

华富天益货币市场基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 06 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合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
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合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 债券回购融资情况.....	44
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	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.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45

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	46
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.....	46
7.9 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	50
10.9 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富天益货币市场基金	
基金简称	华富天益货币	
基金主代码	004198	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 1 月 25 日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	30,090,165,052.38 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华富天益货币 A	华富天益货币 B
下属分级基金的交 易代码	004198	004199
报告期末下属分级 基金的份额总额	8,213,112.49 份	30,081,951,939.89 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下，结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等方面的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，采取主动性的投资策略和精细化的操作手法，发现和捕捉市场的机会，实现基金的投资目标。
业绩比较基准	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
风险收益特征	同期七天通知存款利率（税后）。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华富基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	满志弘
	联系电话	021-68886996
	电子邮箱	manzh@hffund.com
客户服务电话	400-700-8001	95528
传真	021-68887997	021-63602540
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	上海市中山东一路 12 号

办公地址	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	上海市北京东路 689 号
邮政编码	200120	200001
法定代表人	赵万利	郑杨

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	华富天益货币 A	华富天益货币 B
本期已实现收益	44,909.87	358,919,416.68
本期利润	44,909.87	358,919,416.68
本期净值收益率	0.9600%	1.0843%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
	期末基金资产净值	8,213,112.49
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(2022年6月30日)	
	累计净值收益率	15.1516%

注：1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2) 由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于

所列数字。

4) 本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华富天益货币 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	0.1362%	0.0003%	0.1110%	0.0000%	0.0252%	0.0003%
过去三个月	0.4460%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.1094%	0.0007%
过去六个月	0.9600%	0.0008%	0.6695%	0.0000%	0.2905%	0.0008%
过去一年	2.0432%	0.0009%	1.3500%	0.0000%	0.6932%	0.0009%
过去三年	6.6274%	0.0010%	4.0537%	0.0000%	2.5737%	0.0010%
自基金合同生效起至今	15.1516%	0.0021%	7.3344%	0.0000%	7.8172%	0.0021%

华富天益货币 B

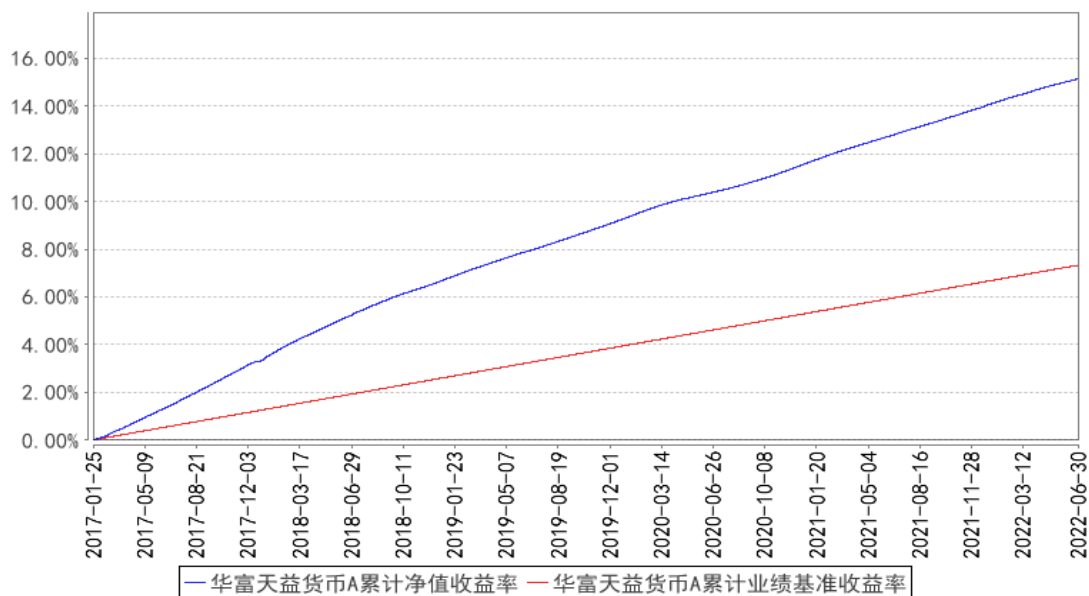
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1556%	0.0004%	0.1110%	0.0000%	0.0446%	0.0004%
过去三个月	0.5074%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.1708%	0.0007%
过去六个月	1.0843%	0.0008%	0.6695%	0.0000%	0.4148%	0.0008%

