

# 富安达现金货币市场证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 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。本中期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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至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	5
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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	13
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	14
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 托管人对本中期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）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 债券回购融资情况	45
7.3 基金投资组合平均剩余期限	45
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	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	47
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	48
7.8 期末按公允价值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	48
7.9 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	51
§9 开放式基金份额变动	51

§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	56
10.9 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富安达现金货币市场证券投资基金	
基金简称	富安达现金货币	
基金主代码	710501	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年01月29日	
基金管理人	富安达基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,790,995,495.72份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富安达现金货币A	富安达现金货币B
下属分级基金的交易代码	710501	710502
报告期末下属分级基金的份额总额	103,099,751.31份	4,687,895,744.41份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将在保持基金资产安全性和高流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金管理人采用自上而下的富安达多维经济模型，运用定性与定量分析方法，通过对宏观经济指标的分析，包括全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平变动趋势、市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、货币供应量等，对短期利率走势进行综合判断，并根据动态预期决定和调整组合的平均剩余期限。在预期市场利率水平将上升时，适度缩短投资组合的平均剩余期限；在预期市场利率水平将下降时，适度延长投资组合的平均剩余期限。
业绩比较基准	同期活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金是货币市场基金，其长期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金、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		富安达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李理想	陆志俊
	联系电话	021-61870999	95559
	电子邮箱	service@fadfunds.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999	95559
传真		021-61870888	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）长宁区仙霞路1 8号
邮政编码		200122	200336
法定代表人		张睿	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富安达基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1568号中 建大厦29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 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	富安达现金货币 A	富安达现金货币 B
本期已实现收益	597,206.64	36,181,942.30
本期利润	597,206.64	36,181,942.30
本期净值收益率	0.8617%	0.9818%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末基金资产净值	103,099,751.31	4,687,895,744.41
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 (2023年06月30日)	
累计净值收益率	33.6928%	37.0821%

注：

1. 本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。
2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于本基金为采用摊余成本法核算的货币市场基金，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. 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

富安达现金货币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	0.1374%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.1086%	0.0003%
过去三个月	0.4333%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.3460%	0.0004%
过去六个月	0.8617%	0.0008%	0.1737%	0.0000%	0.6880%	0.0008%
过去一年	1.5480%	0.0010%	0.3506%	0.0000%	1.1974%	0.0010%

过去三年	5.7911%	0.0023%	1.0555%	0.0000%	4.7356%	0.0023%
自基金合同生效起至今	33.6928%	0.0070%	3.7160%	0.0000%	29.9768%	0.0070%

## 富安达现金货币B

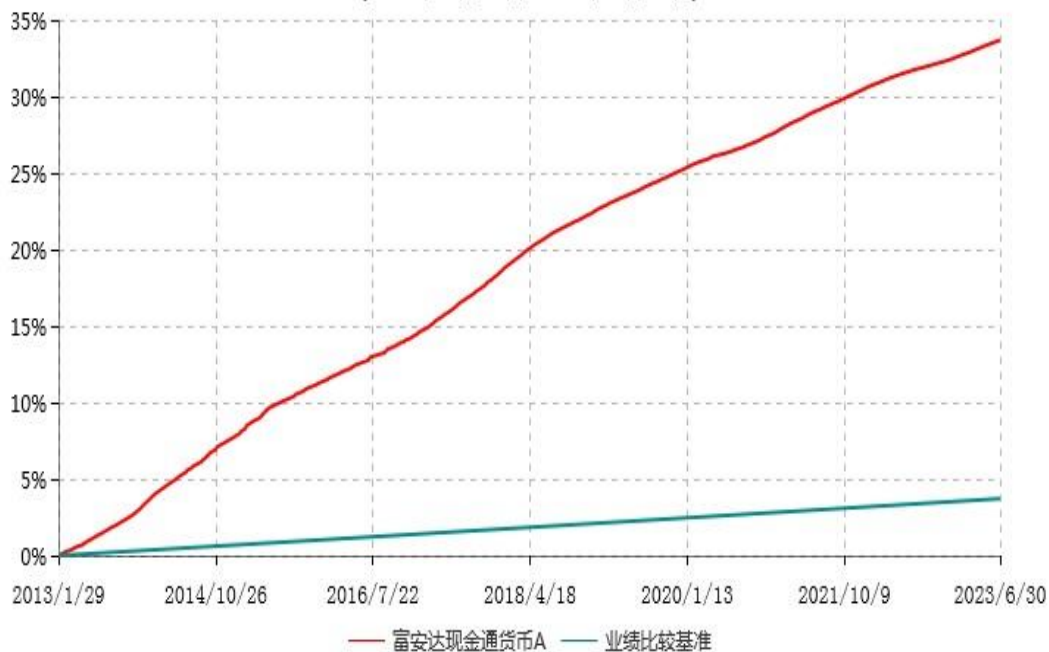
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.1569%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.1281%	0.0003%
过去三个月	0.4931%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.4058%	0.0004%
过去六个月	0.9818%	0.0008%	0.1737%	0.0000%	0.8081%	0.0008%
过去一年	1.7921%	0.0010%	0.3506%	0.0000%	1.4415%	0.0010%
过去三年	6.5555%	0.0023%	1.0555%	0.0000%	5.5000%	0.0023%
自基金合同生效起至今	37.0821%	0.0070%	3.7160%	0.0000%	33.3661%	0.0070%

