

海富通货币市场证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

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。

基金托管人中国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.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
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
5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	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
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 债券回购融资情况.....	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	38
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.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	40
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.....	40
报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明.....	41

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明.....	41
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	41
7.9 投资组合报告附注.....	41
8 基金份额持有人信息.....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
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的情况	44
9 开放式基金份额变动.....	44
10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	46
11 影响投资者决策的其他重要信息	47
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
12 备查文件目录.....	48
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	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	海富通货币市场证券投资基金			
基金简称	海富通货币			
基金主代码	519505			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2005 年 1 月 4 日			
基金管理人	海富通基金管理有限公司			
基金托管人	中国银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	11,873,315,856.46 份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	海富通货币 A	海富通货币 B	海富通货币 C	海富通货币 D
下属分级基金的交易代码	519505	519506	017898	017899
报告期末下属分级基金的份额总额	7,771,551,7 47.50 份	1,866,258,7 90.34 份	-份	2,235,505,3 18.62 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力争本金安全和资产充分流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的收益。
投资策略	根据宏观经济指标（主要包括：利率水平、通货膨胀率、GDP 增长率、货币供应量、就业率水平、国际市场利率水平、汇率），决定债券组合的剩余期限（长/中/短）和比例分布。根据各类资产的流动性特征（主要包括：平均日交易量、交易场所、机构投资者持有情况、回购抵押数量、分拆转换进程），决定组合中各类资产的投资比例。根据债券的信用等级及担保状况，决定组合的风险级别。
业绩比较基准	税后一年期银行定期存款利率
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、流动性强的证券投资基金品种。

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		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66596688
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com

客户服务电话	40088-40099	95566
传真	021-33830166	010-66594942
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	杨仓兵	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司/ 海富通基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号/中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

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 日至 2023 年 6 月 30 日）			
	海富通货币 A	海富通货币 B	海富通货币 C	海富通货币 D
本期已实现收益	45,622,244.66	30,379,564.86	-	9,009,590.58
本期利润	45,622,244.66	30,379,564.86	-	9,009,590.58
本期净值收益率	0.9061%	1.0251%	-	0.5324%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)			
	海富通货币 A	海富通货币 B	海富通货币 C	海富通货币 D
期末基金资产净值	7,771,551,747.5	1,866,258,790.3	-	2,235,505,318.6

	0	4		2
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	-	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)			
	海富通货币 A	海富通货币 B	海富通货币 C	海富通货币 D
累计净值收益率	69.9025%	70.7836%	-	0.5324%

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、本基金收益分配自 2019 年 5 月 21 日起从按月结转份额改为按日结转份额。

4、自 2023 年 3 月 24 日起，海富通货币市场证券投资基金增设 C 级和 D 级基金份额。增加上述份额后，本基金将分设海富通货币 A、海富通货币 B、海富通货币 C、海富通货币 D 基金份额，适用不同的销售服务费率。

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

海富通货币 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	0.1560%	0.0028%	0.1224%	0.0000%	0.0336%	0.0028%
过去三个月	0.4671%	0.0024%	0.3719%	0.0000%	0.0952%	0.0024%
过去六个月	0.9061%	0.0024%	0.7410%	0.0000%	0.1651%	0.0024%
过去一年	1.5501%	0.0022%	1.5000%	0.0000%	0.0501%	0.0022%
过去三年	5.2879%	0.0014%	4.5678%	0.0000%	0.7201%	0.0014%
自基金合同生效起至今	69.9025%	0.0057%	49.4056%	0.0021%	20.4969%	0.0036%

海富通货币 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	0.1755%	0.0028%	0.1224%	0.0000%	0.0531%	0.0028%
过去三个月	0.5268%	0.0024%	0.3719%	0.0000%	0.1549%	0.0024%
过去六个月	1.0251%	0.0024%	0.7410%	0.0000%	0.2841%	0.0024%
过去一年	1.7925%	0.0022%	1.5000%	0.0000%	0.2925%	0.0022%
过去三年	6.0467%	0.0014%	4.5678%	0.0000%	1.4789%	0.0014%

