

# 华富天盈货币市场基金 2020 年中期报告

2020 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
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.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
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.....	20
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 债券回购融资情况.....	40
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	40
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.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 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.....	41

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	42
7.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 .....	42
7.9 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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情况 .....	44
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	47
10.9 其他重大事件.....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>48</b>
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 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华富天盈货币市场基金	
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	57,226,749.81 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	1,002,659.74 份	56,224,090.07 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
	联系电话	021-68886996
	电子邮箱	manzh@hffund.com
客户服务电话	400-700-8001	95561
传真	021-68887997	021-62159217
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	福州市湖东路 154 号

办公地址	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	200120	200041
法定代表人	赵万利	高建平

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金中期报告备置地点	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	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

## § 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年6月30日)	
	华富天盈货币 A	华富天盈货币 B
本期已实现收益	12,932.66	699,279.58
本期利润	12,932.66	699,279.58
本期净值收益率	0.8435%	0.9646%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
	期末基金资产净值	1,002,659.74
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(2020年6月30日)	
	累计净值收益率	9.9946%

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

华富天盈货币 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	0.1221%	0.0021%	0.1110%	0.0000%	0.0111%	0.0021%
过去三个月	0.3269%	0.0020%	0.3366%	0.0000%	-0.0097%	0.0020%
过去六个月	0.8435%	0.0032%	0.6732%	0.0000%	0.1703%	0.0032%
过去一年	1.9435%	0.0027%	1.3537%	0.0000%	0.5898%	0.0027%
过去三年	8.6971%	0.0042%	4.0537%	0.0000%	4.6434%	0.0042%
自基金合同生	9.9946%	0.0041%	4.4975%	0.0000%	5.4971%	0.0041%

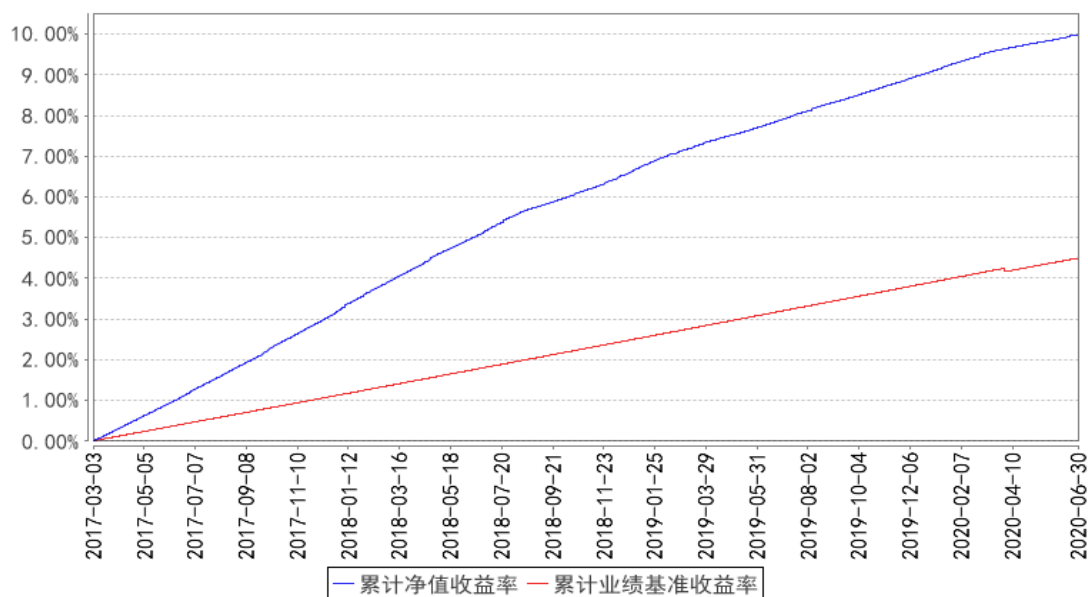
华富天盈货币 B

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
过去一个月	0.1420%	0.0021%	0.1110%	0.0000%	0.0310%	0.0021%
过去三个月	0.3876%	0.0020%	0.3366%	0.0000%	0.0510%	0.0020%
过去六个月	0.9646%	0.0032%	0.6732%	0.0000%	0.2914%	0.0032%
过去一年	2.1898%	0.0027%	1.3537%	0.0000%	0.8361%	0.0027%
过去三年	9.4864%	0.0042%	4.0537%	0.0000%	5.4327%	0.0042%
自基金合同生	10.8794%	0.0041%	4.4975%	0.0000%	6.3819%	0.0041%

