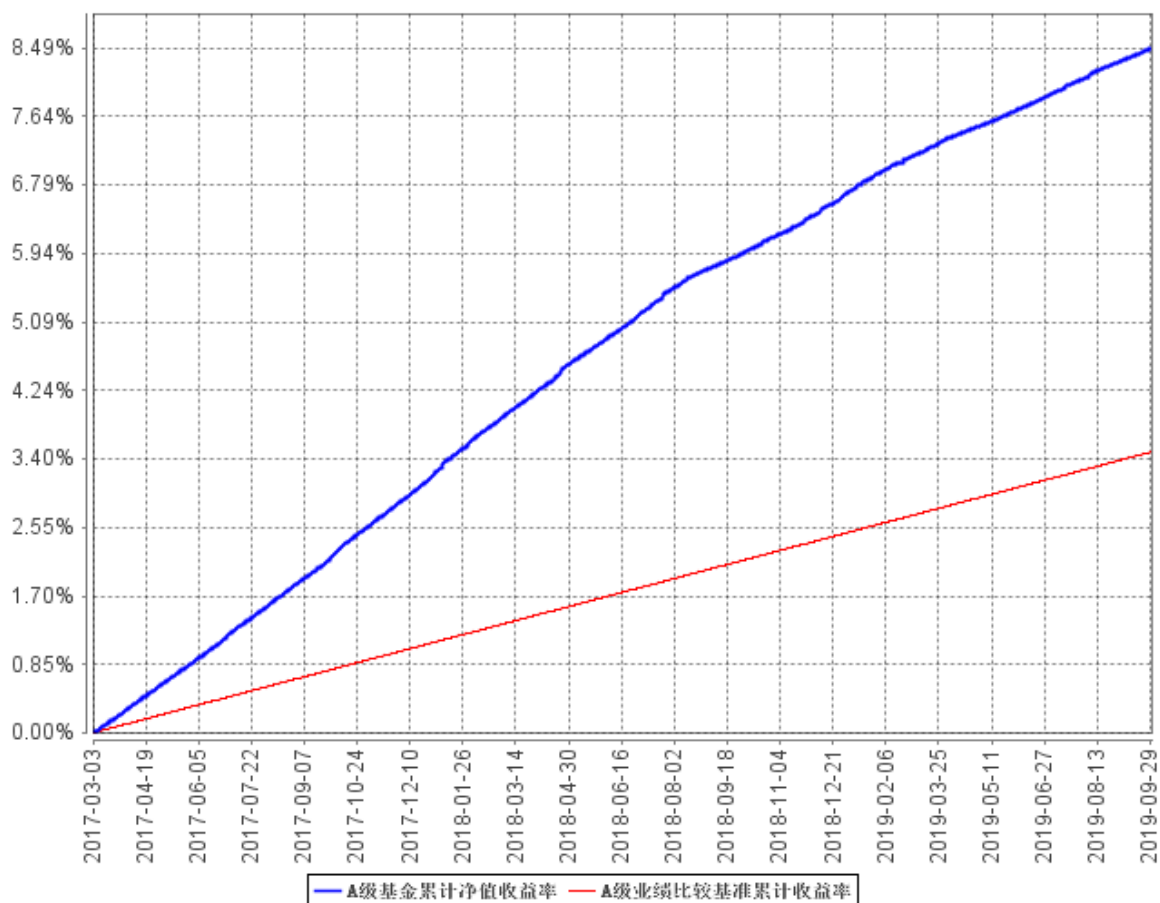
华富天盈货币 B

| 阶段    | 净值收益率①  | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④     |
|-------|---------|-----------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.6071% | 0.0027%   | 0.3403%    | 0.0000%       | 0.2668% | 0.0027% |