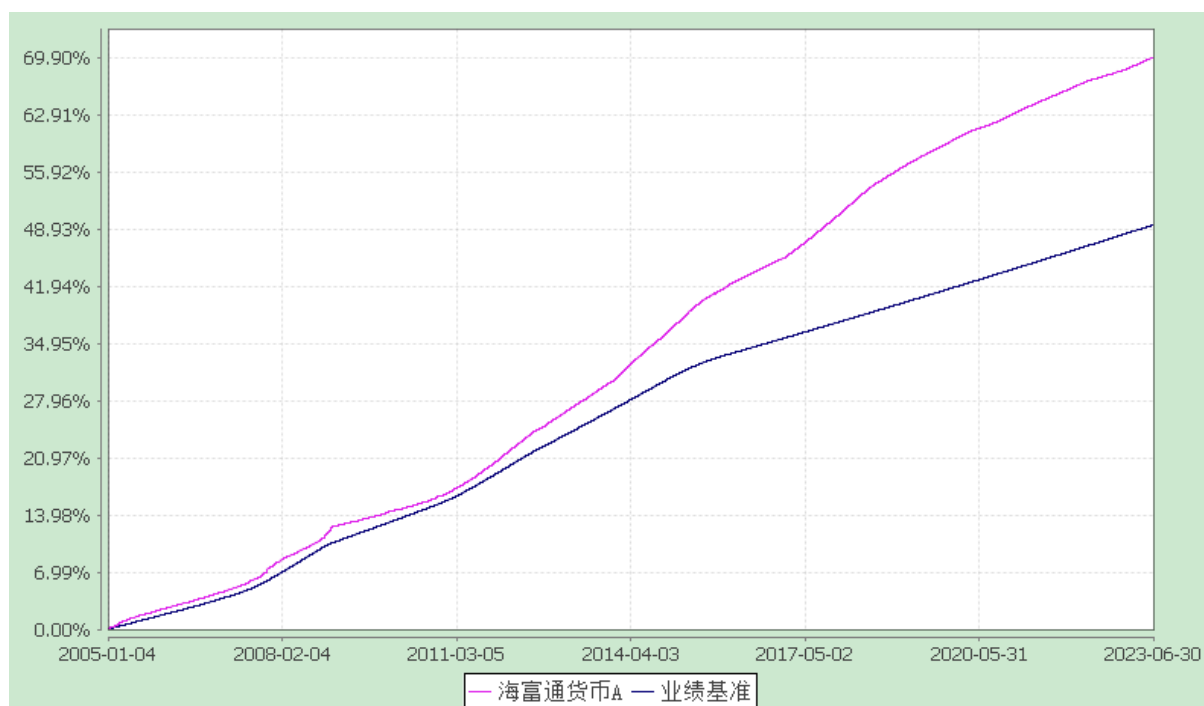
自基金合同生效起至今	70.7836%	0.0057%	45.2723%	0.0022%	25.5113%	0.0035%
------------	----------	---------	----------	---------	----------	---------

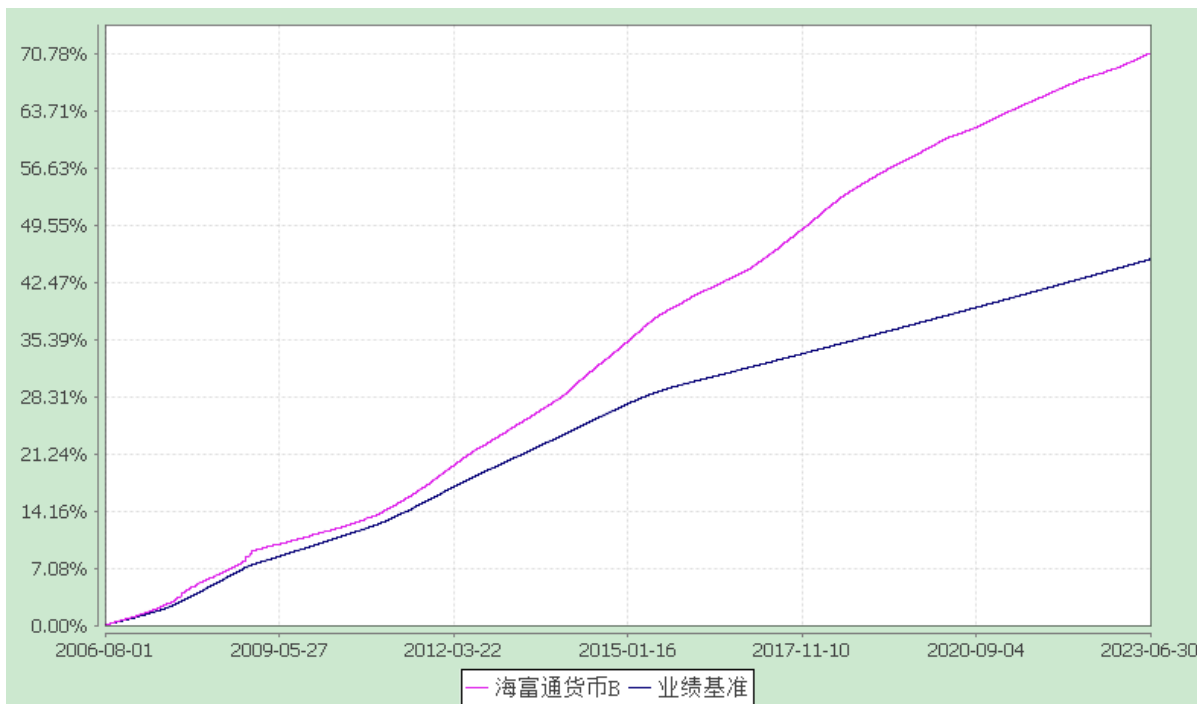
海富通货币 D

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	0.1755%	0.0028%	0.1224%	0.0000%	0.0531%	0.0028%
过去三个月	0.5269%	0.0024%	0.3719%	0.0000%	0.1550%	0.0024%
自基金合同生效起至今	0.5324%	0.0025%	0.3842%	0.0000%	0.1482%	0.0025%

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

海富通货币市场证券投资基金
 份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2005 年 1 月 4 日至 2023 年 6 月 30 日)

