华润元大现金通货币市场基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 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 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 5
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遵规守信情况的说明 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 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 13

§5 托管人报告 13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 .. 13
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 13

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13

6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 净资产（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 19

§7 投资组合报告 39

7.1 期末基金资产组合情况 39
7.2 债券回购融资情况 39
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 40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 40
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 41
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 41
7.8 期末按实际利率计算的账面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..... 42
7.9 投资组合报告附注..... 42
§8 基金份额持有人信息..... 43
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..... 43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... 43
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
§9 开放式基金份额变动..... 44
§10 重大事件揭示..... 45
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..... 45
10.4 基金投资策略的改变..... 45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... 45
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..... 45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... 45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... 46
10.9 其他重大事件..... 47
§11 影响投资者决策的其他重要信息..... 48
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..... 48
§12 备查文件目录..... 48
12.1 备查文件目录..... 48
12.2 存放地点..... 48
12.3 查阅方式..... 48

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华润元大现金通货币市场基金	
基金简称	华润元大现金通货币	
基金主代码	002883	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 27 日	
基金管理人	华润元大基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,786,252,660.06 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华润元大现金通货币 A	华润元大现金通货币 B
下属分级基金的交易代码	002883	002884
报告期末下属分级基金的份额总额	59,967,535.77 份	5,726,285,124.29 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	整体资产配置方面，本基金根据宏观经济形势、央行货币政策、货币市场的资金供求状况等因素，对短期利率走势进行综合判断，并根据前述判断形成的利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限。在类别资产配置上，根据整体策略要求，决定组合中类别资产的配置内容和各类别投资的比例。在个券选择层面，首先将考虑安全性，优先选择高信用等级的债券品种以规避违约风险。
业绩比较基准	按税后计算的中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率（税后），即活期存款基准利率×(1－利息税税率)
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、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		华润元大基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘豫皓	李帅帅
	联系电话	0755-88399008	0755-25878287
	电子邮箱	kf@cryuantafund.com	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		4000-1000-89	95511-3
传真		0755-88399045	0755-82080387

注册地址	深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-05 单元	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-05 单元	深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	518066	518001
法定代表人	费凡	谢永林

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.cryuantafund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和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	华润元大基金管理有限公司	深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-2105 单元

§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 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	华润元大现金通货币 A	华润元大现金通货币 B
本期已实现收益	556,201.57	37,345,102.00
本期利润	556,201.57	37,345,102.00
本期净值收益率	0.9970%	1.0671%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	59,967,535.77	5,726,285,124.29
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 6 月 30 日)	

累计净值收益率	19.3121%	20.4747%

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，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。

2、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

3、本基金的收益分配方式为按日结转份额。

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

华润元大现金通货币 A

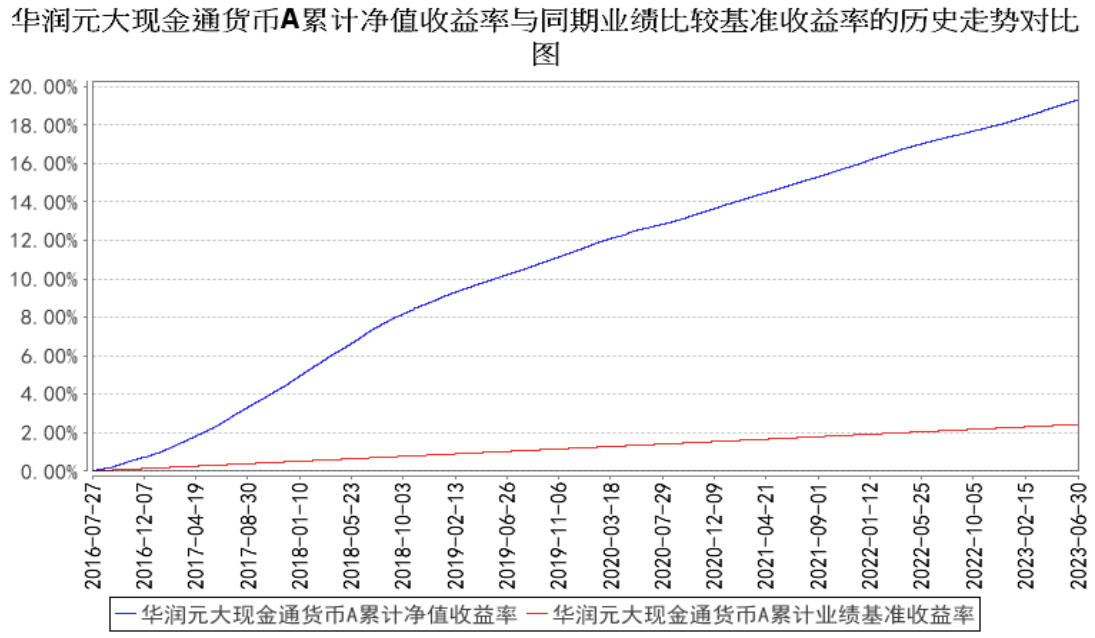
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.1604%	0.0002%	0.0288%	0.0000%	0.1316%	0.0002%
过去三个月	0.5020%	0.0003%	0.0873%	0.0000%	0.4147%	0.0003%
过去六个月	0.9970%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	0.8234%	0.0006%
过去一年	1.7979%	0.0009%	0.3500%	0.0000%	1.4479%	0.0009%
过去三年	5.8774%	0.0009%	1.0500%	0.0000%	4.8274%	0.0009%
自基金合同生效起至今	19.3121%	0.0031%	2.4260%	0.0000%	16.8861%	0.0031%