注：本基金业绩比较基准为同期活期存款利率（税后）。

### 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



富安达现金货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2013年01月29日-2023年06月30日)



富安达现金货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2013年01月29日-2023年06月30日)



## §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

富安达基金管理有限公司由南京证券股份有限公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司三家单位共同发起设立。2021年6月29日，经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2276号文批准，江苏交通控股有限公司将其持有的本公司股权转让给江苏云杉资本管理有限公司。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦，注册资本8.18亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念，以基金持有人利益最大化为首要经营目标，为客户提供卓越的理财服务。

截至2023年6月30日，公司共管理二十三只开放式基金：富安达优势成长混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达现金货币市场证券投资基金、富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金、富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金、富安达消费主题灵活配置混合型证券投资基金、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达中证500指数增强型证券投资基金、富安达科技领航混合型证券投资基金、富安达科技创新混合型发起式证券投资基金、富安长三角区域主题混合型发起式证券投资基金、富安达医药创新混合型证券投资基金、富安达中小盘六个月持有期混合型发起式证券投资基金、富安达成成长价值一年持有期混合型证券投资基金、富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金、富安达先进制造混合型发起式证券投资基金、富安达产业优选混合型证券投资基金、富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金、富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金。

#### 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		
张凯瑜	本基金的基金经理	2013-01-29	2023-02-06	15年	硕士。历任太平人寿保险有限公司产品市场部产品管理员；爱建证券有限责任公司固定收益部债券交易员。2011年5月加入富安达基金管理有限公司。201

					3年1月起任富安达现金货币市场证券投资基金（2013年1月29日至2023年2月6日期间）、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金基金经理（2013年10月25日至2016年10月25日期间）、富安达长盈保本混合型证券投资基金的基金经理(2016年7月22日至2018年5月21日期间)、富安达富利纯债债券型证券投资基金的（2019年7月23日至2023年2月6日期间）基金经理。
康佳燕	本基金的基金经理、固定收益部总监助理	2023-01-13	-	17年	硕士。历任工银安盛人寿保险有限公司财务部投资分析，泰信基金管理有限公司基金会计；浦银安盛基金管理有限公司基金会计、债券交易员、货币基金经理、专户投资经理；南洋商业银行固定收益部投资经理。2021年加入富安达基金管理有限公司。2021年12月起任富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金、富安达现金货币市场证券投资基金、富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金的基金经理。

孙辰 旸	本基金的基金经理助理	2023-0 5-23	-	9 年	硕士。历任富安达资产管理（上海）有限公司产品设计专员。2016年3月加入富安达基金管理有限公司任交易员，曾任富安达现金货币市场证券投资基金基金经理助理（2019年9月25日至2022年6月29日期间）、投资经理。现任债券研究员。2023年5月起任富安达现金货币市场证券投资基金基金经理助理。
---------	------------	----------------	---	--------	---

注：

- 1.任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，任职日期为基金合同生效日。
- 2.证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》，并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系，涵盖了所有投资组合，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节，确保公平对待旗下的每一个投资组合。本报告期内，公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截止报告日，公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析，按照特定计算周期，分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异，未发现公平交易异常情形。