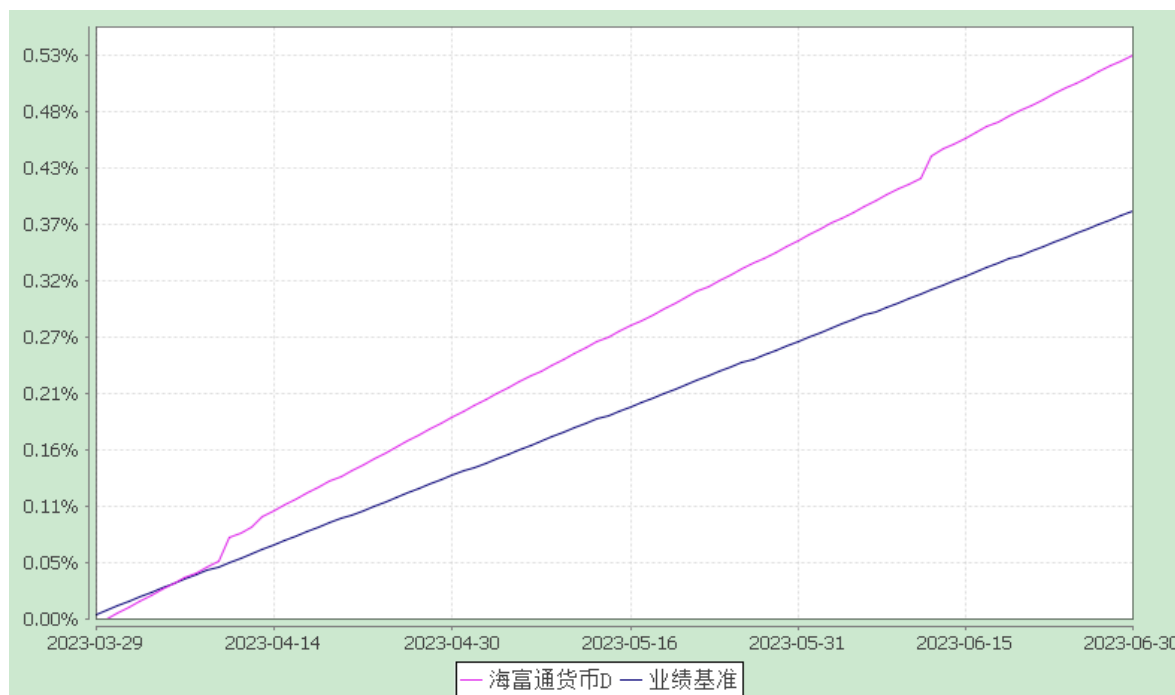
海富通货币 A**海富通货币 B**



海富通货币 C



海富通货币 D



注：1、本基金合同于 2005 年 1 月 4 日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 3 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十五条（二）投资范围、（六）投资限制中规定的各项比例。

2、自 2023 年 3 月 24 日（新增 C 级份额起始日）起至本报告期末，本基金 C 级份额未存在实际确认份额，因此无收益数据。

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

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 90 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通

大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、

海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通欣润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		
谈云飞	本基金的基金经理	2016-02-26	-	18 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 4 月至 2014 年 6 月就职于华宝兴业基金管理有限公司，曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2014 年 7 月至 2015 年 10 月任海富通现金管理货币基金经理。2014 年 9 月至 2020 年 9 月任海富通季季增利理财债券基金经理。2015 年 1 月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015 年 4 月至 2020 年 1 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 2 月起兼任海富通货币基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 6 月兼任海富通纯债债券、海富通双福债券（原海富通双福分级债券）、海富通双利债券基金经理。2016 年 4 月至 2020 年 1 月兼任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通聚利债券基金经理。2016 年 9 月至 2020 年 1 月兼任海富通欣荣混合基金经理。2016 年 9 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合基金经理。2017 年 2 月至 2021 年 10 月兼任海富通强化回报混合基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 7 月至 2020 年 9 月任海富通季季通利理财债券基金经理。2019 年 9 月至 2023 年 1 月兼任海富通中短债债券基金经理。2021 年 2 月起兼任海富通惠睿精选混合基金经理。2022 年 3 月起兼任海富通欣润混合基金经理。2022 年 3 月至 2023 年 5 月兼任海富通惠鑫混合基金经理。2022 年 5 月起兼任海富通恒益一年定开债券发起式基金经理。
陶斐然	本基金的基金经理助理	2020-06-24	2023-06-02	8 年	金融学硕士，持有基金从业人员资格证书。2014 年 12 月加入海富通基金管理有限公司，历任助理交易员、交易员、高级交易员。2020 年 6 月至 2023 年 6 月任债券基金部基金经理助理。2023 年 6 月

					起任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF、海富通上证投资级可转债 ETF、海富通中证短融 ETF、海富通上证 10 年期地方政府债 ETF、海富通上证城投债 ETF 基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生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

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

上半年经济由一季度脉冲式修复，再到二季度修复速度有所放缓。整体来看对经济拉动的点在于服务业与消费，房地产与出口偏弱。从 PMI 来看，2 月与 3 月 PMI 大超预期，但随后 4-6 月 PMI