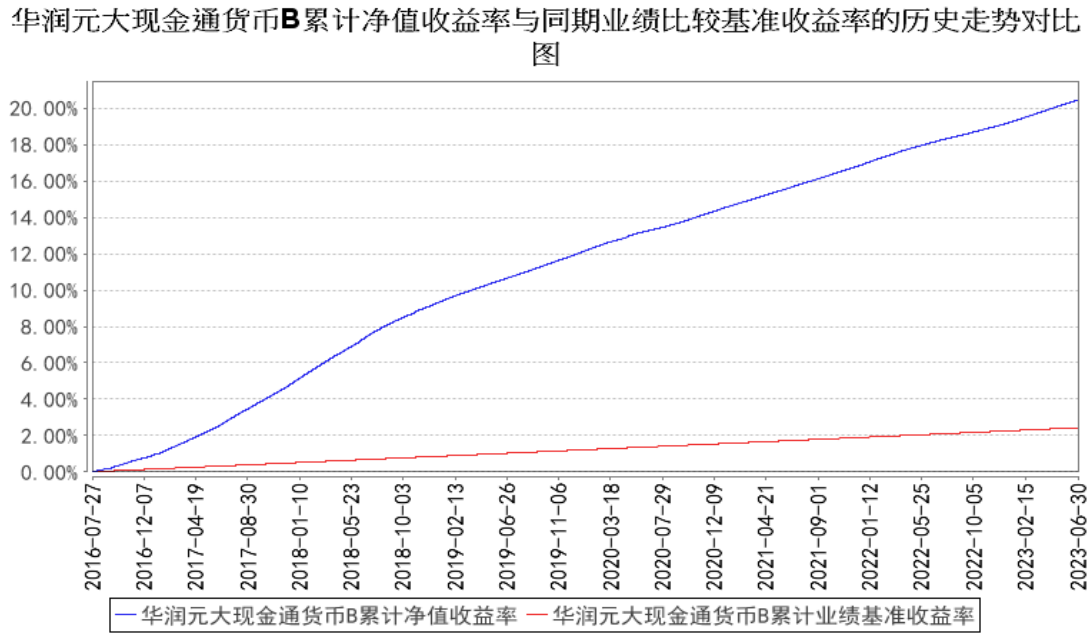
华润元大现金通货币 B

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	0.1720%	0.0002%	0.0288%	0.0000%	0.1432%	0.0002%

过去三个月	0.5370%	0.0003%	0.0873%	0.0000%	0.4497%	0.0003%
过去六个月	1.0671%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	0.8935%	0.0006%
过去一年	1.9405%	0.0009%	0.3500%	0.0000%	1.5905%	0.0009%
过去三年	6.3234%	0.0009%	1.0500%	0.0000%	5.2734%	0.0009%
自基金合同生效起至今	20.4747%	0.0031%	2.4260%	0.0000%	18.0487%	0.0031%

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





§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

华润元大基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2012】1746 号文批准，于 2013 年 1 月 17 日完成工商登记注册，总部位于深圳，注册资本 6 亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司、华润金控投资有限公司、台湾元大证券投资信托股份有限公司共同发起设立，占股比例分别为 51%、24.5%、24.5%。