#### 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。

### 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

年初市场对于经济复苏预期较强，叠加跨春节资金价格走高，债券收益率上行。但随着两会经济增速目标设定偏谨慎，以及中微观对经济增长的感受不强，债市逐渐形成温和复苏预期，叠加3月中旬超预期降准，市场对货币政策的分歧有所下降，债市情绪修复。二季度国内经济弱复苏的现实不断得到确认，同时信贷增长后劲不足，市场流动性逐渐宽裕，货币市场利率和债券市场收益率持续下行。6月13日，央行下调逆回购利率10bp，随后长端国债收益率逼近2022年低点，市场情绪高涨。之后，在稳增长政策预期和国际关系阶段性缓和的背景下，债券收益率有所回升，并重新进入小区间震荡格局。

流动性方面，年初信贷开门红导致派生存款消耗较多超储，银行间流动性水位下降，叠加利率债净供给增加、跨春节等因素影响，资金利率回升至政策利率附近宽幅波动。二季度银行间流动性大幅改善，银行间回购成交量回升至高位，超过去年最高峰，市场加杠杆行为进一步加剧。一季度、二季度 DR001均值分别为1.62%和1.46%，DR007均值分别为2.03%和1.93%。AAA级同业存单1年期收益率由年初的2.41%上行至3月初的年内高点2.75%后一路下行至二季度末的2.31%。6月随着跨季临近，资金利率有所上行，但随着降息的落地以及央行净投放的增多，资金面在跨季压力下表现较为平稳。

报告期内，本基金坚持现金管理工具的定位，根据资金面变化以及市场行情，结合基金负债端特点，灵活调整组合资产分布、久期和杠杆，做好风险性、流动性和收益性之间的平衡。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达现金货币A基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.8617%，同期业绩比较基准收益率为0.1737%；截至报告期末富安达现金货币B基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.9818%，同期业绩比较基准收益率为0.1737%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前债市对国内经济弱现实的定价比较充分，同时对政策强力稳增长的预期不高。但三季度基数效应减弱，经济下行压力或加大，政策发力概率增加，建议关注政策预期

差：一是财政、地产和产业等相关政策的出台；二是降准的可能性，因为三季度地方债发行大概率提速，而7-8月为财政上缴大月，超储率有季节性回落的压力。

目前债市收益率水平已接近去年低点，但资金和存单利率仍高于去年低点，10年期国债向下突破2.6%仍存在阻力。我们认为三季度经济环比可能弱改善、货币政策稳健偏松但可能存在汇率制约、机构配置需求不弱等因素共同决定债市收益率上下空间都有限。

四季度经济可能步入主动补库周期，但补库的强度取决于需求的回升程度，预计步入强补库周期的概率较小，债市调整风险相对可控。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司总经理担任估值委员会主席，估值委员会成员由公司总经理、督察长、首席信息官、基金经理、以及投资研究部、固定收益部、多资产投资部、监察稽核部和基金事务部负责人组成，公司其他高级管理人员可列席参会。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议；可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，参与估值程度和估值技术的讨论，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金每日计算分配收益，收益分配采用红利再投资方式，按日结转份额。

本报告期内本基金A类份额应分配利润597,206.64元，已分配利润596,420.42元；本报告期内本基金B类份额应分配利润36,181,942.30元，已分配利润36,203,458.85元。

#### 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

无。

## §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，基金托管人在富安达现金货币市场证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，富安达基金管理有限公司在富安达现金货币市场证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达现金货币市场证券投资基金的中期报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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：富安达现金货币市场证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,735,784,943.66	2,082,204,001.59
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,591,582,376.42	1,244,784,168.95
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,591,582,376.42	1,242,506,049.12
资产支持证券投资		-	2,278,119.83

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,293,997,895.82	1,278,653,996.16
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	3,546,000.00
应收股利		-	-
应收申购款		171,382,390.00	507,822,323.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	9,497.11
资产总计		4,792,747,605.90	5,117,019,987.56
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		591.43	2,017,557.96
应付管理人报酬		838,236.65	844,498.69
应付托管费		209,559.14	211,124.67
应付销售服务费		43,121.44	44,095.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	2,060.26
应付利润		279,595.81	300,326.14



递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	381,005.71	536,821.03
负债合计		1,752,110.18	3,956,484.16
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	4,790,995,495.72	5,113,063,503.40
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		4,790,995,495.72	5,113,063,503.40
负债和净资产总计		4,792,747,605.90	5,117,019,987.56