重回收缩区间。投资方面，制造业投资维持韧性，高技术行业贡献突出；基建投资由于基数问题增速略有回落；地产投资受到保交楼政策的支持仅在竣工端方面明显改善。消费方面受益于消费场景的改善与小长假效应延续修复趋势。出口方面受到海外需求不足的影响下行压力不减，但结构上新能源相关板块有一些亮点。通胀方面，CPI 总体维持弱势，主要由于工业消费品价格偏弱；PPI 受到基数与国内外需求共振走弱的影响同比跌幅走扩。在此经济环境下，上半年货币政策维持宽松，年初降准 25bp 释放中长期流动性约 5000 亿，MLF 超量续作，6 月调降 OMO 与 MLF 利率 10bp。财政政策总量较去年有所回落，但使用效率有所提升。资金价格与流动性方面，1 季度信贷天量投放，资金价格中枢普遍明显回升，3 月份的 3 个月 SHIBOR 利率到了去年四季度调整以来最高点 2.5%，1 年国股存单收益率也达到 2.75% 的高点；2 季度投放压力减弱，4-5 月资金价格中枢普遍回落，短端资产收益率大幅下行，3 个月的 SHIBOR 利率从 3 月份高点逐步降低到 2.10% 左右。6 月是传统信贷投放大月，抽水效应导致资金价格有所抬升，但总体仍在政策利率附近波动。

本基金在今年以来负债端有较大变动，期间有较高比例的个人客户申购，显著改善了负债结构。本基金自一季度起逐步拉长久期，配置了中长期的存款/存单，降低了逆回购的比例，提升了组合的整体静态收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通货币 A 类基金净值收益率为 0.9061%，同期业绩比较基准收益率为 0.7410%。海富通货币 B 类基金净值收益率为 1.0251%，同期业绩比较基准收益率为 0.7410%。海富通货币 D 类基金净值收益率为 0.5324%，同期业绩比较基准收益率为 0.3842%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，经济进入平台期，同比增速回落。本轮经济修复的特征在于服务业与消费驱动，地产与出口偏弱，总体弹性不高。具体来看，投资方面，基建在有增量政策的支持下仍保持较高的景气度；制造业投资在高技术领域持续发力，但总体增速或有所回落；地产投资可以预期政策端还有一定的调整。通胀方面，消费需求不足的情况短期较难逆转，CPI 有短期转负的风险，但随着基数走低下半年是温和回升的趋势；PPI 的需求端难有明显好转，同样由于基数走低通缩的情况会有所好转，但年内或难回正。财政方面政策性金融工具与特别国债可能发力。货币政策方面，流动性的合理充裕或维持，由于政策需要观察期，6 月降息后再次在 3 季度降息的概率偏低，但通过降准补充基础货币消耗的可能性较大，预计短端资产收益率短期将维持低位。

下半年，本基金在资产端管理中将在保持基金流动性和安全性的基础上，积极操作，争取提高收益。持续严格控制信用风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、本基金本报告期内应分配：货币 A 级 45,622,244.66 元，货币 B 级 30,379,564.86 元，货币 D 级 9,009,590.58 元

二、已实施的利润分配：货币 A 级已分配 45,319,737.11 元，货币 B 级已分配 30,759,938.53，货币 D 级已分配 8,759,287.87 元。

三、应分配但尚未实施的利润：已分配但未支付的 747,102.88 元。应于收益支付日 2023 年 07 月 03 日按 1.000 元的份额面值结转为基金份额。

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

本基金本报告期无需要说明的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对海富通货币市场证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《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应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《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,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

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:海富通货币市场证券投资基金

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	5,950,167,485.26	2,620,600,424.49
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,074,826,454.25	1,230,127,385.99
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,074,826,454.25	1,230,127,385.99
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	3,458,766,563.08	1,179,009,297.69
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,020,318.04	420.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		12,484,780,820.63	5,029,737,528.17
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		605,057,009.39	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		973,202.63	1,066.64
应付管理人报酬		2,624,846.83	1,173,704.22
应付托管费		437,474.52	195,617.38
应付销售服务费		1,353,525.48	226,240.99
应付投资顾问费		-	-
应交税费		12,469.09	10,534.40
应付利润		747,102.88	574,666.29
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	259,333.35	276,657.14
负债合计		611,464,964.17	2,458,487.06
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	11,873,315,856.46	5,027,279,041.11
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		11,873,315,856.46	5,027,279,041.11
负债和净资产总计		12,484,780,820.63	5,029,737,528.17

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 11,873,315,856.46 份，其中 A 级基金份额 7,771,551,747.50 份，B 级基金份额 1,866,258,790.34 份，D 级基金份额 2,235,505,318.62 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通货币市场证券投资基金

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	上年度可比期间 2022年1月1日至
----	-----	------------------	-----------------------

		2023 年 6 月 30 日	2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		108,609,343.49	92,421,018.84
1.利息收入		76,897,542.94	73,826,868.74
其中：存款利息收入	6.4.7.9	48,148,312.29	47,170,893.49
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		28,749,230.65	26,655,975.25
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		31,711,800.55	18,594,150.10
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	31,711,800.55	18,594,150.10
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-	-
减：二、营业总支出		23,597,943.39	18,643,878.38
1. 管理人报酬		13,404,385.23	13,284,206.77
2. 托管费		2,234,064.28	4,025,517.19
3. 销售服务费		6,569,792.62	667,911.30
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,228,890.84	513,402.47
其中：卖出回购金融资产支出		1,228,890.84	513,402.47
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		2,063.26	3,169.94
8. 其他费用	6.4.7.14	158,747.16	149,670.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		85,011,400.10	73,777,140.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		85,011,400.10	73,777,140.46
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		85,011,400.10	73,777,140.46