过去一年	2.2992%	0.0008%	1.3500%	0.0000%	0.9492%	0.0008%
过去三年	7.4236%	0.0010%	4.0537%	0.0000%	3.3699%	0.0010%
自基金合同生效起至今	16.6962%	0.0021%	7.3344%	0.0000%	9.3618%	0.0021%

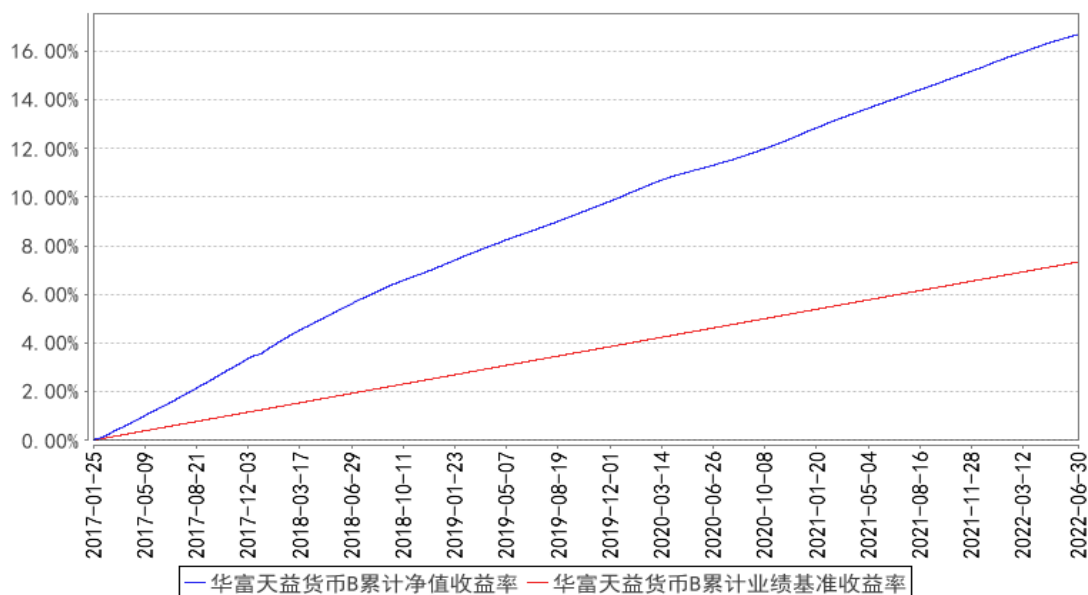
注：业绩比较基准收益率=同期七天通知存款利率（税后），业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

华富天益货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华富天益货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为 2017 年 1 月 25 日到 2017 年 7 月 25 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了基金合同的相关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富

恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富国潮优选混合型发起式证券投资基金、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金、华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金和华富安业一年持有期债券型证券投资基金共五十五只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姚姣	本基金的基金经理	2017 年 1 月 25 日	-	十年	复旦大学金融学硕士，研究生学历。先后任职于广发银行股份有限公司、上海农商银行股份有限公司。2016 年 11 月加入华富基金管理有限公司，自 2017 年 1 月 25 日起任华富天益货币市场基金基金经理，自 2017 年 1 月 4 日起任华富恒稳纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2017 年 11 月 22 日起任华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2019 年 5 月 6 日起任华富恒欣纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 19 日起任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 13 日起任华富天盈货币市场基金基金经理，自 2021 年 12 月 13 日起任华富货币市场基金基金经理，具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年无论国内国外的宏观经济基本面都经历了大起大落的起伏以及频发的黑天鹅事件冲击。国内受疫情反复影响，经济短期面临巨大的下行压力，之后逐渐步入弱复苏阶段，但依然受到地产下行、消费萎靡等需求端压力，复苏进度缓慢力度偏弱。海外则是与国内相反的经济周期演变，年初强劲的疫后复苏使得通胀高企，在俄乌冲突等黑天鹅事件冲击下，通胀屡创新高，在二季度将海外经济带入衰退周期。

央行的货币政策态度上，上半年依然延续 2021 年以来的非常规宽松政策。尤其二季度更甚，3 月末上海疫情爆发以来，总量层面，货币政策有降准、央行上缴利润并形成基础投放等举措，结构性工具层面，下调 5 年以上 LPR、创设新型再贷款工具、推动一揽子稳增长政策落地等。相应的，资金利率水平在二季度进一步下行，明显低于政策利率水平，整个二季度货币政策呵护意图明显。