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额总额4,790,995,495.72份，其中现金通A类基金份额净值1.0000元，基金份额103,099,751.31份；现金通B类基金份额净值1.0000元，基金份额4,687,895,744.41份。

## 6.2 利润表

会计主体：富安达现金货币市场证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		44,145,826.13	66,926,518.14
1.利息收入		27,753,127.49	41,859,942.10
其中：存款利息收入	6.4.7.9	16,938,997.66	27,551,467.06
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,814,129.83	14,308,475.04
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		16,392,698.64	25,066,382.93

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	16,384,142.23	23,575,358.25
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	8,556.41	1,491,024.68
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	-	193.11
<b>减：二、营业总支出</b>		7,366,677.19	10,795,915.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,249,135.53	7,911,997.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,312,283.82	1,977,999.44
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	270,300.22	397,592.61
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		403,200.23	353,398.21
其中：卖出回购金融资产 支出		403,200.23	353,398.21
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		30.79	10,897.00
8. 其他费用	6.4.7.18	131,726.60	144,030.55
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		36,779,148.94	56,130,602.62
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		36,779,148.94	56,130,602.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		36,779,148.94	56,130,602.62

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富安达现金货币市场证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	5,113,063,503.40	-	-	5,113,063,503.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	5,113,063,503.40	-	-	5,113,063,503.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-322,068,007.68	-	-	-322,068,007.68
（一）、综合收益总额	-	-	36,779,148.94	36,779,148.94
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减	-322,068,007.68	-	-	-322,068,007.68

少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	13,230,958,736.14	-	-	13,230,958,736.14
2.基金赎回款	-13,553,026,743.82	-	-	-13,553,026,743.82
(三)、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)	-	-	-36,779,148.94	-36,779,148.94
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	4,790,995,495.72	-	-	4,790,995,495.72
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	8,538,147,598.86	-	-	8,538,147,598.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	8,538,147,598.86	-	-	8,538,147,598.86
三、本期增减变	-3,479,957,728.	-	-	-3,479,957,728.

动额（减少以“-”号填列）	44			44
（一）、综合收益总额	-	-	56,130,602.62	56,130,602.62
（二）、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）	-3,479,957,728.44	-	-	-3,479,957,728.44
其中：1.基金申购款	16,681,650,919.79	-	-	16,681,650,919.79
2.基金赎回款	-20,161,608,648.23	-	-	-20,161,608,648.23
（三）、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）	-	-	-56,130,602.62	-56,130,602.62
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	5,058,189,870.42	-	-	5,058,189,870.42

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：

王胜

孙爱民

王雪

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

富安达现金货币市场证券投资基金(以下简称"本基金")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[2012]1440号《关于核准富安达现金货币市场证券投资基金募集的批复》核准,由富安达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 993,919,179.25元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 25号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》于2013年1月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为994,024,416.12份基金份额,其中认购资金利息折合105,236.87份基金份额。本基金的基金管理人为富安达基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据经批准的《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》和《富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据投资者认(申)购的金额,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,形成A类和B类两类基金份额,其中A类基金份额按照0.25%的年费率计提销售服务费,B类基金份额按照0.01%的年费率计提销售服务费。本基金A类、B类两种收费模式并存,各类基金份额分别设置基金代码,并单独公布每万份基金净收益和7日年化收益率。投资者可自行选择认(申)购的基金份额等级,不同基金份额等级之间不得互相转换,但因认购、申购、赎回、基金转换等交易而发生的基金份额自动升级或者降级的除外。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括现金、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、剩余期限在397天以内(397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及中国证监会、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。本基金的业绩比较基准:同期活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于2023年8月25日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

本基金本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46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]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140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[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固

定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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 2023年06月30日
活期存款	3,746,602.02
等于：本金	3,742,157.03
加：应计利息	4,444.99
减：坏账准备	-
定期存款	1,732,038,341.64
等于：本金	1,725,000,000.00
加：应计利息	7,038,341.64
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	110,149,069.38
存款期限1-3个月	120,209,355.73
存款期限3个月以上	1,501,679,916.53
其他存款	-
等于：本金	-



加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,735,784,943.66

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023年06月30日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	1,591,582,376.4 2	1,591,991,413.6 9	409,037.27	0.0085
	合计	1,591,582,376.4 2	1,591,991,413.6 9	409,037.27	0.0085
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	1,591,582,376.4 2	1,591,991,413.6 9	409,037.27	0.0085