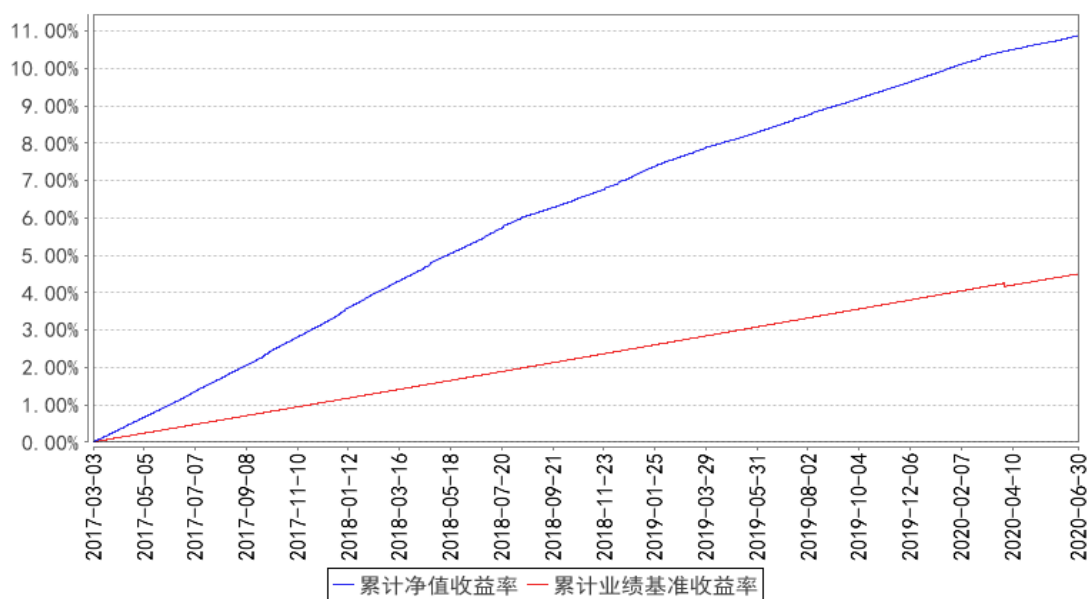
注：业绩比较基准收益率=同期七天通知存款利率（税后），业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

### 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

华富天盈货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华富天盈货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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 2020 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、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中债-0-5 年中高等级信用债收益平衡指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金共四十只基金。

#### 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		
倪莉莎	华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式基金基金经理、华富恒盛纯债债券型基金基金经理、	2017 年 9 月 12 日	2020 年 5 月 11 日	6 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、2018 年 6 月 25 日至 2019 年 3 月 28 日任华富恒悦定期开放债券型基金基金经理，2018 年 8 月 28 日至 2019 年 10 月 16 日任华富弘鑫灵活配置混合型证

	华富货币市场基金基金经理、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理				券投资基金基金经理，2017 年 9 月 12 日至 2019 年 10 月 18 日（最后运作日）任华富恒财定期开放债券型证券投资基金，2018 年 3 月 23 日至 2020 年 3 月 10 日（基金最后运作日）任华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2017 年 9 月 12 日至 2020 年 5 月 11 日任职华富天盈货币市场基金基金经理。
陶祺	这里的离任职日期均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。	2019 年 9 月 23 日		7 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：这里的离任职日期均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遵规守信情况的说明

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

宏观经济回顾：

2020 年上半年。新冠疫情先后在国内外爆发，整个宏观经济环境主线为公共卫生危机与疫情冲击后的复工复产。由于疫情在春节期间爆发升温，导致整个 2 月国内生产接近停滞，2 月制造业 PMI 和非制造业 PMI 分别 35.7 和 29.6，创了有记录以来新低，前 2 个月的工业增加值、社会消费品零售以及固定资产投资均负增长逾 20%。随着三月国内疫情控制较为有效且复工逐渐爬坡，生产恢复情况较好，3 月制造业和非制造业 PMI 均回到 50 以上，一季度实际 GDP 同比录得-6.8%，为有数据以来首次负增长。进入二季度，整个宏观经济呈现从疫情冲击中爬坡态势，4、5、6 月制造业 PMI 分别录得 50.8%、50.4% 以及 50.9%，基本完成疫情 v 型冲击的修复，二季度实际 GDP 同比录得+3.2%，回到正增长区间。生产端基本已经回到疫情之前的水平，4、5、6 月的工业增加值持续提速、固定资产投资也呈现单月正增长，发电耗煤量回到去年同期水平以上，需求端恢复相对较慢，但也结构上呈现积极的一面，房地产为代表的可选消费，日用消费品、消费电子产品等行业已经重回增长区间，而主要拖累总体消费增速的主要是旅游消费和餐饮消费，因此需求端也并不要太过悲观。外需方面，今年贸易顺差走阔、出口对于 GDP 正向拉动，主要原因在于“衰退式顺差”以及救灾物资。随着二季度末 PMI 数据显示出企业订单持续向好、库存有序去化、工业品原材料价格回升等积极迹象，经济逐渐进入弱复苏阶段。