债券市场在 22 年上半年整体上延续 2018 年以来的牛市行情，在震荡中利率中枢逐步下探，在非常规宽松的货币政策支持下，短端利率水平下行幅度远远超过中长端，利率曲线快速走陡，同时票息策略为主的信用债表现也远远好于久期策略为主的利率债，使得各个期限的信用利差也快速压缩，均来到了历史极值附近。

本基金在上半年合理安排现金流，提前配置合理久期的资产以应对半年年末可能有的较大规模赎回。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富天益货币 A 的基金份额净值增长率为 0.9600%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。截止本期末，华富天益货币 B 的基金份额净值增长率为 1.0843%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，当前货币政策处于极为宽松的状态，下半年在经济可能开启弱复苏的基本面背景下，货币政策最宽松的时刻可能就在二季度，央行货币政策的边际变化可能取决于地产产业链的复苏程度以及企业投资和居民消费意愿的触底修复，关注货币政策边际变化可能对货币类基金带来的压力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并按基金份额面值 1.00 元分配后转入持有人权益，每日结转当日收益到基金份额持有人基金账户。本基金在本半年度 A 级应分配收益 44,909.87 元，B 级应分配收益 358,919,416.68 元，已全部分配，符合法律法规和《基金合同》的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

从 2017 年 3 月 1 日起至本报告期末（2022 年 06 月 30 日），本基金持有人数存在连续六十个工作日不满二百人的情形，至本报告期期末（2022 年 06 月 30 日）本基金持有人数仍不满二百人。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现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

本报告期内，由华富基金管理有限公司编制本托管人复核的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”部分未在托管人复核范围内）、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：华富天益货币市场基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,299,240,736.82	4,414,963,801.08
结算备付金		210,621,052.59	170,909,090.91
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	13,981,821,502.08	14,815,572,771.92
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		12,001,880,938.65	12,981,505,542.67
资产支持证券投资		1,979,940,563.43	1,834,067,229.25
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	11,100,046,107.96	10,727,042,643.57
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		4,749,576.37	8,433,010.61
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	83,923,717.44
资产总计		30,596,478,975.82	30,220,845,035.53
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021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		500,074,879.47	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,159,359.43	4,124,349.57
应付托管费		1,386,453.15	1,374,783.18
应付销售服务费		278,365.36	275,774.19
应付投资顾问费		-	-
应交税费		175,749.65	227,318.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	239,116.38	248,248.68
负债合计		506,313,923.44	6,250,474.31
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	30,090,165,052.38	30,214,594,561.22
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		30,090,165,052.38	30,214,594,561.22

负债和净资产总计		30,596,478,975.82	30,220,845,035.53
----------	--	-------------------	-------------------

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 30,090,165,052.38 份，其中华富天益货币 A 基金份额总额 8,213,112.49 份，基金份额净值 1.0000 元；华富天益货币 B 基金份额总额 30,081,951,939.89 份，基金份额净值 1.0000 元。

6.2 利润表

会计主体：华富天益货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		396,384,109.36	438,150,400.48
1. 利息收入		220,503,526.79	438,345,798.98
其中：存款利息收入	6.4.7.13	87,051,958.20	89,811,935.52
债券利息收入		-	186,305,412.95
资产支持证券利息收入		-	24,850,120.07
买入返售金融资产收入		133,451,568.59	137,378,330.44
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		175,872,463.87	-219,672.19
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	148,984,588.92	-219,672.19
资产支持证券投资	6.4.7.16	26,887,874.95	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
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）	6.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	8,118.70	24,273.69

减：二、营业总支出		37,419,782.81	40,575,787.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	24,816,270.88	24,235,952.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,272,090.28	8,078,650.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,659,862.06	1,618,289.88
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		2,419,665.01	6,357,662.20
其中：卖出回购金融资产支出		2,419,665.01	6,357,662.20
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		103,397.31	139,472.05
8. 其他费用	6.4.7.23	148,497.27	145,760.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		358,964,326.55	397,574,613.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		358,964,326.55	397,574,613.12
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		358,964,326.55	397,574,613.12