注：

1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；
2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,293,997,895.82	-

合计	1,293,997,895.82	-
----	------------------	---

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8.87
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	52,337.89
其中：交易所市场	-
银行间市场	52,337.89
应付利息	-
预提费用	328,658.95
合计	381,005.71

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 富安达现金货币A

金额单位：人民币元

项目 (富安达现金货币A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	88,041,615.49	88,041,615.49
本期申购	219,743,485.84	219,743,485.84
本期赎回(以“-”号填列)	-204,685,350.02	-204,685,350.02
本期末	103,099,751.31	103,099,751.31

**6.4.7.7.2 富安达现金货币B**

金额单位：人民币元

项目 (富安达现金货币B)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,025,021,887.91	5,025,021,887.91
本期申购	13,011,215,250.30	13,011,215,250.30
本期赎回（以“-”号填列）	-13,348,341,393.80	-13,348,341,393.80
本期末	4,687,895,744.41	4,687,895,744.41

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额。

**6.4.7.8 未分配利润****6.4.7.8.1 富安达现金货币A**

单位：人民币元

项目 (富安达现金货币A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	597,206.64	-	597,206.64
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	-597,206.64	-	-597,206.64
本期末	-	-	-

**6.4.7.8.2 富安达现金货币B**

单位：人民币元

项目 (富安达现金货币B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	36,181,942.30	-	36,181,942.30

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	-36,181,942.30	-	-36,181,942.30
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	39,252.50
定期存款利息收入	16,899,745.16
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	16,938,997.66

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	16,309,241.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	74,900.86
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	16,384,142.23

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,859,507,888.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,847,849,604.75
减：应计利息总额	11,579,857.53
减：交易费用	3,525.00
买卖债券差价收入	74,900.86

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益****6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	8,557.73
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-1.32
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	8,556.41

**6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	2,283,250.43
减：卖出资产支持证券成本总额	2,278,000.00
减：应计利息总额	5,251.75
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-1.32

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	13,947.65
账户维护费	18,000.00
其他	600.00

合计	131,726.60
----	------------

## 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 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

本报告期内，关联方关系未发生变化。

### 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
富安达资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司
南京证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
富安达基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

**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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,249,135.53	7,911,997.71
其中：支付销售机构的客户维护费	696,154.28	1,111,246.39

注：支付基金管理人富安达基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.28%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.28%/当年天数。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,312,283.82	1,977,999.44

注：

支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.07%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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.07%/当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售	本期



服务费的各关联方名称	2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达现金货币A	富安达现金货币B	合计
交通银行股份有限公司	5,122.25	1,097.08	6,219.33
富安达基金管理有限公司	29,051.52	97,333.57	126,385.09
南京证券股份有限公司	3,375.31	252.25	3,627.56
合计	37,549.08	98,682.90	136,231.98
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达现金货币A	富安达现金货币B	合计
交通银行股份有限公司	6,828.12	2,549.05	9,377.17
富安达基金管理有限公司	29,488.18	148,009.89	177,498.07
南京证券股份有限公司	5,011.83	1,470.05	6,481.88
合计	41,328.13	152,028.99	193,357.12

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日A类基金份额和B类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给富安达基金，再由富安达基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%和0.01%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日A/B类基金份额的基金资产净值 X 约定年费率 / 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**

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

富安达现金货币A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
基金合同生效日（2013年01月29日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

富安达现金货币B

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年01月01日至 2023年06月30日	2022年01月01日至 2022年06月30日
基金合同生效日（2013年01月29日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	7,019,022.80	15,393,937.98
报告期间申购/买入总份额	40,687,507.24	34,297,524.23
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	18,500,000.00	44,674,197.34
报告期末持有的基金份额	29,206,530.04	5,017,264.87
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.62%	0.10%

注：

1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入和级别调整入份额；赎回/卖出总份额含转换出、级别调整出份额。
2. 基金管理人投资本基金适用的费率按照招募说明书的规定执行，下同。
3. 持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

#### 6.4.10.5.2 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

富安达现金货币B

关联方名称	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022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
富安达资产管理（上海）有限公司	133,077,422.89	2.8400%	142,974,193.39	2.8500%

注：1. 本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资富安达现金货币A类基金份额。

2.持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

#### 6.4.10.6 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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	3,746,602.02	39,252.50	871,695.77	71,666.90