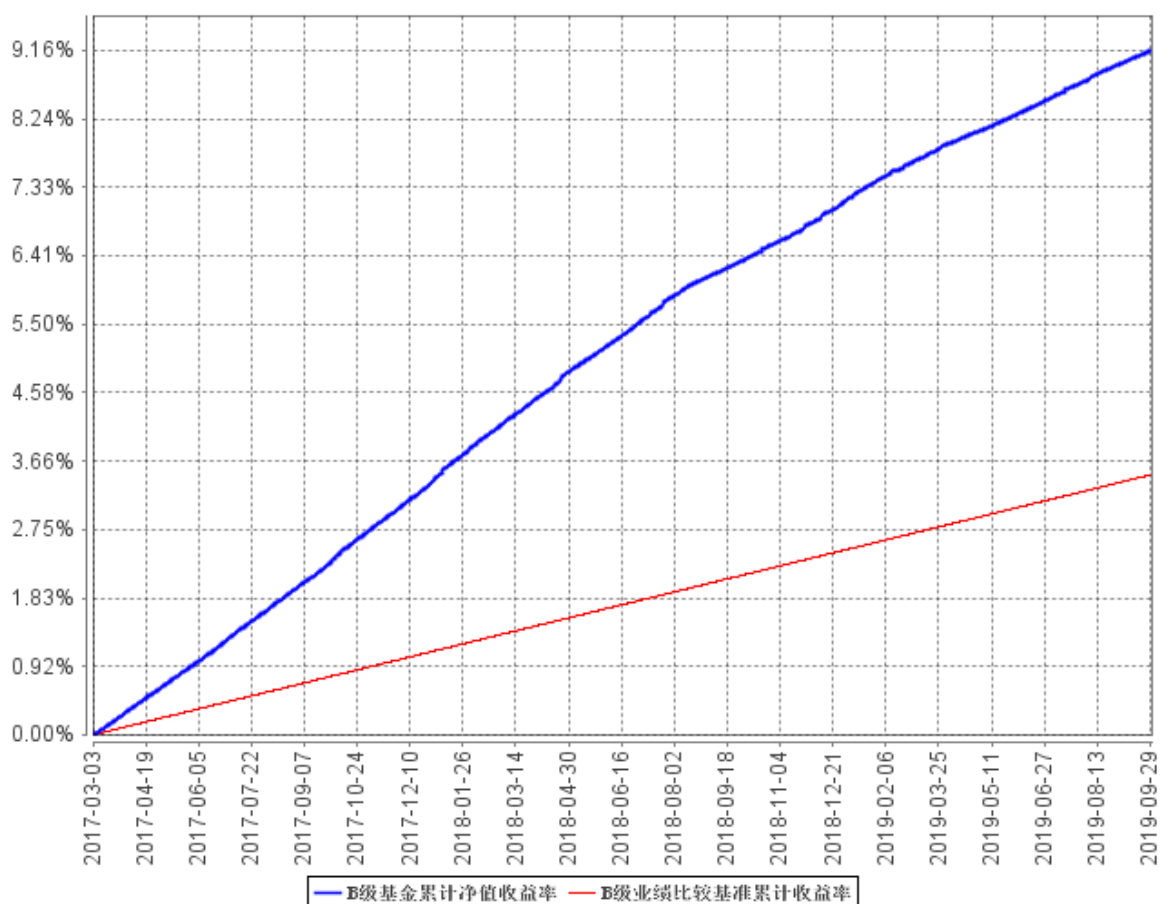
注：业绩比较基准收益率=同期七天通知存款利率（税后），业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

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：本基金建仓期为 2017 年 3 月 3 日到 2017 年 11 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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务   | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|--|-----------------|------|--------|---|
|     |  | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 倪莉莎 | 华富天盈货币市场基金基金经理、华富恒财定期开放债券型基金基金经理、华富恒玖 3 个月定期开放债券型基金基金经理、华富富瑞 3 个 | 2017 年 9 月 12 日 | -    | 五年     | 英国曼彻斯特大学管理学硕士，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、华富天盈货币市场基金、华富益鑫灵活配置混合型基金的基金经理助理，2018 年 6 月 25 日至 2019 |

|    |  |                 |   |    |  |
|----|--|-----------------|---|----|--|
|    | 月定期开放债券型发起式基金基金经理、华富弘鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富恒盛纯债债券型基金基金经理、华富货币市场基金基金经理 |                 |   |    | 年 3 月 28 日任华富恒悦定期开放债券型基金基金经理。  |
| 陶祺 | 华富天盈货币市场基金基金经理、华富恒欣纯债债券型基金基金经理                                   | 2019 年 9 月 23 日 | - | 六年 | 英国巴斯大学金融与风险专业硕士，研究生学历。曾任上海新世纪资信评估投资服务有限公司信评分析师，平安资产管理有限责任公司信用评级经理，2016 年 6 月加入华富基金管理有限公司，曾任固定收益部信用债研究员、基金经理助理。 |