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理十七只基金产品：华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金、华润元大量化优选混合型证券投资基金、华润元大欣享混合型发起式证券投资基金、华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金、华润元大核心动力混合型证券投资基金、华润元大现金收益货币市场基金、华润元大现金通货币市场基金、华润元大稳健收益债券型证券投资基金、华润元大润鑫债券型证券投资基金、华润元大润泽债券型证券投资基金、华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金、华润元大润丰纯债债券型证券投资基金、华润元大润享三个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大臻选回报混合型证券投资基金。

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		
金 兴健	本基金的基金经理	2021 年 4 月 9 日	-	13 年	曾任宝钢集团财务公司资金运用部投资经理、部门经理；华安基金管理有限公司财富管理部投资经理；华安未来资产管理有限公司业务发展部高级项目经理。2017 年加入华润元大基金管理有限公司，现担任华润元大基金管理有限公司投研负责人。目前担任华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大润鑫债券型证券投资基金、华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金、华润元大润泽债券型证券投资基金、华润元大稳健收益债券型证券投资基金、华润元大现金收益货币市场基金、华润元大现金通货币市场基金、华润元大润丰纯债债券型证券投资基金基金经理。
尹 华龙	本基金的基金经理	2022 年 7 月 20 日	-	11 年	历任信达澳银基金管理有限公司、华润元大基金管理有限公司债券高级研究员、基金经理。2022 年加入华润元大基金管理有限公司，现担任固定收益部董事总经理、基金经理。目前担任华润元大润泽债券型证券投资基金、华润元大润鑫债券型证券投资基金、华润元大现金收益货币市场基金、华润元大现金通货币市场基金、华润元大润丰纯债债券型证券投资基金、华润元大润享三个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无上述兼任情况。

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，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规及公司内部制度关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，未发生违反公平交易制度的

行为。

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。基金管理人管理的所有投资组合未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

2023 年上半年宏观经济基本面呈现出前强后弱的走势，具体表现为一季度宏观经济依然受益于疫情防控政策的优化，呈现出温和复苏的态势。以制造业 PMI 为例，一季度连续三月该指标均位于荣枯线上方。从金融数据来看，一季度新增社融合计达 14.54 万亿，表现强劲，超出市场预期。而进入二季度，宏观经济指标出现明显回落，PMI 跌落至荣枯线下方，新增社融也大幅收缩至 7.00 万亿，不及一季度一半。

与宏观经济的走势相似，货币市场在一季度和二季度表现迥异。一季度，由于商业银行信贷投放力度较大，银行间流动性供给紧张，银行间资金面呈现出均衡偏紧的态势，银行间 7 天质押式回购加权平均利率的中枢基本维持在 2.2%上方，显著高于 OMO 7 天逆回购利率，在 2 月份该中枢甚至达到 2.4%附近。在较为紧张的流动性和银行因大量信贷投放导致负债压力较大等因素的共同作用下，货币市场长端和短端收益率在一季度持续上行。以股份制银行同业存单一级发行为例，3M 和 1Y 存单一级发行利率分别自 1 月初的 2.15%和 2.3%附近上行至 3 月中旬的 2.5%和 2.8%附近。进入二季度，商业银行信贷投放力度大幅减弱，主动负债意愿亦大幅下降，其结果是银行间流动性大幅转松，货币市场长短端收益率均显著下行，股份行同业存单 3M 和 1Y 存单一级发行利率在二季度均大幅下行约 50bp。

上半年，本基金对货币市场走势的研判较为准确，在货币市场收益率较高的一季度，采取了拉长久期和适度利用杠杆的操作，有序进行配置。而在收益率较低的二季度，采取了防御性的策略，主动缩短久期，等待机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期华润元大现金通货币 A 的基金份额净值收益率为 0.9970%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%，本报告期华润元大现金通货币 B 的基金份额净值收益率为 1.0671%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年下半年，宏观经济形势复杂，有利因素和不利因素同时存在。一方面，经济总需求不足，拉动经济增长的几大动力均不同程度承压。较高的城镇化率和较高的居民杠杆率水平均预示