货币信用环境方面，在信贷扩张、债券融资宽松和地方政府专项债下的共振作用下，社会融资余额增速持续高增，上半年新增社融融资规模逾 20 万亿，同时央行上半年累计下调公开市场操作利率 30BP，整体货币政策维持宽松。下半年预计政策面呈现“宽财政、稳货币”的导向。

海外方面，上半年疫情的加剧成为海外经济主线，二季度中后期各国陆续复工复产，但美国等地区仍有疫情反复迹象。此外，疫情对于经济造成压力的同时，民粹主义迹象也进一步显露，各国贸易摩擦也一直未平息。下半年美国临近大选，中美两国摩擦博弈预计难以平复。

#### 资金面：

为对冲“新冠”疫情的负面影响，各国均开启极度货币宽松模式，国内流动性环境亦大幅宽松。一季度，中国央行通过量、价两个维度引导资金利率下行，政策利率方面，1 年期 MLF 下降 10BP 至 3.15%，1 年期 LPR 利率下降 10BP 至 4.05%，5 年期 LPR 利率下降 5BP 至 4.75%，7 天 OMO 操作利率由 2.4% 降至 2.2%，超额准备金利率由 0.72% 降至 0.35%。政策利率不断下调加强了货币宽松的预期，流动性环境极度充裕。二季度，国内流动性先松后紧，波幅较大。4 月，央行频频推出逆周期调节措施，在量上通过对中小行定向降准、加大再贷款额度，对市场投放大量流动性，在价上，通过降低 IOER 利率及 MLF 操作利率压低资金利率，激励银行投放信贷。在宽松政策的推动下，DR007 均值较上月回落 38BP，至 1.46%。5 月至 6 月，随着经济环比恢复，货币政策稍显克制，目标由稳增长转为稳增长与防风险相结合，更加关注资金空转套利。在上述背景下，资金利率逐步回归合理水平。

#### 债券市场回顾：

2020 年一季度，受新冠疫情国内爆发以及随后全球扩散的影响，经济活动遭到明显抑制，海外央行释放大量流动性，货币政策极度宽松，受此影响，权益市场出现大幅调整，Wind 全 A 指数下跌 6.8%，基本抹平了去年 4 季度的涨幅。债市方面，由于公共卫生事件突发和央行以宽松方式引导短端利率下行，市场风险偏好极度收缩，在 1 月中旬后长端利率重启牛市格局，1 月 1 日至 3 月 31 日，10 年国债从 3.15% 下行至 2.59%，下行 56BP，10 年国开债从 3.59% 下行至 2.95%，下行 64BP，短端下行幅度大于长端，1 年国债和 1 年国开收益率分别由 2.36% 和 2.49% 下行至 1.20% 和 1.29%，下行幅度分别为 116BP 和 120BP，曲线整体呈陡峭化，期限利差明显走扩。

二季度，全球新冠疫情形势有所遏制，国内经济活动边际复苏，受此利好，权益市场率先回暖，Wind 全 A 指数上涨 14.76%，创年内新高。债市方面，央行出台大量逆周期调节措施，包含新增再贷款额度 1 万亿、对中小银行定向降准、降低 IOER 利率、降低 MLF 操作利率等，不断对市场释放低成本资金，在流动性的推动下，债市继续上涨，但是 4 月底开始基本面、政策面、机构行为的边际变化，导致债市出现阶段调整。基本面，高频数据、经济数据同比转正，显示经济持续复苏。政策面，央行多场合表态偏鹰，包含反对赤字货币化、坚持总量政策适度、考虑前期政策工具适时退出等，导致市场乐观情绪有所修正。同时，5 月以来机构去杠杆过程中形成的踩踏，也助推了 5-6 月债市的调整。

#### 基金操作回顾：

回顾 2020 年上半年的基金操作，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行了规范运作。在债券投资上，根据市场行情的节奏变化及时进行了合理的组合调整，在保证各项监管指标合规和信用风险可控的前提下尽量增厚产品收益，最大化基金持有人的利益。

#### 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。上半年华富天盈货币 A 类基金份额净值收益率为 0.8435%，期间业绩比较基准 0.6732%，期间年化收益率 1.6846%。华富天盈货币 B 类基金份额净值收益率为 0.9646%，期间业绩比较基准 0.6732%，期间年化收益率 1.9253%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