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华富天益货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	30,214,594,561.22	-	-	30,214,594,561.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基	30,214,594,561.22	-	-	30,214,594,561.22

金净值)				
三、本期 增减变动额(减少以“-” 号填列)	-124,429,508.84	-	-	-124,429,508.84
(一)、 综合收益总额	-	-	358,964,326.55	358,964,326.55
(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)	-124,429,508.84	-	-	-124,429,508.84
其中:1. 基金申购款	18,141,354,919.33	-	-	18,141,354,919.33
2 .基金赎回款	-18,265,784,428.17	-	-	-18,265,784,428.17
(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)	-	-	-358,964,326.55	-358,964,326.55
(四)、 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净	30,090,165,052.38	-	-	30,090,165,052.38

资产(基金净值)				
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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)	32,943,773,871.18	-	-	32,943,773,871.18
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)	32,943,773,871.18	-	-	32,943,773,871.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,711,370,070.31	-	-	-4,711,370,070.31
(一)、综合收益总额	-	-	397,574,613.12	397,574,613.12
(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)	-4,711,370,070.31	-	-	-4,711,370,070.31
其中:1.基金申购款	15,366,143,980.92	-	-	15,366,143,980.92
2	-20,077,514,051.23	-	-	-20,077,514,051.23

. 基金赎回款				
(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)	-	-	-397,574,613.12	-397,574,613.12
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	28,232,403,800.87	-	-	28,232,403,800.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵万利

曹华玮

邵恒

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华富天益货币市场基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（证监许可[2016] 3136号）核准，基金合同于2017年01月25日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具《验资报告》（天健验（2016）6-10号）。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《华富天益货币市场基金基金合同》的规定，本基金的投资范围限于以下金融工具，包括：

(一) 现金；(二) 期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；
(三) 剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；
(四) 中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净资产变动等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则		新金融工具准则	
列报项目	计量类别	账面价值	列报项目 计量类别 账面价值
银行存款	摊余成本	4,414,963,801.08	银行存款 摊余成本 4,432,117,039.79
结算备付金	摊余成本	170,909,090.91	结算备付金 摊余成本 170,993,690.92
存出保证金	摊余成本		存出保证金 摊余成本
交易性金融资产	以公允价值计量且其变动计入当期损益	14,815,572,771.92	交易性金融资产
产	以公允价值计量且其变动计入当期损益	14,885,038,906.85	
衍生金融资产	以公允价值计量且其变动计入当期损益	-	衍生金融资产 以公允价值计量且其变动计入当期损益 -
买入返售金融资产	摊余成本	10,727,042,643.57	买入返售金融资产 摊余成本 10,724,262,387.36
应收利息	摊余成本	83,923,717.44	其他资产-应收利息 摊余成本 -
应收证券清算款	摊余成本	8,433,010.61	应收清算款 摊余成本 8,433,010.61
应收股利	摊余成本	-	应收股利 摊余成本 -
应收申购款	摊余成本	-	应收申购款 摊余成本 -
其他资产-其他应收款	摊余成本	-	其他资产-其他应收款 摊余成本
交易性金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益	-	交易性金融负债 以公允价值计量且其变动计入当期损益 -
衍生金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益	-	衍生金融负债 以公允价值计量且其变动计入当期损益 -
卖出回购金融资产款	摊余成本	-	卖出回购金融资产款 摊余成本 -
应付证券清算款	摊余成本	-	应付清算款 摊余成本 -
应付赎回款	摊余成本	-	应付赎回款 摊余成本 -
应付管理人报酬	摊余成本	4,124,349.57	应付管理人报酬 摊余成本 4,124,349.57
应付托管费	摊余成本	1,374,783.18	应付托管费 摊余成本 1,374,783.18
应付销售服务费	摊余成本	275,774.19	应付销售服务费 摊余成本 275,774.19

应付利润 摊余成本 应付利润 摊余成本 -

应付交易费用 摊余成本 78,948.68 其他负债-应付交易费用 摊余成本 78,948.68

应付利息 摊余成本 - 其他负债-应付利息 摊余成本 -

其他负债-其他应付款 摊余成本 169,300.00 其他负债-其他应付款 摊余成本 169,300.00

应交税费 摊余成本 227,318.69 应交税费 摊余成本 227,318.69

于 2021 年 12 月 31 日,“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日,根据新金融工具准则下的计量类别,将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示,本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》,本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露,这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无重大变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1号)、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2012〕85号)、《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》(财税〔2014〕81号)、《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》(财税〔2016〕127号)、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2015〕101号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税〔2016〕46号)、《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税〔2016〕140号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税〔2017〕56号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90号)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(一) 自 2018 年 1 月 1 日起, 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入, 暂免征收企业所得税;