着房地产市场已进入新的阶段，恐难再担起中国经济增长火车头的重任。海外经济走弱，出口增速持续下滑，短期恐难见趋势逆转。居民收入增长趋缓，消费亦面临较大压力。总体来说，旧的增长动能对经济的拉动作用逐渐减弱，新的动能尚不足以完全取代旧动能的地位。另一方面，7 月 24 日中央政治局会议对下半年的经济工作布置中，展现出较强的稳增长意愿，未来可能有多种提振总需求的政策出台。且全球库存周期或已见底，PPI 和大宗商品价格已显现出见底回升的迹象，新一轮的全球库存周期或将开启，中国经济亦将在全球共振中受益。

货币市场方面，稳增长政策需要货币政策的配合，所以下半年大部分时间流动性大概率将保持宽松。但不排除经济形势好转导致长短端收益率已经货币市场流动性收紧的可能性发生。从历史上同业存单收益率的走势来看，下半年是同业存单收益率调整高发的时间段，而同业存单的收益率调整可能带动其他货币市场资产的收益率调整，继而引发银行理财和公募基金及其他资管产品的赎回，形成的负反馈可能自我加强从而引发市场的剧烈波动。另外四季度商业银行往往存在从非银机构回笼流动性的行为，该类机构行为可能引发银行间流动性的系统性收紧。以上是 2023 年下半年存在的较为重要的风险点。

下半年本基金的主要策略在防守中等待机会，在市场利率处于低位时，将配置集中于短久期资产，如果市场发生调整，在市场利率调整到较高位置时，加大长久期资产的配置，并适当运用杠杆，增厚收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、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。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的约定，本基金根据每日基金收益情况，以基金每万份已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。本基金每日进行收益计算并分配时，

每日收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益。本报告期内，本基金 A 类份额已实现收益为 556,201.57 元，每日分配，每日支付，合计分配 556,201.57 元，B 类份额已实现收益为 37,345,102.00 元，每日分配，每日支付，合计分配 37,345,102.00 元，符合本基金基金合同的约定。

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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华润元大现金通货币市场基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	624,974,834.99	367,259,011.12
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	2,723,799,529.60	2,570,527,468.23
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,723,799,529.60	2,570,527,468.23
资产支持证券投资		-	-
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	1,838,949,255.16	790,415,039.75
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		600,050,000.10	18,000.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		5,787,773,619.85	3,728,219,519.25
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2023 年 6 月 30 日**	**上年度末 2022 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	1,000,092.52
应付管理人报酬		708,953.81	723,797.97
应付托管费		148,108.84	144,759.61
应付销售服务费		36,625.45	34,905.30
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,051.53	18,963.69
应付利润		380,471.40	491,955.85
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	239,748.76	348,743.96
负债合计		1,520,959.79	2,763,218.90
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	5,786,252,660.06	3,725,456,300.35
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	-	-
净资产合计		5,786,252,660.06	3,725,456,300.35

负债和净资产总计		5,787,773,619.85	3,728,219,519.25

注： 报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 5,786,252,660.06 份，其中华润元大现金通货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 59,967,535.77 份；华润元大现金通货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 5,726,285,124.29 份。

6.2 利润表

会计主体：华润元大现金通货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		44,163,511.03	43,206,345.83
1.利息收入		17,557,312.15	15,609,734.92
其中：存款利息收入	6.4.7.10	6,571,715.69	5,147,254.91
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		10,985,596.46	10,462,480.01
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		26,606,198.88	27,596,610.91
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	26,606,198.88	27,596,610.91
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
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）	6.4.7.17	-	-
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、营业总支出		6,262,207.46	5,981,856.69
1．管理人报酬		4,387,119.85	4,467,194.67
2．托管费		883,741.95	893,439.02
3．销售服务费		215,616.08	232,245.67
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		644,597.97	255,536.30
其中：卖出回购金融资产支出		644,597.97	255,536.30
6．信用减值损失		-	-
7．税金及附加		8,264.76	10,702.68
8．其他费用	6.4.7.20	122,866.85	122,738.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		37,901,303.57	37,224,489.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		37,901,303.57	37,224,489.14
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		37,901,303.57	37,224,489.14

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华润元大现金通货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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）	3,725,456,300.35	-	-	3,725,456,300.35
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）	3,725,456,300.35	-	-	3,725,456,300.35
三、本期	2,060,796,359.71	-	-	2,060,796,359.71