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海富通货币市场证券投资基金

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）	5,027,279,041.11	-	-	5,027,279,041.11
二、本期期初净资产（基金净值）	5,027,279,041.11	-	-	5,027,279,041.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,846,036,815.35	-	-	6,846,036,815.35
（一）、综合收益总额	-	-	85,011,400.10	85,011,400.10
（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）	6,846,036,815.35	-	-	6,846,036,815.35
其中：1.基金申购款	41,418,833,598.80	-	-	41,418,833,598.80
2.基金赎回款	-34,572,796,783.45	-	-	-34,572,796,783.45
（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）	-	-	-85,011,400.10	-85,011,400.10
四、本期期末净资产（基金净值）	11,873,315,856.46	-	-	11,873,315,856.46
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、上期期末净资产（基金净值）	7,751,374,960.52	-	-	7,751,374,960.52
二、本期期初净资产（基金净值）	7,751,374,960.52	-	-	7,751,374,960.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-728,524,393.88	-	-	-728,524,393.88
（一）、综合收益	-	-	73,777,140.46	73,777,140.46

总额				
(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)	-728,524,393.88	-	-	-728,524,393.88
其中：1.基金申购款	26,824,128,561.61	-	-	26,824,128,561.61
2.基金赎回款	-27,552,652,955.49	-	-	-27,552,652,955.49
(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)	-	-	-73,777,140.46	-73,777,140.46
四、本期期末净资产(基金净值)	7,022,850,566.64	-	-	7,022,850,566.64

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：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：胡光涛，会计机构负责人：胡正万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通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”）证监基金字[2004]第 194 号《关于同意海富通货币市场证券投资基金设立的批复》核准，由海富通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《海富通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 964,227,474.56 元。经向中国证监会备案，《海富通货币市场证券投资基金基金合同》于 2005 年 1 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 964,512,079.20 份基金份额，其中认购资金利息折合 284,604.64 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《海富通货币市场证券投资基金基金合同》和《海富通货币市场证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，自 2006 年 8 月 1 日起，本基金分设两级基金份额：A 级基金份额和 B 级基金份额，适用不同的销售服务费率，并根据投资者基金交易账户所持有份额数量是否不低于 500 万份进行不同级别基金份额的判断和处理。

根据《海富通基金管理有限公司关于修改海富通货币市场证券投资基金基金合同的公告》，根据《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》、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》的有关规定及《海富通货币市场基金基金合同》和《海富通货币市场基金托管协议》的约定，经本基金的基金管理人与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并经中国证监会备案，自 2016 年 6 月 16 日起对本基金的基金合同进行修改。

根据《海富通基金管理有限公司关于海富通货币市场证券投资基金调整收益支付方式并修改基金合同的公告》的规定，本基金的基金管理人经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定自 2019 年 5 月 21 日起对本基金调整收益支付方式，并对本基金的基金合同作相应修改。

根据《关于海富通货币市场证券投资基金增加 C 级和 D 级基金份额并相应修改基金合同和托管协议的公告》，本基金自 2023 年 3 月 24 日起，在原有份额的基础上增设 C 级和 D 级基金份额，并相应修改基金合同、招募说明书等法律文件。增加上述份额后，本基金将分设海富通货币 A、海富通货币 B、海富通货币 C、海富通货币 D 基金份额，适用不同的销售服务费率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和修改后的《海富通货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于现金、期限 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；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税后一年期银行定期存款利率。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2023 年 8 月 30 日批准报出。

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基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况、2023 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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：

(a) 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。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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6月30日
活期存款	2,399,564.51
等于：本金	2,396,768.32
加：应计利息	2,796.19
定期存款	5,947,767,920.75

等于：本金	5,919,000,000.00
加：应计利息	28,767,920.75
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	100,145,833.25
存款期限 3 个月以上	5,847,622,087.50
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	5,950,167,485.26

注：定期存款的存款期限为定期存款的票面存期。

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	-	-	-	-
	银行间市场	3,074,826,454.25	3,075,400,03 0.68	573,576.43	0.0048
	合计	3,074,826,454.25	3,075,400,03 0.68	573,576.43	0.0048
资产支持证券		-	-	-	-
合计		3,074,826,454.25	3,075,400,03 0.68	573,576.43	0.0048

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 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	3,458,766,563.08	-
合计	3,458,766,563.08	-

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

本基金本报告期末其他资产无余额。

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	95.45
应付交易费用	157,702.05
其中：交易所市场	-
银行间市场	157,702.05
应付利息	-
预提费用	101,535.85
合计	259,333.35

6.4.7.7 实收基金

海富通货币 A

金额单位：人民币元

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	851,724,028.65	851,724,028.65
本期申购	29,061,966,303.65	29,061,966,303.65
本期赎回（以“-”号填列）	-22,142,138,584.80	-22,142,138,584.80
本期末	7,771,551,747.50	7,771,551,747.50

海富通货币 B

金额单位：人民币元

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	4,175,555,012.46	4,175,555,012.46
本期申购	6,892,765,852.85	6,892,765,852.85
本期赎回（以“-”号填列）	-9,202,062,074.97	-9,202,062,074.97
本期末	1,866,258,790.34	1,866,258,790.34