注：这里的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，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 公平交易专项说明

### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度经济数据延续弱势，经济下行压力较大。制造业 PMI 数据长期处在荣枯线以下，9 月数据虽改善，但难改全年趋势。中美贸易仍处冲突状态，全年看进出口仍面临较大的下行压力。制造业投资在 3% 附近低位徘徊，实体投资意愿较弱，地产投资顶部回落，基建增速受益政策托举小幅回暖，但难对固投整体形成有效支撑。消费数据窄幅震荡，汽车消费的负面影响逐渐消退，但新增需求有限。通胀方面，三季度猪肉带动食品价格持续上行，CPI 读数呈上升趋势。总体而言，三季度各月公布的宏观经济高频数据多不及市场预期，经济增长继续承压，但猪价带动通胀预期，逐渐成为市场关注的焦点。

三季度资金利率较二季度上调，回升至年内均值，流动性边际上有所收紧，但流动性基调未发生变化，资金中枢水平基本维持。8 月初汇率“破 7 破后，月末再次连续贬值，外汇占款减少，对国内流动性构成边际压力，8 月中下旬受税期影响，叠加政府债券发行价款规模相对较大，LPR 首次报价仅下降 5BP 使得市场宽松预期落空，资金面偏紧。8 月末财政存款支出下达，流动性边际转松，资金价格边际小幅回落，9 月降准为市场提供增量资金，但公开市场操作净回笼，且季末月缴准压力有所放大，跨季资金需求抬升，流动性压力因素增多，降准后货币市场并未过度乐观。总体上，回购加权利率从季度初的低点回升，并在 2.5%-3% 的正常水平区间窄幅波动，资金供给总体充裕。

本基金由于总规模较小，且规模稳定性差，因此产品运作上以短久期高流动性资产为主，杠杆比例为 0。

展望四季度，地产融资收紧、制造业投资乏力，经济上行空间狭窄，基本面仍处在底部区域。中美冲突是长期矛盾，短期难以解决，贸易战对经济的负面影响持续存在，维稳任务高于一切，财政政策和货币政策将保持积极和宽松的大基调。外围经济表现弱于国内，海外货币政策将继续宽松，境外投资人对利率债增持态势不减。但是，我们也看到当前国内通胀预期不断增强，四季度 CPI 破 3 较为确定，央行货币政策难有超预期宽松，另外明年专项债也可能提前发行，供给冲击再现。资金面来看，四季度资金价格中枢应较前三季度有一定上行，但上行幅度可控，在稳增长大背景下，货币政策总体宽松基调未变，市场供需平衡，流动性紧张事件难以在年内重现，不会对市场造成突然性的冲击。在操作上，考虑到本基金的特点，产品运作仍以高等级短久期银行

存单、证券公司短期融资券和 7 天内逆回购为主，杠杆维持在 0 水平。

#### 4.5 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。三季度华富天盈货币 A 类基金份额净值收益率为 0.5461%，期间业绩比较基准 0.3403%，期间年化收益率 2.1610%。华富天盈货币 B 类基金份额净值收益率为 0.6071%，期间业绩比较基准 0.3403%，期间年化收益率 2.4014%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2018 年 10 月 29 日起至本报告期末（2019 年 9 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 9 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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 固定收益投资            | 49,894,686.45  | 45.99        |
|    | 其中：债券             | 49,894,686.45  | 45.99        |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 2  | 买入返售金融资产          | 32,324,283.99  | 29.80        |
|    | 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      | 26,114,282.66  | 24.07        |
| 4  | 其他资产              | 153,029.04     | 0.14         |
| 5  | 合计                | 108,486,282.14 | 100.00       |

### 5.2 报告期债券回购融资情况



| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例（%） |               |
|----|--------------|---------------|---------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 3.69          |               |
|    | 其中：买断式回购融资   | -             |               |
| 序号 | 项目           | 金额（元）         | 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   | -             | -             |

### 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%。

## 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 44 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 59 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 36 |