##### 宏观经济回顾：

2020 年上半年。新冠疫情先后在国内外爆发，整个宏观经济环境主线为公共卫生危机与疫情冲击后的复工复产。由于疫情在春节期间爆发升温，导致整个 2 月国内生产接近停滞，2 月制造业 PMI 和非制造业 PMI 分别 35.7 和 29.6，创了有记录以来新低，前 2 个月的工业增加值、社会消费品零售以及固定资产投资均负增长逾 20%。随着三月国内疫情控制较为有效且复工逐渐爬坡，生产恢复情况较好，3 月制造业和非制造业 PMI 均回到 50 以上，一季度实际 GDP 同比录得-6.8%，为有数据以来首次负增长。进入二季度，整个宏观经济呈现从疫情冲击中爬坡态势，4、5、6 月制造业 PMI 分别录得 50.8%、50.4%以及 50.9%，基本完成疫情 v 型冲击的修复，二季度实际 GDP 同比录得+3.2%，回到正增长区间。生产端基本已经回到疫情之前的水平，4、5、6 月的工业增加值持续提速、固定资产投资也呈现单月正增长，发电耗煤量回到去年同期水平以上，需求端恢复相对较慢，但也结构上呈现积极的一面，房地产为代表的可选消费，日用消费品、消费电子产品等行业已经重回增长区间，而主要拖累总体消费增速的主要是旅游消费和餐饮消费，因此需求端也并不用太过悲观。外需方面，今年贸易顺差走阔、出口对于 GDP 正向拉动，主要原因在于“衰退式顺差”以及救灾物资。随着二季度末 PMI 数据显示出企业订单持续向好、库存有序去化、工业品原材料价格回升等积极迹象，经济逐渐进入弱复苏阶段。

货币信用环境方面，在信贷扩张、债券融资宽松和地方政府专项债下的共振作用下，社会融资金额增速持续高增，上半年新增社融融资规模逾 20 万亿，同时央行上半年累计下调公开市场操作利率 30BP，整体货币政策维持宽松。下半年预计政策面呈现“宽财政、稳货币”的导向。

海外方面，上半年疫情的加剧成为海外经济主线，二季度中后期各国陆续复工复产，但美国

等地区仍有疫情反复迹象。此外，疫情对于经济造成压力的同时，民粹主义迹象也进一步显露，各国贸易摩擦也一直未平息。下半年美国临近大选，中美两国摩擦博弈预计难以平复。

#### 资金面：

为对冲“新冠”疫情的负面影响，各国均开启极度货币宽松模式，国内流动性环境亦大幅宽松。一季度，中国央行通过量、价两个维度引导资金利率下行，政策利率方面，1 年期 MLF 下降 10BP 至 3.15%，1 年期 LPR 利率下降 10BP 至 4.05%，5 年期 LPR 利率下降 5BP 至 4.75%，7 天 OMO 操作利率由 2.4% 降至 2.2%，超额准备金利率由 0.72% 降至 0.35%。政策利率不断下调加强了货币宽松的预期，流动性环境极度充裕。二季度，国内流动性先松后紧，波幅较大。4 月，央行频频推出逆周期调节措施，在量上通过对中小行定向降准、加大再贷款额度，对市场投放大量流动性，在价上，通过降低 IOER 利率及 MLF 操作利率压低资金利率，激励银行投放信贷。在宽松政策的推动下，DR007 均值较上月回落 38BP，至 1.46%。5 月至 6 月，随着经济环比恢复，货币政策稍显克制，目标由稳增长转为稳增长与防风险相结合，更加关注资金空转套利。在上述背景下，资金利率逐步回归合理水平。

#### 债券市场回顾：

2020 年一季度，受新冠疫情国内爆发以及随后全球扩散的影响，经济活动遭到明显抑制，海外央行释放大量流动性，货币政策极度宽松，受此影响，权益市场出现大幅调整，Wind 全 A 指数下跌 6.8%，基本抹平了去年 4 季度的涨幅。债市方面，由于公共卫生事件突发和央行以宽松方式引导短端利率下行，市场风险偏好极度收缩，在 1 月中旬后长端利率重启牛市格局，1 月 1 日至 3 月 31 日，10 年国债从 3.15% 下行至 2.59%，下行 56BP，10 年国开债从 3.59% 下行至 2.95%，下行 64BP，短端下行幅度大于长端，1 年国债和 1 年国开收益率分别由 2.36% 和 2.49% 下行至 1.20% 和 1.29%，下行幅度分别为 116BP 和 120BP，曲线整体呈陡峭化，期限利差明显走扩。