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

富安达现金货币A

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润 分配合计	备注
596,420.42	-	786.22	597,206.64	-

富安达现金货币B

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润 分配合计	备注
36,203,458.85	-	-21,516.55	36,181,942.30	-

注：本基金在本报告期内累计分配收益36,779,148.94元，其中以红利再投资方式转入实收基金36,799,879.27元，计入应付收益科目-20,730.33元。

#### 6.4.12 期末（2023年06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**

本基金本报告期末无因认购新发/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**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **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从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### **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**

本基金是一只主动管理型货币型基金，其长期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，运用理性分析价值，严格控制风险，通过积极的主动管理优化基金的风险与收益，为投资人带来长期稳定的回报。

本基金的基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系，贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。本基金的基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金的基金管理人在公司层面建立的风险控制委员会以及在董事会层面建立的合规与风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金的基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本基金的基金管理人设立了独立于各业务部门的监察稽核部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，

促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期出具监察稽核报告，报公司督察长、董事。

#### 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人交通银行；定期存款存放在主体信用评级AA+及以上的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用等级在AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金主动投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中主动投资于单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的10%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	264,061,231.62	664,213,486.61
合计	264,061,231.62	664,213,486.61

注：未评级部分为国债、政策性金融债和短期融资券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	2,278,119.83
合计	-	2,278,119.83

注：资产支持证券评级均为AAA。

#### 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,276,598,337.08	578,292,562.51
合计	1,276,598,337.08	578,292,562.51

注：同业存单无债项评级。

#### 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	50,922,807.72	-
合计	50,922,807.72	-

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还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，除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。

于2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约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(净资产)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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过240天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过60天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%。于2023年6月30日，本基金前10名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为39.85%，本基金投资组合的平均剩余期限为47天，平均剩余存续期为47天。本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例超过30%。

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的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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的10%。



同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 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	133,934,249.32	915,379,180.82	686,471,513.52	-	-	-	1,735,784,943.66
交易性金融资产	733,197,060.61	807,462,508.09	50,922,807.72	-	-	-	1,591,582,376.42
买入返售金融资产	1,293,997,895.82	-	-	-	-	-	1,293,997,895.82
应收申	-	-	-	-	-	171,382,390.	171,382,390.00

## 富安达现金货币市场证券投资基金 2023 年中期报告

购款						00	
资产总计	2,161,129,205.75	1,722,841,688.91	737,394,321.24	-	-	171,382,390.00	4,792,747,605.90
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	591.43	591.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	838,236.65	838,236.65
应付托管费	-	-	-	-	-	209,559.14	209,559.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	43,121.44	43,121.44
应付利润	-	-	-	-	-	279,595.81	279,595.81
其他负债	-	-	-	-	-	381,005.71	381,005.71
负债总计	-	-	-	-	-	1,752,110.18	1,752,110.18
利率敏感度缺口	2,161,129,205.75	1,722,841,688.91	737,394,321.24	-	-	169,630,279.82	4,790,995,495.72
上年度末 2022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	947,854,331.14	983,150,750.45	151,198,920.00	-	-	-	2,082,204,001.59
交易性金融资产	324,055,131.89	920,729,037.06	-	-	-	-	1,244,784,168.95
买入返售金融资产	1,278,653,996.16	-	-	-	-	-	1,278,653,996.16
应收清算款	-	-	-	-	-	3,546,000.00	3,546,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-	507,822,323.75	507,822,323.75
其他资产	-	-	-	-	-	9,497.11	9,497.11
资产总计	2,550,563,459.19	1,903,879,787.51	151,198,920.00	-	-	511,377,820.86	5,117,019,987.56
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,017,557.96	2,017,557.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	844,498.69	844,498.69
应付托管费	-	-	-	-	-	211,124.67	211,124.67

应付销售服务费	-	-	-	-	-	44,095.41	44,095.41
应交税费	-	-	-	-	-	2,060.26	2,060.26
应付利润	-	-	-	-	-	300,326.14	300,326.14
其他负债	-	-	-	-	-	536,821.03	536,821.03
负债总计	-	-	-	-	-	3,956,484.16	3,956,484.16
利率敏感度缺口	2,550,563,459.19	1,903,879,787.51	151,198,920.00	-	-	507,421,336.70	5,113,063,503.40

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	508,766.22	364,843.91
	2.市场利率上升25个基点	-508,254.92	-364,599.62