### 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。

### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限                 | 各期限资产占基金资产净值的比例（%） | 各期限负债占基金资产净值的比例（%） |
|----|------------------------|--------------------|--------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 40.09              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30 天(含)-60 天           | 30.36              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 3  | 60 天(含)-90 天           | 27.69              | -                  |
|    | 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)      | 1.86               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397         | -                  | -                  |

|  |         |        |   |
|--|---------|--------|---|
|  | 天的浮动利率债 |        |   |
|  | 合计      | 100.00 | - |

#### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

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。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种                 | 摊余成本（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------------------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券                 | -             | -            |
| 2  | 央行票据                 | -             | -            |
| 3  | 金融债券                 | 5,011,870.21  | 4.63         |
|    | 其中：政策性金融债            | 5,011,870.21  | 4.63         |
| 4  | 企业债券                 | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券              | 5,000,106.73  | 4.62         |
| 6  | 中期票据                 | -             | -            |
| 7  | 同业存单                 | 39,882,709.51 | 36.82        |
| 8  | 其他                   | -             | -            |
| 9  | 合计                   | 49,894,686.45 | 46.06        |
| 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。

#### 5.6 报告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

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 债券数量（张） | 摊余成本（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 111914014 | 19 江苏银行 CD014 | 100,000 | 9,989,713.83 | 9.22         |
| 2  | 111921287 | 19 渤海银行 CD287 | 100,000 | 9,968,032.89 | 9.20         |
| 3  | 111813166 | 18 浙商银行 CD166 | 100,000 | 9,962,603.85 | 9.20         |
| 4  | 111985525 | 19 杭州银行 CD061 | 100,000 | 9,962,358.94 | 9.20         |
| 5  | 071900090 | 19 广发证券 CP005 | 50,000  | 5,000,106.73 | 4.62         |
| 6  | 108901    | 农发 1801       | 30,000  | 3,000,227.32 | 2.77         |
| 7  | 170205    | 17 国开 05      | 20,000  | 2,011,642.89 | 1.86         |

## 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况     |
|-------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0520%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0164% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0194%  |

### 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。

## 5.8 报告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。

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 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。

### 5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 564.23     |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收利息    | 152,464.81 |
| 4  | 应收申购款   | -          |
| 5  | 其他应收款   | -          |
| 6  | 待摊费用    | -          |

|   |    |            |
|---|----|------------|
| 7 | 其他 | -          |
| 8 | 合计 | 153,029.04 |

#### 5.9.4 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。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目           | 华富天盈货币 A     | 华富天盈货币 B       |
|--------------|--------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额  | 1,142,687.05 | 115,108,384.51 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 728,844.00   | 60,357,285.94  |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 832,849.31   | 68,174,304.14  |
| 报告期期末基金份额总额  | 1,038,681.74 | 107,291,366.31 |

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式  | 交易日期       | 交易份额(份)  | 交易金额(元)  | 适用费率  |
|----|-------|------------|----------|----------|-------|
| 1  | 红利再投资 | 2019年7月1日  | 1,431.82 | 1,431.82 | 0.00% |
| 2  | 红利再投资 | 2019年7月1日  | 2,473.19 | 2,473.19 | 0.00% |
| 3  | 红利再投资 | 2019年7月2日  | 498.45   | 498.45   | 0.00% |
| 4  | 红利再投资 | 2019年7月2日  | 860.97   | 860.97   | 0.00% |
| 5  | 红利再投资 | 2019年7月3日  | 456.44   | 456.44   | 0.00% |
| 6  | 红利再投资 | 2019年7月3日  | 788.41   | 788.41   | 0.00% |
| 7  | 红利再投资 | 2019年7月4日  | 840.89   | 840.89   | 0.00% |
| 8  | 红利再投资 | 2019年7月4日  | 486.82   | 486.82   | 0.00% |
| 9  | 红利再投资 | 2019年7月5日  | 830.20   | 830.20   | 0.00% |
| 10 | 红利再投资 | 2019年7月5日  | 480.64   | 480.64   | 0.00% |
| 11 | 红利再投资 | 2019年7月8日  | 1,458.81 | 1,458.81 | 0.00% |
| 12 | 红利再投资 | 2019年7月8日  | 2,519.81 | 2,519.81 | 0.00% |
| 13 | 红利再投资 | 2019年7月9日  | 472.45   | 472.45   | 0.00% |
| 14 | 红利再投资 | 2019年7月9日  | 816.07   | 816.07   | 0.00% |
| 15 | 红利再投资 | 2019年7月10日 | 424.07   | 424.07   | 0.00% |
| 16 | 红利再投资 | 2019年7月10日 | 732.51   | 732.51   | 0.00% |
| 17 | 红利再投资 | 2019年7月11日 | 422.97   | 422.97   | 0.00% |
| 18 | 红利再投资 | 2019年7月11日 | 730.59   | 730.59   | 0.00% |
| 19 | 红利再投资 | 2019年7月12日 | 422.11   | 422.11   | 0.00% |
| 20 | 红利再投资 | 2019年7月12日 | 729.11   | 729.11   | 0.00% |
| 21 | 红利再投资 | 2019年7月15日 | 1,263.47 | 1,263.47 | 0.00% |