增减变动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	37,901,303.57	37,901,303.57
（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）	2,060,796,359.71	-	-	2,060,796,359.71
其中：1.基金申购款	9,445,120,445.07	-	-	9,445,120,445.07
2.基金赎回款	-7,384,324,085.36	-	-	-7,384,324,085.36
（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）	-	-	-37,901,303.57	-37,901,303.57
（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）	5,786,252,660.06	-	-	5,786,252,660.06
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 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	5,111,910,974.44	-	-	5,111,910,974.44

产（基金净值）				
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）	5,111,910,974.44	-	-	5,111,910,974.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	232,406,753.79	-	-	232,406,753.79
（一）、综合收益总额	-	-	37,224,489.14	37,224,489.14
（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）	232,406,753.79	-	-	232,406,753.79
其中：1.基金申购款	8,241,310,582.49	-	-	8,241,310,582.49
2.基金赎回款	-8,008,903,828.70	-	-	-8,008,903,828.70
（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）	-	-	-37,224,489.14	-37,224,489.14

（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）	5,344,317,728.23	-	-	5,344,317,728.23

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：

江先达	张彦军	张彦军
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

华润元大现金通货币市场基金（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[2016]1129 号文《关于准予华润元大现金通货币市场基金注册的批复》核准，由华润元大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《华润元大现金通货币市场基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2016 年 7 月 11 日至 2016 年 7 月 21 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 213,576,301.00 元，经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2016）验字第 61032987_H09 号验资报告。经向中国证监会备案，《华润元大现金通货币市场基金基金合同》于 2016 年 7 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 213,607,728.64 份基金份额，其中认购资金利息折合 31,427.64 份基金份额。

本基金的基金管理人为华润元大基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大现金通货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围为：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（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；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为：按税后计算的中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率（税后），即活期存款基准利率×（1-利息税税率）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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 6 月 30 日
活期存款	1,441,987.78
等于：本金	1,441,810.47
加：应计利息	177.31
减：坏账准备	-
定期存款	623,532,847.21
等于：本金	620,000,000.00
加：应计利息	3,532,847.21
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	180,753,263.47
存款期限 3 个月以上	442,779,583.74
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	624,974,834.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 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	10,010,225.49	9,995,904.11	-14,321.38	-0.0002
	银行间市场	2,713,789,304.11	2,715,227,378.79	1,438,074.68	0.0249
	合计	2,723,799,529.60	2,725,223,282.90	1,423,753.30	0.0246
资产支持证券		-	-	-	-
合计		2,723,799,529.60	2,725,223,282.90	1,423,753.30	0.0246

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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 6 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	1,838,949,255.16	-
合计	1,838,949,255.16	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

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 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	-
应付交易费用	76,610.41
其中：交易所市场	2,000.00
银行间市场	74,610.41
应付利息	-
预提审计费	44,630.98
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	9,000.00
其他	50,000.00
合计	239,748.76

注：其他为本基金收到的基金管理人以固有资金为本基金垫付资金余额人民币 50,000.00 元。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华润元大现金通货币 A

项目	本期

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	50,104,506.52	50,104,506.52
本期申购	76,353,683.26	76,353,683.26
本期赎回（以“-”号填列）	-66,490,654.01	-66,490,654.01
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	59,967,535.77	59,967,535.77

华润元大现金通货币 B

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,675,351,793.83	3,675,351,793.83
本期申购	9,368,766,761.81	9,368,766,761.81
本期赎回（以“-”号填列）	-7,317,833,431.35	-7,317,833,431.35
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	5,726,285,124.29	5,726,285,124.29

注：申购含红利再投、转换入和因升降级等导致的强制调增份额/金额，赎回含转换出和因升降级等导致的强制调减份额/金额。

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

华润元大现金通货币 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	556,201.57	-	556,201.57
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	-556,201.57	-	-556,201.57
本期末	-	-	-

华润元大现金通货币 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	37,345,102.00	-	37,345,102.00
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	-37,345,102.00	-	-37,345,102.00
本期末	-	-	-

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,847.45
定期存款利息收入	6,568,868.24
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	6,571,715.69

6.4.7.11 股票投资收益

不适用。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	26,391,412.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	214,786.59
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	26,606,198.88

6.4.7.12.2 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1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,219,287,850.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,209,126,583.46
减：应计利息总额	9,946,480.54

减：交易费用	-
买卖债券差价收入	214,786.59

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

不适用。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

不适用。

6.4.7.16 股利收益

不适用。

6.4.7.17 公允价值变动收益

不适用。

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	17,880.00
其他	848.50
合计	122,866.85