海富通货币 D

金额单位：人民币元

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
本期申购	5,464,101,442.30	5,464,101,442.30

本期赎回（以“-”号填列）	-3,228,596,123.68	-3,228,596,123.68
本期末	2,235,505,318.62	2,235,505,318.62

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

海富通货币 A

单位：人民币元

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	45,622,244.66	-	45,622,244.66
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	-45,622,244.66	-	-45,622,244.66
本期末	-	-	-

海富通货币 B

单位：人民币元

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	30,379,564.86	-	30,379,564.86
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	-30,379,564.86	-	-30,379,564.86
本期末	-	-	-

海富通货币 D

单位：人民币元

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	9,009,590.58	-	9,009,590.58
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	-9,009,590.58	-	-9,009,590.58
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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	52,743.21
定期存款利息收入	48,095,569.08
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	48,148,312.29

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

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1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	28,000,587.23
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,711,213.32
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	31,711,800.55

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	10,710,356,904.95
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,668,096,249.82
减：应计利息总额	38,549,391.81
减：交易费用	50.00
买卖债券差价收入	3,711,213.32

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未持有资产支持证券。

6.4.7.13 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.14 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	32,232.48
信息披露费	59,507.37
银行划款手续费	48,731.31
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	17,676.00
合计	158,747.16

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

截至本财务报表批准报出日，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
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、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通过关联方交易单元进行股票交易。

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通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 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无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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	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	13,404,385.23	13,284,206.77
其中：支付销售机构的客户维护费	4,752,951.16	1,024,421.35

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%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 x0.30%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	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	2,234,064.28	4,025,517.19

注：支付基金托管人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 x0.05%/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				
	海富通货币 A	海富通货币 B	海富通货币 C	海富通货币 D	合计
中国银行	29,640.98	272.59	-	-	29,913.57
海通证券	7,398.37	32,201.08	-	-	39,599.45
海富通基金	15,543.98	76,163.18	-	-	91,707.16
合计	52,583.33	108,636.85	-	-	161,220.18
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				
	海富通货币 A	海富通货币 B	海富通货币 C	海富通货币 D	合计
中国银行	24,431.17	518.24	-	-	24,949.41
海通证券	2,314.80	39,243.00	-	-	41,557.80
海富通基金	12,006.34	260,755.21	-	-	272,761.55
合计	38,752.31	300,516.45	-	-	339,268.76

注：支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

海富通货币 A 类基金日基金销售服务费=前一日 A 类份额对应的基金资产净值 x0.25%/ 当年天数。

海富通货币 B 类基金日基金销售服务费=前一日 B 类份额对应的基金资产净值 x0.01%/ 当年天数。

海富通货币 C 类基金日基金销售服务费=前一日 C 类份额对应的基金资产净值 x0.25%/ 当年天数。

海富通货币 D 类基金日基金销售服务费=前一日 D 类份额对应的基金资产净值 x0.01%/ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 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
-	-	-	-	-	-	-
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
中国银行	-	-	-	-	454,226,000.00	26,147.60

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

份额单位：份

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			
	海富通货 币A	海富通货 币B	海富通货 币C	海富通货 币D	海富通货 币A	海富通货 币B	海富通货 币C	海富通货 币D
报告期初持有的基金份额	-	191,409, 110.00	-	-	-	20,544,3 28.17	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	201,166, 644.82	-	-	-	220,434, 435.80	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	307,000, 000.00	-	-	-	51,000,0 00.00	-	-
报告期末持有的基金份额	-	85,575,7 54.82	-	-	-	189,978, 763.97	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	4.59%	-	-	-	2.81%	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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

本报告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。

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
中国银行-活期存款	2,399,564.51	52,743.21	2,426,296.95	63,907.87
合计	2,399,564.51	52,743.21	2,426,296.95	63,907.87

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**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期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

海富通货币 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
45,297,987.79	21,749.32	302,507.55	45,622,244.6 6	-

海富通货币 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
30,051,583.48	708,355.05	-380,373.67	30,379,564.8 6	-

海富通货币 D

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
8,684,335.83	74,952.04	250,302.71	9,009,590.58	-

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**

本基金在本报告期内未因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

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**

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金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 605,057,009.39 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
180211	18 国开 11	2023-07-03	103.53	2,300,000	238,125,054.22
200407	20 农发 07	2023-07-03	102.85	1,000,000	102,854,164.13
200207	20 国开 07	2023-07-03	102.82	700,000	71,976,414.87
220211	22 国开 11	2023-07-03	101.58	700,000	71,103,182.24
220408	22 农发 08	2023-07-03	101.32	700,000	70,926,505.40
220306	22 进出 06	2023-07-03	101.50	487,000	49,431,068.10
2304113	23 农发贴现 13	2023-07-03	99.79	479,000	47,800,319.24
合计				6,366,000	652,216,708.20

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作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

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

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行股份有限公司及其他股份制商业银行，与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，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信

用评级在 AAA 级以下的企业债券或长期信用评级在 AA+以下的其他债券，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%。

于 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和资产支持证券占基金资产净值的比例为 20.38%（2022 年 12 月 31 日：19.25%）。

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6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	465,680,295.08	778,216,904.21
合计	465,680,295.08	778,216,904.21