|    |       |                 |          |          |       |
|----|-------|-----------------|----------|----------|-------|
| 22 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 15 日 | 2,182.40 | 2,182.40 | 0.00% |
| 23 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 16 日 | 420.45   | 420.45   | 0.00% |
| 24 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 16 日 | 726.25   | 726.25   | 0.00% |
| 25 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 17 日 | 1,776.93 | 1,776.93 | 0.00% |
| 26 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 17 日 | 3,069.30 | 3,069.30 | 0.00% |
| 27 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 18 日 | 419.53   | 419.53   | 0.00% |
| 28 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 18 日 | 724.66   | 724.66   | 0.00% |
| 29 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 19 日 | 439.14   | 439.14   | 0.00% |
| 30 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 19 日 | 758.52   | 758.52   | 0.00% |
| 31 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 22 日 | 2,182.55 | 2,182.55 | 0.00% |
| 32 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 22 日 | 1,263.56 | 1,263.56 | 0.00% |
| 33 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 23 日 | 421.72   | 421.72   | 0.00% |
| 34 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 23 日 | 728.44   | 728.44   | 0.00% |
| 35 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 24 日 | 739.58   | 739.58   | 0.00% |
| 36 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 24 日 | 428.17   | 428.17   | 0.00% |
| 37 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 25 日 | 410.38   | 410.38   | 0.00% |
| 38 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 25 日 | 708.85   | 708.85   | 0.00% |
| 39 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 26 日 | 703.19   | 703.19   | 0.00% |
| 40 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 26 日 | 407.10   | 407.10   | 0.00% |
| 41 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 29 日 | 2,161.52 | 2,161.52 | 0.00% |
| 42 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 29 日 | 1,251.38 | 1,251.38 | 0.00% |
| 43 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 30 日 | 417.23   | 417.23   | 0.00% |
| 44 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 30 日 | 720.68   | 720.68   | 0.00% |
| 45 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 31 日 | 719.98   | 719.98   | 0.00% |
| 46 | 红利再投资 | 2019 年 7 月 31 日 | 416.82   | 416.82   | 0.00% |
| 47 | 红利再投资 | 2019 年 8 月 1 日  | 852.48   | 852.48   | 0.00% |
| 48 | 红利再投资 | 2019 年 8 月 1 日  | 493.53   | 493.53   | 0.00% |
| 49 | 红利再投资 | 2019 年 8 月 2 日  | 693.59   | 693.59   | 0.00% |
| 50 | 红利再投资 | 2019 年 8 月 2 日  | 401.55   | 401.55   | 0.00% |
| 51 | 红利再投资 | 2019 年 8 月 5 日  | 1,234.31 | 1,234.31 | 0.00% |
| 52 | 红利再投资 | 2019 年 8 月 5 日  | 2,132.03 | 2,132.03 | 0.00% |
| 53 | 红利再投资 | 2019 年 8 月 6 日  | 408.92   | 408.92   | 0.00% |
| 54 | 红利再投资 | 2019 年 8 月 6 日  | 706.34   | 706.34   | 0.00% |
| 55 | 红利再投资 | 2019 年 8 月 7 日  | 410.86   | 410.86   | 0.00% |
| 56 | 红利再投资 | 2019 年 8 月 7 日  | 709.68   | 709.68   | 0.00% |
| 57 | 红利再投资 | 2019 年 8 月 8 日  | 1,461.17 | 1,461.17 | 0.00% |
| 58 | 红利再投资 | 2019 年 8 月 8 日  | 2,523.88 | 2,523.88 | 0.00% |
| 59 | 红利再投资 | 2019 年 8 月 9 日  | 1,232.32 | 1,232.32 | 0.00% |
| 60 | 红利再投资 | 2019 年 8 月 9 日  | 2,128.60 | 2,128.60 | 0.00% |
| 61 | 红利再投资 | 2019 年 8 月 12 日 | 1,250.99 | 1,250.99 | 0.00% |