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	1,591,582,376.42	1,244,784,168.95
第三层次	-	-
合计	1,591,582,376.42	1,244,784,168.95

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §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	1,591,582,376.42	33.21
	其中：债券	1,591,582,376.42	33.21
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,293,997,895.82	27.00
	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	1,735,784,943.66	36.22
4	其他各项资产	171,382,390.00	3.58
5	合计	4,792,747,605.90	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.39	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
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

本基金本报告期内，不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

## 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	47
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	68

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23
-------------------	----

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本基金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	45.02	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	23.35	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	12.49	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	5.43	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	9.92	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	96.20	-

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### 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

本报告期内本基金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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	284,553,182.43	5.94
	其中：政策性金融债	284,553,182.43	5.94
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,430,856.91	0.64
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,276,598,337.08	26.65
8	其他	-	-
9	合计	1,591,582,376.42	33.22
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值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)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	220211	22国开11	2,300,000	233,630,374.71	4.88
2	112303051	23农业银行C D051	1,000,000	99,933,581.21	2.09
3	112319124	23恒丰银行C D124	1,000,000	99,924,521.74	2.09
4	112308071	23中信银行C D071	1,000,000	99,919,943.21	2.09
5	112396559	23宁波银行C D059	1,000,000	99,918,975.48	2.09
6	112319137	23恒丰银行C D137	1,000,000	99,869,664.26	2.08
7	112319176	23恒丰银行C D176	1,000,000	99,674,705.94	2.08
8	112205140	22建设银行C D140	1,000,000	99,656,510.60	2.08
9	112317135	23光大银行C	1,000,000	99,655,972.37	2.08

		D135			
10	112211108	22平安银行C D108	1,000,000	99,640,673.79	2.08

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0168%
报告期内偏离度的最低值	-0.0024%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0066%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本基金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

本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

### 7.8 期末按公允价值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

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

鉴于货币市场基金的特性，本基金采用摊余成本法计算基金资产净值，即本基金按持有债券投资的票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价，以摊余的成本计算基金资产净值。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率或交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人采用“影子定价”，即于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行重新评估，当基金资产净值与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为“公允价值变动损益”，并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1.00元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。



**7.9.2 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

在本基金对该证券的投资过程中，本基金管理人在遵守法律法规和公司管理制度的前提下，经公司审慎研究评估，将该证券纳入投资库进行投资。整个过程中严格履行了相关的投资决策程序。

### 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	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	171,382,390.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	171,382,390.00

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

## §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

富安达现金货币A	18,399	5,603.55	70,775,599.81	68.65%	32,324,151.50	31.35%
富安达现金货币B	156	30,050,613.75	4,682,895,479.57	99.89%	5,000,264.84	0.11%
合计	18,555	258,205.09	4,753,671,079.38	99.22%	37,324,416.34	0.78%

注：基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 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	机构	500,083,249.06	10.44%
2	产品	221,540,000.00	4.62%
3	产品	205,494,000.00	4.29%
4	产品	200,033,240.19	4.18%
5	机构	200,010,593.57	4.17%
6	机构	133,077,422.89	2.78%
7	产品	130,074,491.70	2.71%
8	产品	118,716,377.22	2.48%
9	产品	100,181,391.61	2.09%
10	机构	100,000,000.00	2.09%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	富安达现金货币A	152,039.59	0.15%
	富安达现金通	0.00	0.00%

	货币B		
	合计	152,039.59	0.00%

注：持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

#### 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	富安达现金货币A	10~50
	富安达现金货币B	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	富安达现金货币A	0
	富安达现金货币B	0
	合计	0

注：

1. 基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为10至50万份（含）。
2. 本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0。

#### §9 开放式基金份额变动

单位：份

	富安达现金货币A	富安达现金货币B
基金合同生效日(2013年01月29日)基金份额总额	605,313,583.32	388,710,832.80
本报告期期初基金份额总额	88,041,615.49	5,025,021,887.91
本报告期基金总申购份额	219,743,485.84	13,011,215,250.30
减：本报告期基金总赎回份额	204,685,350.02	13,348,341,393.80
本报告期期末基金份额总额	103,099,751.31	4,687,895,744.41

## §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，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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

本基金管理人于2023年6月6日发布公告，自2023年6月5日起聘任王胜为总经理。

本报告期内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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	