注：其他分别为上清所查询费 600 元，银行间回购交易费 248.50 元。

6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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，本基金无需作说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需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

本基金本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
华润元大基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	基金托管人、基金销售机构
华润深国投信托有限公司	基金管理人的股东
元大证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
华润金控投资有限公司	基金管理人的股东

深圳华润元大资产管理有限公司	基金管理人的子公司
珠海华润银行股份有限公司(“珠海华润银行”)	与基金管理人受同一实际控制的公司、基金销售机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人控股股东的联营公司、基金销售机构

注：以下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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,387,119.85	4,467,194.67
其中：支付销售机构的客户维护费	463,617.63	293,275.89

注：(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

(2)根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，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，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	883,741.95	893,439.02

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05%的年费率计提，按月支付。日托管费=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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华润元大现金通货币 A	华润元大现金通货币 B	合计
华润元大基金管理有限公司	5,741.49	114,564.44	120,305.93
平安银行	10.61	11,963.32	11,973.93
国信证券	47.43	49.32	96.75
珠海华润银行	18,360.75	-	18,360.75
合计	24,160.28	126,577.08	150,737.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华润元大现金通货币 A	华润元大现金通货币 B	合计
华润元大基金管理有限公司	8,215.14	138,163.17	146,378.31
平安银行	8.94	11,292.44	11,301.38
珠海华润银行	25,238.13	-	25,238.13
合计	33,462.21	149,455.61	182,917.82

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日对应级别基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华润元大基金管理有限公司，再由华润元大基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 级基金份额和 B 级基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.15%和 0.01%。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日该级别基金资产净值×对应销售服务费年费率/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

单位：人民币元

本期

2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
平安银行	160,216,241.33	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
平安银行	130,276,615.35	-	-	-	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	华润元大现金通货币 A	华润元大现金通货币 B
基金合同生效日（ 2016 年 7 月 27 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2,524.37	50,241,448.87
报告期间申购/买入总份额	25.55	2,528,676.17
报告期间因拆分变动份额	-	-590.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	3,000,000.00
报告期末持有的基金份额	2,549.92	49,769,535.04
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.8601%
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	华润元大现金通货币 A	华润元大现金通货币 B
基金合同生效日（ 2016 年 7 月 27 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2,480.49	16,643,079.58
报告期间申购/买入总份额	24.04	95,865,452.54
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总	-	62,700,000.00

份额		
报告期末持有的基金份额	2,504.53	49,808,532.12
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.9320%

注：1、关联方投资本基金适用基金合同的约定费率。

2、期间申购/买入含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出含转换出份额。

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

华润元大现金通货币 B

关联方名称	本期末 2023 年 6 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（%）
华润深国投信托有限公司	-	-	50,343,847.64	1.3698
平安银行	-	-	712,246,375.12	19.3790
深圳华润元大资产管理有限公司	8,178,911.66	0.1428	9,581,052.92	0.2607
珠海华润银行	203,888,958.26	3.5606	201,723,022.60	5.4885

注：（1）关联方投资本基金适用基金合同的约定费率。

（2）对于分级基金，比例的分母采用各分级基金的总份额。

（3）于本期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金 B 类基金份额外的其他基金份额。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
平安银行	1,441,987.78	2,847.45	1,593,794.83	2,776.63

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行间同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

截至本报告期末，本基金因投资托管人发行的同业存单而取得的利息收入为人民币 244,859.82 元（于 2022 年度，本基金因投资托管人发行的同业存单而取得的利息收入为人民币 1,150,613.95 元）。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

华润元大现金通货币 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
558,741.58	-	-2,540.01	556,201.57	-
华润元大现金通货币 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
37,454,046.44	-	-108,944.44	37,345,102.00	-

6.4.12 期末（2023 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

本基金于本期末无因认购新发/增发证券而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

不适用。

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

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场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由涉及金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事会、董事会下设风险控制委员会，督察长、管理层下设风险管理委员会，合规管理部、风险管理部和各业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行平安银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不超过该证券市值的 10%。截至 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（含同业存单）占基金资产净值的比例分别为 41.78%（上年度末：62.98%）。

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 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	10,010,225.49	-
A-1 以下	-	-
未评级	264,394,568.36	556,217,696.20
合计	274,404,793.85	556,217,696.20