|     |       |            |          |          |       |
|-----|-------|------------|----------|----------|-------|
| 62  | 红利再投资 | 2019年8月12日 | 2,160.85 | 2,160.85 | 0.00% |
| 63  | 红利再投资 | 2019年8月13日 | 987.78   | 987.78   | 0.00% |
| 64  | 红利再投资 | 2019年8月13日 | 571.86   | 571.86   | 0.00% |
| 65  | 红利再投资 | 2019年8月14日 | 429.33   | 429.33   | 0.00% |
| 66  | 红利再投资 | 2019年8月14日 | 741.59   | 741.59   | 0.00% |
| 67  | 红利再投资 | 2019年8月15日 | 428.55   | 428.55   | 0.00% |
| 68  | 红利再投资 | 2019年8月15日 | 740.24   | 740.24   | 0.00% |
| 69  | 红利再投资 | 2019年8月16日 | 435.39   | 435.39   | 0.00% |
| 70  | 红利再投资 | 2019年8月16日 | 752.06   | 752.06   | 0.00% |
| 71  | 红利再投资 | 2019年8月19日 | 1,306.79 | 1,306.79 | 0.00% |
| 72  | 红利再投资 | 2019年8月19日 | 2,257.23 | 2,257.23 | 0.00% |
| 73  | 红利再投资 | 2019年8月20日 | 738.28   | 738.28   | 0.00% |
| 74  | 红利再投资 | 2019年8月20日 | 427.42   | 427.42   | 0.00% |
| 75  | 红利再投资 | 2019年8月21日 | 716.61   | 716.61   | 0.00% |
| 76  | 红利再投资 | 2019年8月21日 | 414.87   | 414.87   | 0.00% |
| 77  | 红利再投资 | 2019年8月22日 | 434.04   | 434.04   | 0.00% |
| 78  | 红利再投资 | 2019年8月22日 | 749.73   | 749.73   | 0.00% |
| 79  | 红利再投资 | 2019年8月23日 | 432.82   | 432.82   | 0.00% |
| 80  | 红利再投资 | 2019年8月23日 | 747.61   | 747.61   | 0.00% |
| 81  | 红利再投资 | 2019年8月26日 | 1,252.96 | 1,252.96 | 0.00% |
| 82  | 红利再投资 | 2019年8月26日 | 2,164.25 | 2,164.25 | 0.00% |
| 83  | 红利再投资 | 2019年8月27日 | 434.66   | 434.66   | 0.00% |
| 84  | 红利再投资 | 2019年8月27日 | 750.79   | 750.79   | 0.00% |
| 85  | 红利再投资 | 2019年8月28日 | 436.13   | 436.13   | 0.00% |
| 86  | 红利再投资 | 2019年8月28日 | 753.32   | 753.32   | 0.00% |
| 87  | 红利再投资 | 2019年8月29日 | 436.15   | 436.15   | 0.00% |
| 88  | 红利再投资 | 2019年8月29日 | 753.37   | 753.37   | 0.00% |
| 89  | 红利再投资 | 2019年8月30日 | 436.11   | 436.11   | 0.00% |
| 90  | 红利再投资 | 2019年8月30日 | 753.29   | 753.29   | 0.00% |
| 91  | 红利再投资 | 2019年9月2日  | 1,309.90 | 1,309.90 | 0.00% |
| 92  | 红利再投资 | 2019年9月2日  | 2,262.61 | 2,262.61 | 0.00% |
| 93  | 红利再投资 | 2019年9月3日  | 420.99   | 420.99   | 0.00% |
| 94  | 红利再投资 | 2019年9月3日  | 727.17   | 727.17   | 0.00% |
| 95  | 红利再投资 | 2019年9月4日  | 421.01   | 421.01   | 0.00% |
| 96  | 红利再投资 | 2019年9月4日  | 727.22   | 727.22   | 0.00% |
| 97  | 红利再投资 | 2019年9月5日  | 722.23   | 722.23   | 0.00% |
| 98  | 红利再投资 | 2019年9月5日  | 418.12   | 418.12   | 0.00% |
| 99  | 红利再投资 | 2019年9月6日  | 397.85   | 397.85   | 0.00% |
| 100 | 红利再投资 | 2019年9月6日  | 687.21   | 687.21   | 0.00% |
| 101 | 红利再投资 | 2019年9月9日  | 2,096.97 | 2,096.97 | 0.00% |