(三) 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内 (含 1 个月) 的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年 (含 1 年) 的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(四) 对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司 (以下简称 “中国结算”) 提出申请, 由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利, 由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

主要税种及税率列示如下:

税种 计税依据 税率

增值税 以按税法规定计算的金融服务销售额 3%

城市维护建设税 实际缴纳的流转税税额 7%

教育费附加 实际缴纳的流转税税额 3%

地方教育附加 实际缴纳的流转税税额 2%

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	17,248,167.03
等于: 本金	17,244,529.00
加: 应计利息	3,638.03
减: 坏账准备	-
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	5,281,992,569.79
等于: 本金	5,270,000,000.00

加：应计利息	11,992,569.79
减：坏账准备	-
合计	5,299,240,736.82

注：其他存款所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022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	12,001,880,938.65	12,010,060,983.82	8,180,045.17	0.0272
	合计	12,001,880,938.65	12,010,060,983.82	8,180,045.17	0.0272
资产支持证券		1,979,940,563.43	1,982,767,763.43	2,827,200.00	0.0094
合计		13,981,821,502.08	13,992,828,747.25	11,007,245.17	0.0366

注：注1：偏离金额=影子定价-摊余成本；

注2：偏离度=偏离金额/摊余成本确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末和上年度末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,000,000,000.00	-
银行间市场	1,100,046,107.96	-
合计	11,100,046,107.96	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	110,473.22
其中：交易所市场	-
银行间市场	110,473.22
应付利息	-
应付审计费	59,835.79
中债账户维护费	4,500.00
应付信息披露费	59,507.37
上清账户维护费	4,800.00
合计	239,116.38

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华富天益货币 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,908,097.23	7,908,097.23
本期申购	31,307,405.68	31,307,405.68
本期赎回（以“-”号填列）	-31,002,390.42	-31,002,390.42
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	8,213,112.49	8,213,112.49

华富天益货币 B

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,206,686,463.99	30,206,686,463.99
本期申购	18,110,047,513.65	18,110,047,513.65
本期赎回（以“-”号填列）	-18,234,782,037.75	-18,234,782,037.75
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	30,081,951,939.89	30,081,951,939.89

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

单位：人民币元

华富天益货币 A

项目	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	44,909.87	-	44,909.87
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	-44,909.87	-	-44,909.87
本期末	-	-	-

华富天益货币 B

项目	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	358,919,416.68	-	358,919,416.68
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	-358,919,416.68	-	-358,919,416.68
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	45,421.44
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	84,919,019.35
结算备付金利息收入	2,087,517.41
其他	-
合计	87,051,958.20

注：其他存款利息收入所列金额为基金投资于有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

注：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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	148,542,031.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券	442,557.90

到期兑付) 差价收入	
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	148,984,588.92

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	18,387,888,401.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,312,911,393.62
减：应计利息总额	74,525,575.35
减：交易费用	8,875.00
买卖债券差价收入	442,557.90

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 2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	26,887,874.95
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
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	26,887,874.95

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	725,501,368.12
减：卖出资产支持证券成本总额	709,460,000.00
减：应计利息总额	16,041,368.12
减：交易费用	0.00
资产支持证券投资收益	0.00

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：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

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

注：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

注：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

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
其他	8,118.70
合计	8,118.70

注：其他收入为资产支持证券募集期利息。

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	50,824.11
账户维护费	18,330.00
合计	148,497.27

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

无

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行的债券交易

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元交易产生的佣金。

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	24,816,270.88	24,235,952.19
其中：支付销售机构的客户维护费	534,220.49	170,000.84

注：基金管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
----	--------------------------------	-------------------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,272,090.28	8,078,650.75

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H=E \times 0.05\% \div$ 当年天数（H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

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 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		
	华富天益货币 A	华富天益货币 B	合计
华富基金管理有限公司 (管理人)	2,389.04	1,528,303.24	1,530,692.28
华安证券股份有限公司 (管理人股东)	5.78	6,532.80	6,538.58
合计	2,394.82	1,534,836.04	1,537,230.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富天益货币 A	华富天益货币 B	合计
华富基金管理有限公司 (管理人)	1,536.02	1,570,757.72	1,572,293.74
华安证券股份有限公司 (管理人股东)	5.43	5,559.08	5,564.51
合计	1,541.45	1,576,316.80	1,577,858.25