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债、政策性金融债及无第三方评级机构评级的债券。

6.4.13.2.2 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	2,041,985,748.09	368,970,725.38
合计	2,041,985,748.09	368,970,725.38

6.4.13.2.3 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	154,204,777.86	82,939,756.40
AAA 以下	-	-
未评级	412,955,633.22	-
合计	567,160,411.08	82,939,756.40

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为政策性金融债。

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。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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%。

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6月30日	6个月以内	6个月-1年	不计息	合计
资产				
银行存款	4,648,101,039.87	1,302,066,445.39	-	5,950,167,485.26
交易性金融资产	3,074,826,454.25	-	-	3,074,826,454.25
买入返售金融资产	3,458,766,563.08	-	-	3,458,766,563.08
应收申购款	-	-	1,020,318.04	1,020,318.04
资产总计	11,181,694,057.20	1,302,066,445.39	1,020,318.04	12,484,780,820.63
负债				
卖出回购金融资产款	605,057,009.39	-	-	605,057,009.39
应付赎回款	-	-	973,202.63	973,202.63
应付管理人报酬	-	-	2,624,846.83	2,624,846.83
应付托管费	-	-	437,474.52	437,474.52

应付销售服务费	-	-	1,353,525.48	1,353,525.48
应交税费	-	-	12,469.09	12,469.09
应付利润	-	-	747,102.88	747,102.88
其他负债	-	-	259,333.35	259,333.35
负债总计	605,057,009.39	-	6,407,954.78	611,464,964.17
利率敏感度缺口	10,576,637,047.81	1,302,066,445.39	-5,387,636.74	11,873,315,856.46
上年度末	6 个月以内	6 个月-1 年	不计息	合计
2022 年 12 月 31 日				
资产				
银行存款	2,520,262,091.35	100,338,333.14	-	2,620,600,424.49
交易性金融资产	1,230,127,385.99	-	-	1,230,127,385.99
买入返售金融资产	1,179,009,297.69	-	-	1,179,009,297.69
应收申购款	-	-	420.00	420.00
资产总计	4,929,398,775.03	100,338,333.14	420.00	5,029,737,528.17
负债				
应付赎回款	-	-	1,066.64	1,066.64
应付管理人报酬	-	-	1,173,704.22	1,173,704.22
应付托管费	-	-	195,617.38	195,617.38
应付销售服务费	-	-	226,240.99	226,240.99
应交税费	-	-	10,534.40	10,534.40
应付利润	-	-	574,666.29	574,666.29
其他负债	-	-	276,657.14	276,657.14
负债总计	-	-	2,458,487.06	2,458,487.06
利率敏感度缺口	4,929,398,775.03	100,338,333.14	-2,458,067.06	5,027,279,041.11

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 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-1,232,827.50	-279,420.48
	市场利率下降 25 个基点	1,236,426.79	280,200.39

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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	3,074,826,454.25	1,230,127,385.99
第三层次	-	-
合计	3,074,826,454.25	1,230,127,385.99

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。

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

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，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2022 年 12 月 31 日：无）。

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工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

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	3,074,826,454.25	24.63
	其中：债券	3,074,826,454.25	24.63
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,458,766,563.08	27.70
	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	5,950,167,485.26	47.66
4	其他各项资产	1,020,318.04	0.01
5	合计	12,484,780,820.63	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	1.76	
	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	605,057,009.39	5.10
	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银行间交易日融资余额占基金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基金资产净值的 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	72
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	76
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	47

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

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	36.54	5.10
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	17.21	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	17.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	11.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	21.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	105.14	5.10

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

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	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	655,631,853.22	5.52

	其中：政策性金融债	655,631,853.22	5.52
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	223,004,075.08	1.88
6	中期票据	154,204,777.86	1.30
7	同业存单	2,041,985,748.09	17.20
8	其他	-	-
9	合计	3,074,826,454.25	25.90
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	180211	18 国开 11	2,300,000	238,125,054.22	2.01
2	112303116	23 农业银行 CD116	2,000,000	199,174,807.22	1.68
3	112305133	23 建设银行 CD133	2,000,000	199,079,481.50	1.68
4	012284145	22 申能股 SCP005	1,500,000	151,986,816.95	1.28
5	200407	20 农发 07	1,000,000	102,854,164.13	0.87
6	112381226	23 苏州银行 CD131	1,000,000	99,912,461.70	0.84
7	112220167	22 广发银行 CD167	1,000,000	99,712,207.32	0.84
8	112286287	22 西安银行 CD012	1,000,000	99,649,046.09	0.84
9	112271738	22 南京银行 CD242	1,000,000	99,631,285.12	0.84
10	112217164	22 光大银行 CD164	1,000,000	99,625,686.87	0.84

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	0.0342%
报告期内偏离度的最低值	-0.0036%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0120%

注：以上数据按银行间交易日统计。

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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

2007 年 7 月 1 日基金实施新会计准则后,本基金所持有的债券(包括票据)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与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

7.9.2 报告期内本基金投资的 23 建设银行 CD133 (112305133) 的发行人,因公司治理和内部控制制度与监管规定不符,监管发现问题屡查屡犯或未充分整改,向检查组提供企业出具的虚假证明材料,未按规定及时报送案件信息,违规发放房地产贷款等共计 38 项违法行为,于 2023 年 2 月 16 日被中国银行保险监督管理委员会没收违法所得并处罚款合计 19891.5626 万元;其中总行 7341.5626 万元,分支机构 12550 万元。