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

（2）未评级债券包括债券期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据和部分短期融资券等。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金与本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	2,243,772,771.47	1,983,320,984.42
合计	2,243,772,771.47	1,983,320,984.42

注：同业存单投资评级取自第三方评级机构的债项评级。

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 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	205,621,964.28	30,988,787.61
合计	205,621,964.28	30,988,787.61

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

（2）未评级债券包括债券期限大于一年的国债、政策性金融债和央行票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值、份额持有人集中度以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，均在证券

交易所或银行间同业市场交易，因此，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），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资产的公允价值。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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现金流量因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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	624,974,834.99	-	-	-	-	624,974,834.99
结算备付金	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	2,539,948,742.50	183,850,787.10	-	-	-	2,723,799,529.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,838,949,255.16	-	-	-	-	1,838,949,255.16
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	600,050,000.10	600,050,000.10
应收清算款	-	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,003,872,832.65	183,850,787.10	-	-	600,050,000.10	5,787,773,619.85
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	708,953.81	708,953.81
应付托管费	-	-	-	-	148,108.84	148,108.84
应付清算款	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	36,625.45	36,625.45
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	380,471.40	380,471.40
应交税费	-	-	-	-	7,051.53	7,051.53
其他负债	-	-	-	-	239,748.76	239,748.76
负债总计	-	-	-	-	1,520,959.79	1,520,959.79
利率敏感度缺口	5,003,872,832.65	183,850,787.10	-	-	598,529,040.31	5,786,252,660.06
上年度末 2022 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	367,259,011.12	-	-	-	-	367,259,011.12
结算备付金	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	2,479,248,121.53	91,279,346.70	-	-	-	2,570,527,468.23
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	790,415,039.75	-	-	-	-	790,415,039.75
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	18,000.15	18,000.15
应收清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,636,922,172.40	91,279,346.70	-	-	18,000.15	3,728,219,519.25
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	1,000,092.52	1,000,092.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	723,797.97	723,797.97
应付托管费	-	-	-	-	144,759.61	144,759.61
应付清算款	-	-	-	-	-	-

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	34,905.30	34,905.30
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	491,955.85	491,955.85
应交税费	-	-	-	-	18,963.69	18,963.69
其他负债	-	-	-	-	348,743.96	348,743.96
负债总计	-	-	-	-	2,763,218.90	2,763,218.90
利率敏感度缺口	3,636,922,172.40	91,279,346.70	-	-	-2,745,218.75	3,725,456,300.35

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

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		
	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 6 月 30 日）	上年度末 （2022 年 12 月 31 日 ）
分析	市场利率减少 25 个基准点	952,479.81	989,414.90
	市场利率增加 25 个基准点	-951,071.47	-988,718.89

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，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，以摊余成本法进行计价，无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022年12月31日

	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	2,723,799,529.60	47.07	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,723,799,529.60	47.07	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，以摊余成本法进行计价，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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	2,723,799,529.60	2,570,527,468.23
第三层次	-	-
合计	2,723,799,529.60	2,570,527,468.23

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 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	2,723,799,529.60	47.06
	其中：债券	2,723,799,529.60	47.06
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,838,949,255.16	31.77
	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	624,974,834.99	10.80
4	其他各项资产	600,050,000.10	10.37
5	合计	5,787,773,619.85	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	1.99	
	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

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	41
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	41

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金未发生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	54.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	13.62	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	8.96	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.15	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	7.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		89.44	-

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

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	306,547,855.02	5.30
	其中：政策	306,547,855.02	5.30

	性金融债		
4	企业债券	10,010,225.49	0.17
5	企业短期融资券	163,468,677.62	2.83
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,243,772,771.47	38.78
8	其他	-	-
9	合计	2,723,799,529.60	47.07
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）	按实际利率计算的账面价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112319127	23 恒丰银行 CD127	1,300,000	129,876,964.45	2.24
2	112319124	23 恒丰银行 CD124	1,000,000	99,921,988.25	1.73
3	112315171	23 民生银行 CD171	1,000,000	99,905,539.42	1.73
4	112381366	23 苏州银行 CD134	1,000,000	99,891,159.03	1.73
5	112381390	23 广州农村商业银行 CD076	1,000,000	99,888,560.71	1.73
6	112319141	23 恒丰银行 CD141	1,000,000	99,859,595.53	1.73
7	112303078	23 农业银行 CD078	1,000,000	99,747,683.12	1.72
8	112398496	23 广州农村商业银行 CD059	1,000,000	99,743,180.09	1.72
9	200313	20 进出 13	800,000	82,381,256.49	1.42
10	210202	21 国开 02	700,000	71,307,302.06	1.23