二季度，全球新冠疫情形势有所遏制，国内经济活动边际复苏，受此利好，权益市场率先回暖，Wind 全 A 指数上涨 14.76%，创年内新高。债市方面，央行出台大量逆周期调节措施，包含新增再贷款额度 1 万亿、对中小银行定向降准、降低 IOER 利率、降低 MLF 操作利率等，不断对市场释放低成本资金，在流动性的推动下，债市继续上涨，但是 4 月底开始基本面、政策面、机构行为的边际变化，导致债市出现阶段调整。基本面，高频数据、经济数据同比转正，显示经济持续复苏。政策面，央行多场合表态偏鹰，包含反对赤字货币化、坚持总量政策适度、考虑前期政策工具适时退出等，导致市场乐观情绪有所修正。同时，5 月以来机构去杠杆过程中形成的踩踏，也助推了 5-6 月债市的调整。

#### 基金操作回顾：

回顾 2020 年上半年的基金操作，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行了规范运作。在债券投资上，根据市场行情的节奏变化及时进行了合理的组合调整，在保证各项监管指标合规和信用风险可控的前提下尽量增厚产品收益，最大化基金持有人的利益。

#### 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 12,932.66 元，B 级应分配收益 699,279.58 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 2020 年 05 月 07 日起至本报告期末（2020 年 06 月 30 日），本基金持有人数存在连续二十个工作日不满二百人的情形，至本报告期末（2020 年 06 月 30 日）本基金持有人数仍低于二百人。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。

从 2020 年 05 月 21 日起至本报告期末（2020 年 06 月 30 日），本基金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，至本报告期末（2020 年 06 月 30 日）基金资产净值仍低于五千万元。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。

## § 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 托管人对本中期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中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华富天盈货币市场基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,381,767.78	25,829,786.82
结算备付金		479,608.70	211,905.48
存出保证金		175.60	1,006.40
交易性金融资产	6.4.7.2	36,971,786.30	54,459,654.42
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		36,971,786.30	54,459,654.42
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	14,500,122.50	25,225,259.39
应收证券清算款		623.29	4,803,423.52



应收利息	6.4.7.5	109,002.67	302,479.60
应收股利		-	-
应收申购款		500.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		57,443,586.84	110,833,515.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		-	5,000,000.00
应付证券清算款		-	5,300,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,502.63	17,034.54
应付托管费		1,625.66	4,258.66
应付销售服务费		535.56	1,030.88
应付交易费用	6.4.7.7	3,967.89	5,791.52
应交税费		-	116.06
应付利息		-	852.34
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	204,205.29	169,681.84
负债合计		216,837.03	10,498,765.84
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	57,226,749.81	100,334,749.79
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		57,226,749.81	100,334,749.79
负债和所有者权益总计		57,443,586.84	110,833,515.63

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 57226749.81 份，其中华富天盈货币 A 基金份额总额 1,002,659.74 份，基金份额净值 1.0000 元；华富天盈货币 B 基金份额总额 56,224,090.07 份，基金份额净值 1.0000 元。

## 6.2 利润表

会计主体：华富天盈货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		927,951.21	1,742,056.48

1. 利息收入		897,129.85	1,679,179.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	184,690.32	432,873.56
债券利息收入		487,793.36	801,065.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		224,646.17	445,239.81
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		30,821.36	62,877.30
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	30,821.36	62,877.30
资产支持证券投资	6.4.7.13.3	-	-
收益			
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	-	-
减：二、费用		215,738.97	326,593.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	70,497.54	112,015.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	17,624.39	28,003.82
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,569.68	8,258.68
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		23,266.12	73,766.18
其中：卖出回购金融资产支出		23,266.12	73,766.18
6. 税金及附加		123.26	192.33
7. 其他费用	6.4.7.20	98,657.98	104,357.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		712,212.24	1,415,462.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		712,212.24	1,415,462.54

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：华富天盈货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	100,334,749.79	-	100,334,749.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	712,212.24	712,212.24
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)	-43,107,999.98	-	-43,107,999.98
其中：1. 基金申购款	92,547,063.88	-	92,547,063.88
2. 基金赎回款	-135,655,063.86	-	-135,655,063.86
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)	-	-712,212.24	-712,212.24
五、期末所有者权益(基金净值)	57,226,749.81	-	57,226,749.81
项目	上年度可比期间 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)	114,428,270.81	-	114,428,270.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,415,462.54	1,415,462.54
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)	1,822,800.75	-	1,822,800.75

其中：1. 基金申购款	237,773,821.86	-	237,773,821.86
2. 基金赎回款	-235,951,021.11	-	-235,951,021.11
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）	-	-1,415,462.54	-1,415,462.54
五、期末所有者权益（基金净值）	116,251,071.56	-	116,251,071.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵万里