对该证券的投资决策程序的说明:银行业整体信用水平高,且该银行为全国大型银行,综合实力强,信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程,该证券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的 22 广发银行 CD167 (112220167) 的发行人,因存在违反人民币反假有关规定,违反人民币管理规定,占压财政存款或者资金,违反国库管理其他规定,违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定,未按规定履行客户身份识别义务,未按规定保存客户身份资料和交易记录,未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告,与身份不明的客户进行交易等违法行为,于 2022 年 8 月 31 日被中国人民银行予以警告,并罚款 3484.8 万元。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为全国大型银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的 23 农业银行 CD116（112303116）的发行人，作为托管机构，存在未及时发现理财产品投资集中度超标情况，理财托管业务违反资产独立性原则，操作管理不到位等问题，于 2022 年 9 月 30 日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 150 万元。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为全国大型银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余七名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	1,020,318.04
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,020,318.04

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	持有份额	占总份	

				额比例		额比例
海富通货币 A	1,447,782	5,367.90	18,750,488.85	0.24%	7,752,801,258. 65	99.76%
海富通货币 B	26	71,779,184. 24	1,852,527,795. 66	99.26%	13,730,994.68	0.74%
海富通货币 C	-	-	-	-	-	-
海富通货币 D	324,806	6,882.59	-	-	2,235,505,318. 62	100.00 %
合计	1,772,614	6,698.20	1,871,278,284. 51	15.76%	10,002,037,571 .95	84.24%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、B、C、D 级比例分母为各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用基金份额的合计数（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	其他机构	576,791,219.55	4.86%
2	其他机构	151,633,158.88	1.28%
3	其他机构	150,167,913.32	1.26%
4	其他机构	139,859,359.62	1.18%
5	其他机构	110,353,144.87	0.93%
6	保险类机构	108,665,687.24	0.92%
7	银行类机构	100,281,152.69	0.84%
8	基金类机构	85,575,754.82	0.72%
9	保险类机构	58,327,528.58	0.49%
10	其他机构	57,130,896.78	0.48%

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	海富通货币 A	178,825.77	0.0023%
	海富通货币 B	0.00	0.0000%
	海富通货币 C	0.00	0.0000%
	海富通货币 D	90,164.44	0.0040%
	合计	268,990.21	0.0023%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	海富通货币 A	0~10
	海富通货币 B	0
	海富通货币 C	-
	海富通货币 D	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通货币 A	0~10
	海富通货币 B	0
	海富通货币 C	-
	海富通货币 D	0
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通货币 A	海富通货币 B	海富通货币 C	海富通货币 D
基金合同生效日（2005 年 1 月 4 日）基金份额总额	964,512,079.2 0	-	-	-
本报告期期初基金份额总额	851,724,028.6 5	4,175,555,012. 46	-	-
本报告期基金总申购份额	29,061,966,30 3.65	6,892,765,852. 85	-	5,464,101,442. 30
减：本报告期基金总赎回份额	22,142,138,58 4.80	9,202,062,074. 97	-	3,228,596,123. 68
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,771,551,747. 50	1,866,258,790. 34	-	2,235,505,318. 62

注：总申购含红利再投及转换入份额；总赎回含转换出份额。

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

报告期内，基金管理人、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

报告期无基金管理人、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

报告期内本基金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，为本基金提供审计服务的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

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

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
海通证券	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行主观性评议，形成证券公司交易单元租用意见。

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会核准。

<2> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

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
海通证券	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值未超过 0.5%。

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	海富通货币市场证券投资基金春节假期前两个工作日暂停申购和转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-16
2	海富通货币市场证券投资基金调整大额申购和转换转入业务金额限额的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-30
3	海富通基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-06
4	海富通基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-22
5	关于海富通货币市场证券投资基金增加 C 级和 D 级基金份额并相应修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-21
6	海富通基金管理有限公司关于海富通货币市场证券投资基金新增中国邮政储蓄银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-27

7	海富通基金管理有限公司关于海富通货币市场证券投资基金 D 级份额新增招商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-27
8	海富通基金管理有限公司关于海富通货币市场证券投资基金 D 级份额新增直销柜台为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-28
9	海富通货币市场证券投资基金暂停 C 级和 D 级份额大额申购业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-29
10	海富通基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
11	海富通货币市场证券投资基金五一假期前两个工作日暂停申购和转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-25
12	海富通基金管理有限公司关于海富通货币市场证券投资基金 C 级、D 级基金份额开通与旗下部分基金之间转换业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-28
13	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加兴业银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-19
14	海富通货币市场证券投资基金调整大额申购和转换转入业务金额限额的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-30
15	海富通基金管理有限公司关于调整基金经理助理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-03
16	海富通货币市场证券投资基金端午假期前两个工作日暂停申购和转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-17

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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 109 只公募基金。截至 2023 年 6 月 30 日，海富通

管理的公募基金资产规模约 1649 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获“IAMAC 推介·2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通货币市场证券投资基金的文件

- (二)海富通货币市场证券投资基金基金合同
- (三)海富通货币市场证券投资基金招募说明书
- (四)海富通货币市场证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

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。

海富通基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日