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	0.0477%

报告期内偏离度的最低值	-0.0452%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0282%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现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

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按实际利率计算的账面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

本基金所持有的债券采用摊余成本法进行估值，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或折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在 1.00 元。

7.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

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	600,050,000.10
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	600,050,000.10

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，投资组合报告中数字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（%）
华润元大现金通货币 A	18,331	3,271.37	27,898,603.45	46.52	32,068,932.32	53.48
华润元大现金通货币 B	67	85,466,942.15	5,726,285,124.29	100.00	0.00	0.00
合计	18,398	314,504.44	5,754,183,727.74	99.45	32,068,932.32	0.55

注：分级基金机构/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	其他类机构	500,393,286.96	8.65
2	银行类机构	304,581,771.74	5.26
3	其他类机构	300,037,931.34	5.19
4	银行类机构	300,019,193.36	5.19
5	银行类机构	300,000,000.00	5.18
6	银行类机构	300,000,000.00	5.18
7	银行类机构	208,539,678.17	3.60
8	银行类机构	203,888,958.26	3.52
9	券商类机构	202,463,069.89	3.50
10	保险类机构	202,326,455.13	3.50

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	华润元大现金通货币 A	4,567.54	0.0076
	华润元大现金通货币 B	0.00	0.0000
	合计	4,567.54	0.0001

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会

规定及相关管理制度的规定。

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	华润元大现金通货币 A	0~10
	华润元大现金通货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华润元大现金通货币 A	0~10
	华润元大现金通货币 B	0
	合计	0~10

注：1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

2、本期末本基金的基金经理持有本基金的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

3、截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华润元大现金通货币 A	华润元大现金通货币 B
基金合同生效日（2016 年 7 月 27 日）基金份额总额	83,590,178.64	130,017,550.00
本报告期期初基金份额总额	50,104,506.52	3,675,351,793.83
本报告期基金总申购份额	76,353,683.26	9,368,766,761.81
减：本报告期基金总赎回份额	66,490,654.01	7,317,833,431.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	59,967,535.77	5,726,285,124.29

注：本基金总申购份额含红利再投、转换入份额和因份额升降级等导致的强制调增份额，总赎回份额含转换出份额和因份额升降级等导致的强制调减份额。

§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

本报告期内，本基金管理人发生重大人事变动如下：2023 年 1 月 19 日，华润元大基金管理有限公司召开 2023 年第一次临时股东会，改选吴宏烨女士为华润元大基金管理有限公司董事，陈矛女士不再担任公司董事。上述变更已按照规定报相关监管机构备案，并进行公告。

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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

本基金管理人聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计的会计师事务所。本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

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

管理人及其高级管理人员本报告期内未发生受稽查或处罚等情况。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	元数量	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(%)	
中金财富	2	-	-	2,000.00	100.00	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

（1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；

（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（3）经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；

（4）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；

（5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

（6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司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，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。本基金本报告期内租用的基金专用交易单元未发生变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中金财富	10,000,000.00	100.00	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过 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	关于华润元大基金管理有限公司董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 12 日
2	华润元大现金通货币市场基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 18 日
3	华润元大基金管理有限公司 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
4	华润元大现金通货币市场基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
5	华润元大现金通货币市场基金恢复大额申购、大额转换转入、定期定额投资公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 6 日
6	关于警惕冒用华润元大基金管理有限公司名义进行诈骗活动的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 24 日
7	华润元大基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 31 日
8	华润元大现金通货币市场基金 2022 年年度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 31 日
9	华润元大现金通货币市场基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 4 日
10	华润元大基金管理有限公司关于官方微信公众号交易平台上线公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 14 日
11	华润元大基金管理有限公司 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2023 年 4 月 21 日

		站	
12	华润元大现金通货币市场基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 21 日
13	华润元大基金管理有限公司关于旗下产品参与公司网上直销平台费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 4 日
14	华润元大基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 26 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

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、中国证监会关于核准本基金募集的批复；

2、本基金基金合同；

3、本基金托管协议；

4、本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日