注：本基金 A 类按前一日基金资产净值的 0.25% 计提，B 类按前一日基金资产净值的 0.01% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$A \text{ 类日基金销售服务费} = A \text{ 类前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

$$B \text{ 类日基金销售服务费} = B \text{ 类前一日基金资产净值} \times 0.01\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

	华富天益货币 A	华富天益货币 B
基金合同生效日(2017年1月25日)持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	82,382.92	0.00
报告期间申购/买入总份额	412.39	39,202,651.19
报告期间因拆分变动份额	-82,795.31	82,795.31
减:报告期间赎回/卖出总份额	0.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额	0.00	29,285,446.50
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.1000%
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
	华富天益货币 A	华富天益货币 B
基金合同生效日(2017年1月25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	0.0000%	0.0000%

注:关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定,符合公允性要求,申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

华富天益货币 B

关联方名称	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例(%)	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例(%)

上海浦东发展银行总行	21,855,366,908.94	72.6300	21,620,495,653.12	71.5600
------------	-------------------	---------	-------------------	---------

注：关联方投资基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
上海浦东发展银行股份有限公司	17,248,167.03	45,421.44	2,249,130.54	117,146.40

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

华富天益货币 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
44,901.97	7.90	-	44,909.87	-
华富天益货币 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
358,885,557.95	33,858.73	-	358,919,416.68	-

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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
------	------	-------	--------	-------	--------

200011	20 付息国 债 11	2022 年 7 月 1 日	102.40	1,000,000	102,396,999.68
210211	21 国开 11	2022 年 7 月 1 日	101.91	2,128,000	216,866,974.02
210411	21 农发 11	2022 年 7 月 1 日	101.65	1,500,000	152,479,369.15
229917	22 贴现国 债 17	2022 年 7 月 1 日	99.39	500,000	49,697,428.73
229924	22 贴现国 债 24	2022 年 7 月 1 日	99.22	165,000	16,371,693.92
合计				5,293,000	537,812,465.50

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	200,000,000.00	200,000,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	2,110,012,012.89	1,260,000,308.96
合计	2,310,012,012.89	1,460,000,308.96

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,960,540,000.00	1,834,067,229.25
合计	1,960,540,000.00	1,834,067,229.25

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	8,033,505,250.40	9,719,990,039.65
合计	8,033,505,250.40	9,719,990,039.65

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	2,250,011,918.29	1,460,000,308.96
AAA 以下	60,000,094.60	-
未评级	-	-
合计	2,310,012,012.89	1,460,000,308.96

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	1,960,540,000.00	1,834,067,229.25
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	1,960,540,000.00	1,834,067,229.25

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	7,983,720,623.80	9,719,990,039.65
AAA 以下	49,784,626.60	-
未评级	-	-
合计	8,033,505,250.40	9,719,990,039.65

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月	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

30日						
资产						
银行存款	17,248,167.03	4,078,205,208.73	1,203,787,361.06	-	-	5,299,240,736.82
结算备付金	210,621,052.59	-	-	-	-	210,621,052.59
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	1,682,295,726.87	6,082,191,632.06	6,217,334,143.15	-	-	13,981,821,502.08
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	11,100,046,107.96	-	-	-	-	11,100,046,107.96
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收	-	-	-	-	-	-

股利							
应收申购款							
应收清算款						4,749,576.37	4,749,576.37
其他资产							
资产总计	13,010,211,054.45	10,160,396,840.79	7,421,121,504.21			4,749,576.37	30,596,478,975.82
负债							
应付赎回款							
应付管理人报酬						4,159,359.43	4,159,359.43
应付托管费						1,386,453.15	1,386,453.15
应付清算款							
卖	500,074,879.47						500,074,879.47

出回购金融资产款							
应付销售服务费						278,365.36	278,365.36
应付投资顾问费							
应付利润							
应交税费						175,749.65	175,749.65
其他负债						239,116.38	239,116.38
负债总计	500,074,879.47					6,239,043.97	506,313,923.44
利率敏感度缺口	12,510,136,174.98	10,160,396,840.79	7,421,121,504.21			-1,489,467.60	30,090,165,052.38