曹华玮

邵恒

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

### 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 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% 的征收率缴纳增值税。

（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。

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	1%、2%

[注]：接地方税务局通知，自 2019 年 7 月 1 日起调整地方教育附加税税率，由原来的 1%调整为 2%。

#### 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	5,381,767.78
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	-
合计	5,381,767.78

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	3,997,218.72	4,002,500.00	5,281.28	0.0092
	银行间市场	32,974,567.58	32,974,400.00	-167.58	-0.0003
	合计	36,971,786.30	36,976,900.00	5,113.70	0.0089
资产支持证券	-	-	-	-	
合计	36,971,786.30	36,976,900.00	5,113.70	0.0089	

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。

##### 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 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	9,500,000.00	-
银行间市场	5,000,122.50	-
合计	14,500,122.50	-

##### 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 2020年6月30日
应收活期存款利息	164.02
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	215.80
应收债券利息	107,357.41
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,265.34
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.10
合计	109,002.67

注：1) 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。

2) 本表列示的其他为应收结算保证金利息。

#### 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 2020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	3,967.89
合计	3,967.89

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
上清账户维护费	4,500.00
应付审计费	14,918.54
应付汇划费	614.41
中债账户维护费	4,500.00
应付信息披露费	179,672.34
合计	204,205.29

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 华富天盈货币 A

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	824,998.80	824,998.80
本期申购	9,612,143.07	9,612,143.07
本期赎回（以“-”号填列）	-9,434,482.13	-9,434,482.13
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,002,659.74	1,002,659.74

## 华富天盈货币 B

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	99,509,750.99	99,509,750.99
本期申购	82,934,920.81	82,934,920.81
本期赎回（以“-”号填列）	-126,220,581.73	-126,220,581.73



-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	56,224,090.07	56,224,090.07

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

华富天盈货币 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	12,932.66	-	12,932.66
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	-12,932.66	-	-12,932.66
本期末	-	-	-
华富天盈货币 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	699,279.58	-	699,279.58
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	-699,279.58	-	-699,279.58
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	15,372.26
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	163,141.64
结算备付金利息收入	6,171.30
其他	5.12
合计	184,690.32

注：1) 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。

2) 其他所列本期金额为结算保证金利息收入。

#### 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 2020年1月1日至2020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	30,821.36
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	30,821.36

##### 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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	106,792,368.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	106,436,261.93
减：应收利息总额	325,285.33
买卖债券差价收入	30,821.36

##### 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 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	5,467.10
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	98,657.98

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、基金销售机构、注册登记机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 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：本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
华安证券	3,620,520.00	100.00	8,931,923.78	100.00

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
华安证券	861,028,000.00	100.00	101,800,000.00	100.00

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本报告期内未产生佣金。

## 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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	70,497.54	112,015.05
其中：支付销售机构的客户维护费	677.36	5,047.10

注：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。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	17,624.39	28,003.82

注：支付基金托管人兴业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。

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30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	605.64	71.19	676.83
华富基金管理有限公司	138.65	3,357.10	3,495.75
合计	744.29	3,428.29	4,172.58
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	华富天盈货币 A	华富天盈货币 B	合计
华安证券	478.32	2,297.81	2,776.13
华富基金管理有限公司	320.18	3,191.52	3,511.70
合计	798.50	5,489.33	6,287.83

注：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，按月支付给华富基金管理有限公司，再由华富基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

## 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30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	0.00
期初持有的基金份额	0.00	22,576,904.40
期间申购/买入总份额	0.00	29,128,951.80
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	36,408,283.98
期末持有的基金份额	0.00	15,297,572.22
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	26.73%
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30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	0.00
期初持有的基金份额	0.00	44,957,480.70
期间申购/买入总份额	0.00	4,367,420.06
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	30,000,000.00
期末持有的基金份额	0.00	19,324,900.76
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	16.62%

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。

## 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

份额单位：份

## 华富天盈货币 A

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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 (%)
-	-	-	-	-

份额单位：份

## 华富天盈货币 B

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	20,923,463.42	36.56	20723254.68	20.65

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。

## 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
兴业银行股份有 限公司	5,381,767.78	15,372.26	988,904.34	14,937.83

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

单位：人民币元



华富天盈货币 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
12,829.15	103.51	-	12,932.66	-
华富天盈货币 B				
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
698,694.96	584.62	-	699,279.58	-

#### 6.4.12 期末(2020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

注：本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	4,000,240.81	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	5,019,228.33
合计	4,000,240.81	5,019,228.33

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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	28,974,326.77	39,834,580.61
合计	28,974,326.77	39,834,580.61

#### 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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	4,000,240.81	5,019,228.33
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	4,000,240.81	5,019,228.33