安信 证券	1	-	-	-	-	-
大同 证券	1	-	-	-	-	-
东海 证券	1	-	-	-	-	-
方正 证券	1	-	-	-	-	-
国泰 君安	1	-	-	-	-	-
国元 证券	1	-	-	-	-	-
海通 证券	1	-	-	-	-	-
华创 证券	1	-	-	-	-	-
申港 证券	1	-	-	-	-	-
五矿 证券	1	-	-	-	-	-
西南 证券	1	-	-	-	-	-
新时 代证 券	1	-	-	-	-	-
信达 证券	1	-	-	-	-	-
银河 证券	1	-	-	-	-	-
浙商 证券	1	-	-	-	-	-
中金 公司	1	-	-	-	-	-
中泰 证券	1	-	-	-	-	-
财通 证券	2	-	-	-	-	-
长江 证券	2	-	-	-	-	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-

东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-

上海 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源	2	-	-	-	-	-
首创 证券	2	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
西部 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	-	-	-	-	-
招商 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-
中银 国际 证券	2	-	-	-	-	-

注：

1、交易单元的选择标准和程序：

我公司制定了选择券商的标准，即：

(1) 财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与公司具有互补性、最近一年内无重大违法违规行为发生；

(2) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(3) 能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及其他信息咨询服务；

(4) 能根据公司特定要求，提供专门研究报告；

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；能够提供很好的交易执行。

投资研究部对潜在签约券商进行必要的尽职调查，将相应的交易单元租用协议、证券综合服务协议作为附件，发起相应OA审批流程，经审批后用印。

2、在上述租用的券商交易单元中，(56920)山西证券、(016338)五矿证券为本基金本期新增的交易单元。本基金本期剔除交易单元：(55327)大同证券。

### 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

本基金本报告期未通过交易单元进行其他证券投资。

### 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

### 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	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2023-01-05
2	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加深圳市金斧子基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2023-01-11
3	富安达现金货币市场证券投资基金基金经理变更公告	规定媒介	2023-01-14
4	富安达现金货币市场证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2023-01-17
5	富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书(更新)(二〇二三年第一号)	规定媒介	2023-01-17
6	富安达现金货币市场证券投资基金暂停(大额)申购(转换转入、定期定额投资)的公告	规定媒介	2023-01-17
7	富安达基金管理有限公司旗	规定媒介	2023-01-20



	下全部基金季度报告提示性公告		
8	富安达现金货币市场证券投资基金2022年第4季度报告	规定媒介	2023-01-20
9	富安达现金货币市场证券投资基金基金经理变更公告	规定媒介	2023-02-07
10	富安达现金货币市场证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2023-02-07
11	富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书(更新)(二〇二三年第二号)	规定媒介	2023-02-07
12	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2023-03-22
13	富安达现金货币市场证券投资基金关于新增招商银行股份有限公司(招赢通平台)为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务的公告	规定媒介	2023-03-23
14	富安达基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	规定媒介	2023-03-30
15	富安达现金货币市场证券投资基金2022年年度报告	规定媒介	2023-03-30
16	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定媒介	2023-04-21
17	富安达现金货币市场证券投资基金2023年第1季度报告	规定媒介	2023-04-21
18	富安达基金管理有限公司关	规定媒介	2023-04-26

	于系统升级暂停服务的公告		
19	富安达现金货币市场证券投资基金暂停申购（转换转入、定期定额投资）的公告	规定媒介	2023-04-26
20	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2023-05-11
21	富安达基金管理有限公司关于旗下基金所持股票“富瀚微” (300613) 估值调整的公告	规定媒介	2023-05-17
22	富安达基金管理有限公司关于参加平安银行股份有限公司行E通平台费率优惠活动的公告	规定媒介	2023-05-20
23	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2023-05-29
24	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京度小满基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2023-05-30
25	富安达基金管理有限公司关于总经理变更的公告	规定媒介	2023-06-06
26	富安达现金货币市场证券投资基金暂停申购（转换转入、定期定额投资）的公告	规定媒介	2023-06-17
27	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2023-06-20

## §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

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、中国证监会批准富安达现金货币市场证券投资基金设立的文件：  
《富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书》；  
《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》；  
《富安达现金货币市场证券投资基金托管协议》。
- 2、《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 3、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 4、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.fadfunds.com](http://www.fadfunds.com)）查阅。

富安达基金管理有限公司  
二〇二三年八月二十九日