上 年 度 末 202 1 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	14,963,801.08	3,000,000,000.00	1,400,000,000.00	-	-	-	4,414,963,801.08
结 算 备 付 金	170,909,090.91	-	-	-	-	-	170,909,090.91
存 出 保 证 金	-	-	-	-	-	-	-
交 易 性 金 融 资 产	2,917,173,905.27	5,226,234,539.05	6,672,164,327.60	-	-	-	14,815,572,771.92
买 入 返 售 金 融 资 产	10,727,042,643.57	-	-	-	-	-	10,727,042,643.57
应 收 股 利	-	-	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	8,433,010.61	8,433,010.61
其他资产	-	-	-	-	-	83,923,717.44	83,923,717.44
资产总计	13,830,089,440.83	8,226,234,539.55	8,072,164,327.60	-	-	92,356,728.05	30,220,845,035.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,124,349.57	4,124,349.57
应付托管费	-	-	-	-	-	1,374,783.18	1,374,783.18
应付证券清算	-	-	-	-	-	-	-

款							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	275,774.19	275,774.19	
应付利润	-	-	-	-	-	-	
应交税费	-	-	-	-	227,318.69	227,318.69	
其他负债	-	-	-	-	248,248.68	248,248.68	
负债总计	-	-	-	-	6,250,474.31	6,250,474.31	
利率敏感度缺口	13,830,089,440.83	8,226,234,539.05	8,072,164,327.60	-	86,106,253.74	30,214,594,561.22	

注：本表各期限按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早作为期限分类标准。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 除利率外其他市场变量保持不变
----	-------------------

	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	市场利率下降 25 基点	12,969,450.24	8,154,583.85
	市场利率上升 25 基点	-12,896,919.54	-8,142,546.20

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

注：本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间（95%）		
	2. 观察期（1 年）		
	-		
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	合计	55,846,702.76	542,829,852.80

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	13,981,821,502.08	14,815,572,771.92
第三层次	-	-
合计	13,981,821,502.08	14,815,572,771.92

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

<p>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。</p> <p>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。</p>

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

<p>于 2022 年 06 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(2021 年 06 月 30 日：同)。</p>

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

<p>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。</p>
--

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	13,981,821,502.08	45.70
	其中：债券	12,001,880,938.65	39.23

	资产支持证 券	1,979,940,563.43	6.47
2	买入返售金融资产	11,100,046,107.96	36.28
	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	5,509,861,789.41	18.01
4	其他各项资产	4,749,576.37	0.02
5	合计	30,596,478,975.82	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 7.9.3 期末其他各项资产构成。

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.78	
	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	500,074,879.47	1.66
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	59
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
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

注：本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	43.21	1.66
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	11.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-

	浮动利率债		
3	60 天（含）—90 天	21.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	11.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	13.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	101.48	1.66

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 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	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	401,116,997.78	1.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,252,183,648.56	4.16
	其中：政策性 金融债	1,252,183,648.56	4.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融 资券	2,315,075,041.91	7.69
6	中期票据	-	-
7	同业存单	8,033,505,250.40	26.70
8	其他	-	-
9	合计	12,001,880,938.65	39.89
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	-	-

注：上表中，债券的成本包括债券面值和溢折价。

7.6 期末按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	112297770	22 厦门银行 CD057	4,500,000	449,444,641.85	1.49

2	210211	21 国开 11	3,000,000	305,733,516.00	1.02
3	210306	21 进出 06	3,000,000	305,426,791.86	1.02
4	112299674	22 浙江泰隆商行 CD039	3,000,000	299,176,023.50	0.99
5	112280683	22 浙江泰隆商行 CD040	3,000,000	298,854,355.38	0.99
6	112280851	22 浙江泰隆商行 CD041	3,000,000	298,789,022.27	0.99
7	112281100	22 台州银行 CD015	3,000,000	298,772,691.23	0.99
8	112294863	22 台州银行 CD001	3,000,000	298,442,114.98	0.99
9	112295101	22 郑州银行 CD085	3,000,000	298,421,397.93	0.99
10	112108145	21 中信银行 CD145	3,000,000	298,362,035.24	0.99

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0501%
报告期内偏离度的最低值	0.0156%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0327%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本报告期内本基金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