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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	28,974,326.77	39,834,580.61
AAA 以下	-	-
其中低于 AA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	28,974,326.77	39,834,580.61

#### 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 7.4.12 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 2020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	5,381,767.78	-	-	-	-	-	5,381,767.78
结算备付金	479,608.70	-	-	-	-	-	479,608.70
存出保证金	175.60	-	-	-	-	-	175.60
交易性金融资产	29,974,224.36	6,997,561.94	-	-	-	-	36,971,786.30
买入返售金融资产	14,500,122.50	-	-	-	-	-	14,500,122.50
应收利息	-	-	-	-	-	109,002.67	109,002.67

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	500.00	500.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	623.29	623.29
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	50,335,898.94	6,997,561.94	-	-	-	110,125.96	57,443,586.84
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,502.63	6,502.63
应付托管费	-	-	-	-	-	1,625.66	1,625.66
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	535.56	535.56
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,967.89	3,967.89
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	204,205.29	204,205.29
负债总计	-	-	-	-	-	216,837.03	216,837.03
利率敏感度缺口	50,335,898.94	6,997,561.94	-	-	-	-106,711.07	57,226,749.81
上年度末 2019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	829,786.82	25,000,000.00	-	-	-	-	25,829,786.82
结算备付金	211,905.48	-	-	-	-	-	211,905.48
存出保证金	1,006.40	-	-	-	-	-	1,006.40
交易性金融资产	9,974,772.59	34,879,036.35	9,605,845.48	-	-	-	54,459,654.42
买入返售金融资产	25,225,259.39	-	-	-	-	-	25,225,259.39
应收利息	-	-	-	-	-	302,479.60	302,479.60
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,803,423.52	4,803,423.52
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	36,242,730.68	59,879,036.35	9,605,845.48	-	-	5,105,903.12	110,833,515.63
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	17,034.54	17,034.54
应付托管费	-	-	-	-	-	4,258.66	4,258.66
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,300,000.00	5,300,000.00
卖出回购金融资产款	5,000,000.00	-	-	-	-	-	5,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,030.88	1,030.88
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,791.52	5,791.52
应付利息	-	-	-	-	-	852.34	852.34
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	116.06	116.06
其他负债	-	-	-	-	-	169,681.84	169,681.84
负债总计	5,000,000.00	-	-	-	-	5,498,765.84	10,498,765.84
利率敏感度缺口	31,242,730.68	59,879,036.35	9,605,845.48	-	-	-392,862.72	100,334,749.79

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。

#### 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		
	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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率下降 25 基点	7,398.98	25,898.97
	市场利率上升 25 基点	-7,389.74	-25,837.70

#### 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

-

	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（2020年6月 30日）	上年度末（2019年 12月31日）	
		-	-	-
	合计		6,580,212.27	11,611,781.87

#### 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	36,971,786.30	64.36
	其中：债券	36,971,786.30	64.36
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	14,500,122.50	25.24
	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	5,861,376.48	10.20
-	-	-	-
4	其他各项资产	110,301.56	0.19
5	合计	57,443,586.84	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	2.79	
	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	19
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	56
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	17

### 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的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	84.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	3.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	12.23	-
	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）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		100.19	-

#### 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。

#### 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	3,997,218.72	6.98
	其中：政策性 金融债	3,997,218.72	6.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融 资券	4,000,240.81	6.99
6	中期票据	-	-
7	同业存单	28,974,326.77	50.63
8	其他	-	-
9	合计	36,971,786.30	64.61
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	111918236	19 华夏银行 CD236	100,000	9,992,018.93	17.46
2	111909239	19 浦发银行 CD239	60,000	5,992,542.15	10.47
3	111911123	19 平安银行 CD123	60,000	5,992,187.09	10.47

4	111781322	17 杭州银行 CD144	50,000	5,001,376.54	8.74
5	018061	进出 1911	30,000	2,997,321.13	5.24
6	072000160	20 国金证券 CP004	20,000	2,000,128.61	3.50
7	072000146	20 国信证券 CP008	20,000	2,000,112.20	3.50
8	111904060	19 中国银行 CD060	20,000	1,996,202.06	3.49
9	108801	进出 1901	10,000	999,897.59	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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1818%
报告期内偏离度的最低值	-0.0007%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0802%

### 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。

### 7.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

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	175.60
2	应收证券清算款	623.29
3	应收利息	109,002.67
4	应收申购款	500.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	110,301.56

### 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(%)
华富天盈货币A	135	7,427.11	0.00	0.00	1,002,659.74	100.00
华富天盈货币B	3	18,741,363.36	56,224,090.07	100.00	0.00	0.00
合	138	414,686.59	56,224,090.07	98.25	1,002,659.74	1.75