|     |       |            |            |            |       |
|-----|-------|------------|------------|------------|-------|
| 102 | 红利再投资 | 2019年9月9日  | 1,214.01   | 1,214.01   | 0.00% |
| 103 | 红利再投资 | 2019年9月10日 | 399.59     | 399.59     | 0.00% |
| 104 | 红利再投资 | 2019年9月10日 | 690.22     | 690.22     | 0.00% |
| 105 | 红利再投资 | 2019年9月11日 | 731.83     | 731.83     | 0.00% |
| 106 | 红利再投资 | 2019年9月11日 | 423.68     | 423.68     | 0.00% |
| 107 | 红利再投资 | 2019年9月12日 | 722.53     | 722.53     | 0.00% |
| 108 | 红利再投资 | 2019年9月12日 | 418.30     | 418.30     | 0.00% |
| 109 | 红利再投资 | 2019年9月16日 | 1,693.81   | 1,693.81   | 0.00% |
| 110 | 红利再投资 | 2019年9月16日 | 2,925.72   | 2,925.72   | 0.00% |
| 111 | 红利再投资 | 2019年9月17日 | 735.79     | 735.79     | 0.00% |
| 112 | 红利再投资 | 2019年9月17日 | 425.97     | 425.97     | 0.00% |
| 113 | 红利再投资 | 2019年9月18日 | 728.87     | 728.87     | 0.00% |
| 114 | 红利再投资 | 2019年9月18日 | 421.97     | 421.97     | 0.00% |
| 115 | 红利再投资 | 2019年9月19日 | 728.91     | 728.91     | 0.00% |
| 116 | 红利再投资 | 2019年9月19日 | 421.99     | 421.99     | 0.00% |
| 117 | 红利再投资 | 2019年9月20日 | 423.55     | 423.55     | 0.00% |
| 118 | 红利再投资 | 2019年9月20日 | 731.60     | 731.60     | 0.00% |
| 119 | 红利再投资 | 2019年9月23日 | 1,286.65   | 1,286.65   | 0.00% |
| 120 | 红利再投资 | 2019年9月23日 | 2,222.44   | 2,222.44   | 0.00% |
| 121 | 红利再投资 | 2019年9月24日 | 428.03     | 428.03     | 0.00% |
| 122 | 红利再投资 | 2019年9月24日 | 739.33     | 739.33     | 0.00% |
| 123 | 红利再投资 | 2019年9月25日 | 462.23     | 462.23     | 0.00% |
| 124 | 红利再投资 | 2019年9月25日 | 798.41     | 798.41     | 0.00% |
| 125 | 红利再投资 | 2019年9月26日 | 443.90     | 443.90     | 0.00% |
| 126 | 红利再投资 | 2019年9月26日 | 766.76     | 766.76     | 0.00% |
| 127 | 红利再投资 | 2019年9月27日 | 437.59     | 437.59     | 0.00% |
| 128 | 红利再投资 | 2019年9月27日 | 755.86     | 755.86     | 0.00% |
| 129 | 红利再投资 | 2019年9月30日 | 2,492.83   | 2,492.83   | 0.00% |
| 130 | 红利再投资 | 2019年9月30日 | 1,443.19   | 1,443.19   | 0.00% |
| 合计  |       |            | 119,929.30 | 119,929.30 |       |

注：基金管理人投资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。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 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              | 9.24-9.30               | 0.00 | 55,866,055.00 | 0.00 | 55,866,055.00 | 51.57% |
| 个人     | -              | -                       | -    | -             | -    | -             | -      |
| 产品特有风险 |                |                         |      |               |      |               |        |
| 无      |                |                         |      |               |      |               |        |

## § 9 备查文件目录

### 9.1 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

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 9.3 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。