注：本报告期内本基金偏离度的绝对值未达到 0.5%。

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	136303	永熙优 39	1,000,000	102,388,821.92	0.34
2	136908	链融 55A1	1,000,000	101,029,698.63	0.34
3	136379	万科 25 优	1,000,000	100,924,032.88	0.34

4	183228	GC 电优 A1	1,000,000	98,759,536.64	0.33
5	193207	永乐 8 优	900,000	91,088,876.71	0.30
6	136922	22 中交 4A	800,000	80,931,594.52	0.27
7	136287	国链 31A1	750,000	76,817,506.85	0.26
8	136820	瑞新 33A1	700,000	70,931,210.96	0.24
9	136852	国链 33A1	700,000	70,893,775.34	0.24
10	136882	链融 53A1	700,000	70,865,698.63	0.24

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持为人民币 1.00 元。

本基金所持有的债券（包括票据）的估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按实际利率法进行摊销，每日计提收益或损失。

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中，厦门银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、台州银行股份有限公司、郑州银行股份有限公司、浙江泰隆商业银行股份有限公司、国家开发银行、中国进出口银行曾出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内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	4,749,576.37
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,749,576.37

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
华富天益货币 A	41	200,319.82	8,061,656.16	98.16	151,456.33	1.84
华富天益货币 B	46	653,955,476.95	30,081,951,939.89	100.00	0.00	0.00
合计	87	345,863,966.12	30,090,013,596.05	100.00	151,456.33	0.00

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自份额级别的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
1	银行类机构	21,855,366,908.94	72.63
2	银行类机构	1,318,130,633.56	4.38
3	银行类机构	1,078,563,808.60	3.58
4	银行类机构	959,923,082.49	3.19
5	银行类机构	522,399,579.60	1.74
6	银行类机构	501,320,853.57	1.67
7	银行类机构	495,274,513.21	1.65
8	银行类机构	461,986,542.22	1.54
9	证券类机构	317,202,314.90	1.05
10	银行类机构	314,658,209.44	1.05

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	华富天益货币 A	0.00	0.0000
	华富天益货币 B	0.00	0.0000
	合计	0.00	0.0000

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	华富天益货币 A	0
	华富天益货币 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华富天益货币 A	0
	华富天益货币 B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富天益货币 A	华富天益货币 B
基金合同生效日 (2017 年 1 月 25 日) 基金份额总额	79,717.58	200,002,000.00
本报告期期初基金份额总额	7,908,097.23	30,206,686,463.99
本报告期基金总申购份额	31,307,405.68	18,110,047,513.65
减：本报告期基金总赎回份额	31,002,390.42	18,234,782,037.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,213,112.49	30,081,951,939.89

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 本基金本报告期内基金管理人无重大人事变动。
2. 本基金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

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
民生证券	2	-	-	-	-	-

注：1) 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的几家券商租用了基金专用交易单元。

2) 本报告期本基金租用券商交易单元无变更。

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 (%)
民生证券	-	-	310,200,000.00	100.00	-	-

注：债券交易的成交金额按净价统计，其中交易所上市实行全价交易的债券成交金额按全价统计。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

注：无。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华富基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准	中国证监会指定媒介	2022 年 1 月 5 日

	则的公告		
2	华富基金管理有限公司旗下基金 2021 年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2022 年 1 月 21 日
3	华富天益货币市场基金 2021 年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2022 年 1 月 21 日
4	华富天益货币市场基金“春节”假期前暂停申购及转入业务的公告	中国证监会指定媒介	2022 年 1 月 25 日
5	华富天益货币市场基金“清明”假期前暂停申购及转入业务的公告	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 29 日
6	华富基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 31 日
7	华富天益货币市场基金 2021 年度报告	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 31 日
8	华富天益货币市场基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2022 年 4 月 22 日
9	华富天益货币市场基金“劳动节”假期前暂停申购及转入业务的公告	中国证监会指定媒介	2022 年 4 月 23 日
10	华富天益货币市场基金“端午节”假期前暂停申购及转入业务的公告	中国证监会指定媒介	2022 年 5 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2022.1.1-2022.6.30	21,620,495.653.12	234,871,255.82	0.00	21,855,366,908.94	72.6300
产品特有风险							
无							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、华富天益货币市场基金基金合同
- 2、华富天益货币市场基金托管协议
- 3、华富天益货币市场基金招募说明书
- 4、报告期内华富天益货币市场基金在指定媒介上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅, 相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日