计					
---	--	--	--	--	--

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自份额级别的比例，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	基金类机构	20923463.42	36.56
2	保险类机构	20000000.00	34.95
3	基金类机构	15297572.22	26.73
4	个人	344757.29	0.60
5	个人	100433.24	0.18
6	个人	100409.31	0.18
7	个人	66721.49	0.12
8	个人	30492.54	0.05
9	个人	24248.44	0.04
10	个人	21552.01	0.04

## 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情况

注：本报告期末基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额。

## § 9 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
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	824,998.80	99,509,750.99
本报告期基金总申购 份额	9,612,143.07	82,934,920.81
减：本报告期基金总 赎回份额	9,434,482.13	126,220,581.73
本报告期基金拆分变 动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期期末基金份 额总额	1,002,659.74	56,224,090.07

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. 2020 年 2 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜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。
2. 2020 年 2 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜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。
3. 2020 年 2 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜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。
4. 2020 年 2 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜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。
5. 2020 年 2 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜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。
6. 2020 年 2 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜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。
7. 2020 年 4 月 21 日，华富基金管理有限公司第六届董事会第六次会议审议通过，因工作需要，聘任邵恒先生担任公司副总经理职务。
8. 2020 年 5 月 11 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，倪莉莎女士不再担任华富天盈货币市场基金基金经理的职务。
9. 2020 年 5 月 11 日，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，增聘陶祺先生为华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
10. 2020 年 5 月 11 日，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，增聘陶祺先生为华富恒盛纯债债券型证券投资基金基金经理。
11. 2020 年 5 月 11 日，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，增聘陶祺先生为华富货币市场基金基金经理。
12. 2020 年 5 月 11 日，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，增聘陶祺先生为华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。
13. 2020 年 6 月 28 日，华富基金管理有限公司第六届董事会第七次会议审议通过，因工作需要，

章宏韬先生不再担任公司董事长职务，聘任赵万利先生担任公司董事长。

14. 本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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	
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)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。

#### 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	成交金额	占当期权证

		比例		成交总额的 比例		成交总额的 比例
华安证券	3,620,520.00	100.00%	861,028,000.00	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	《华富基金管理有限公司关于公司住所变更的公告》	中国证监会指定媒介	2020年1月8日
2	《华富天盈货币市场基金“春节”假期结束恢复申购及转入业务的公告》	中国证监会指定媒介	2020年1月18日
3	《华富天盈货币市场基金“春节”假期前暂停申购及转入业务的公告》	中国证监会指定媒介	2020年1月18日
4	《华富基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020年1月21日
5	《华富天盈货币市场基金 2019 年第 4 季度报告》	中国证监会指定媒介	2020年1月21日
6	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金招募说明书（更新）的提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020年2月29日
7	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020年3月13日
8	《华富基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告》	中国证监会指定媒介	2020年3月26日
9	《华富基金管理有限公司关于系统暂停服务的通知》	中国证监会指定媒介	2020年3月28日
10	《华富基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	中国证监会指定媒介	2020年4月22日
11	《华富基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第一季度报告提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020年4月22日
12	《华富天盈货币市场基金 2020 年第 1 季度报告》	中国证监会指定媒介	2020年4月22日
13	《华富基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年年度报告提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020年4月29日
14	《华富天盈货币市场基金 2019 年年度报告》	中国证监会指定媒介	2020年4月29日
15	《华富基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告》	中国证监会指定媒介	2020年5月8日

16	《华富基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 5 月 12 日
17	《关于华富天盈货币市场基金招募说明书（更新）的提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 5 月 14 日
18	《华富天盈货币市场基金招募说明书（更新）（摘要）》	中国证监会指定媒介	2020 年 5 月 14 日
19	《华富天盈货币市场基金招募说明书（更新）》	中国证监会指定媒介	2020 年 5 月 14 日
20	《华富基金管理有限公司关于恢复银联支付通道服务的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 6 月 1 日
21	《华富天盈货币市场基金“端午”假期结束恢复申购及转入业务的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 6 月 23 日
22	《华富天盈货币市场基金“端午”假期前暂停申购及转入业务的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 6 月 23 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	2020.1.1-2020.6.30	20,723,254.88	200,208.54	0.00	20,923,463.42	36.56



	2	2020.6.30-2020.6.30	0.00	20,000,000.00	0.00	20,000,000.00	34.95
	3	2020.1.1-2020.6.30	22,576,904.40	29,128,951.80	36,408,283.98	15,297,572.22	26.73
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媒介上披露的各项公告

### 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。

华富基金管理有限公司

2020年8月31日