

# 华富天益货币市场基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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：2023 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 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。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	14
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
<b>§5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	24
<b>§8 投资组合报告</b>	<b>55</b>

8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 债券回购融资情况 .....	55
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	56
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 .....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	56
8.6 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.....	57
8.7 “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 .....	57
8.8 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资产支持证券投资明 细 .....	58
8.9 投资组合报告附注 .....	58
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	59
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
9.4 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 .....	60
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>60</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>60</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	60
11.2 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 .....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	63
11.9 其他重大事件 .....	63
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>64</b>
12.1 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 .....	64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>65</b>
13.1 备查文件目录 .....	65
13.2 存放地点 .....	65
13.3 查阅方式 .....	65

## § 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	28,376,948,890.74 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	10,280,724.74 份	28,366,668,166.00 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各方面的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，采取主动性的投资策略和精细化的操作手法，发现和捕捉市场的机会，实现基金的投资目标。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华富基金管理有限公司	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号新湖商贸大厦 6 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2022 年		2021 年		2020 年	
	华富天益货币 A	华富天益货币 B	华富天益货币 A	华富天益货币 B	华富天益货币 A	华富天益货币 B
本期已实现收益	105,267.17	656,906,503.98	40,581.16	803,792,834.29	11,971.91	839,411,378.29
本期利润	105,267.17	656,906,503.98	40,581.16	803,792,834.29	11,971.91	839,411,378.29
本期净值收益率	1.7708%	2.0208%	2.1857%	2.4469%	2.1199%	2.3678%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	期末基金资产净值	10,280,724.74	28,366,668,166.00	7,908,097.23	30,206,686,463.99	262,170.81

期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
累计净值收益率	16.0764%	17.7773%	14.0567%	15.4444%	11.6171%	12.6870%

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
过去三个月	0.4184%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	0.0781%	0.0011%
过去六个月	0.8030%	0.0009%	0.6805%	0.0000%	0.1225%	0.0009%
过去一年	1.7708%	0.0010%	1.3500%	0.0000%	0.4208%	0.0010%
过去三年	6.1998%	0.0012%	4.0537%	0.0000%	2.1461%	0.0012%

过去五年	12.3151 %	0.0018%	6.7537%	0.0000%	5.5614 %	0.0018 %
自基金合同生效起 至今	16.0764 %	0.0022%	8.0149%	0.0000%	8.0615 %	0.0022 %

## 华富天益货币 B

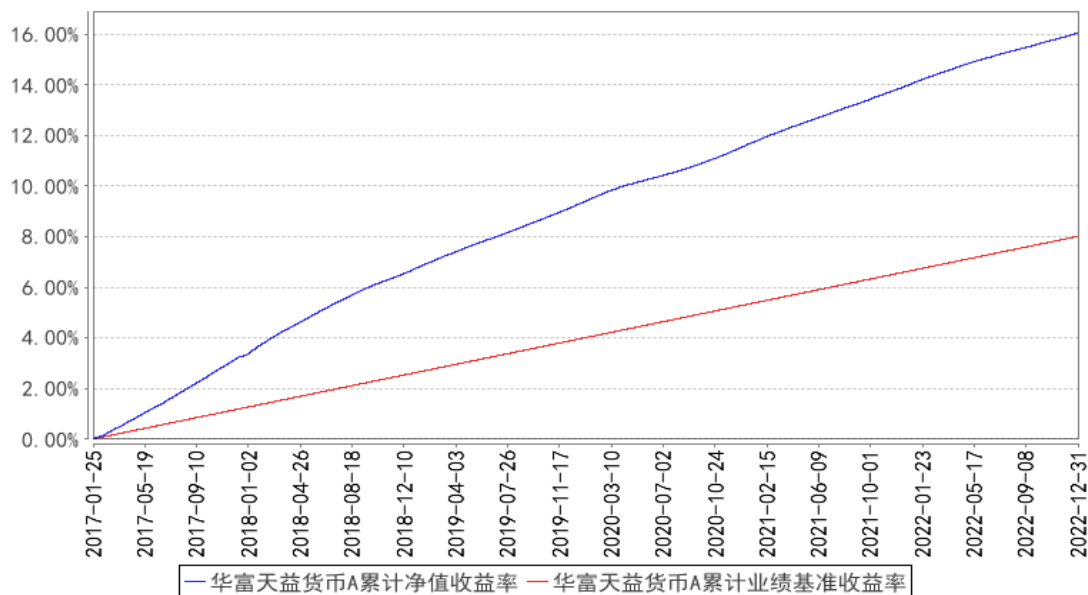
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	0.4799%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	0.1396 %	0.0011 %
过去六个月	0.9264%	0.0009%	0.6805%	0.0000%	0.2459 %	0.0009 %
过去一年	2.0208%	0.0010%	1.3500%	0.0000%	0.6708 %	0.0010 %
过去三年	6.9919%	0.0011%	4.0537%	0.0000%	2.9382 %	0.0011 %
过去五年	13.7067 %	0.0018%	6.7537%	0.0000%	6.9530 %	0.0018 %
自基金合同生效起 至今	17.7773 %	0.0022%	8.0149%	0.0000%	9.7624 %	0.0022 %

注：业绩比较基准收益率=同期七天通知存款利率(税后)。

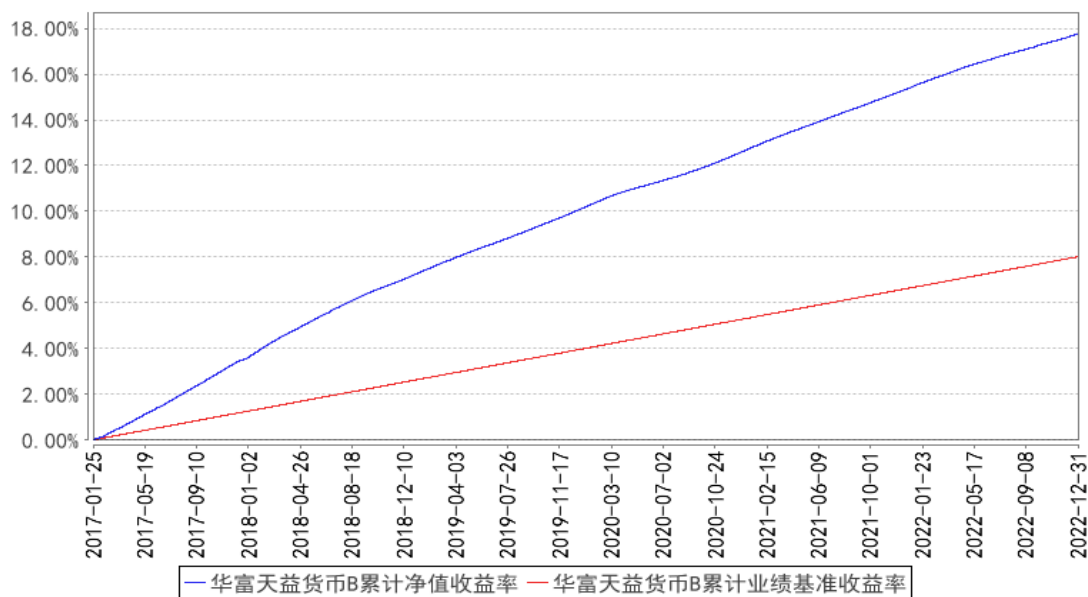


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



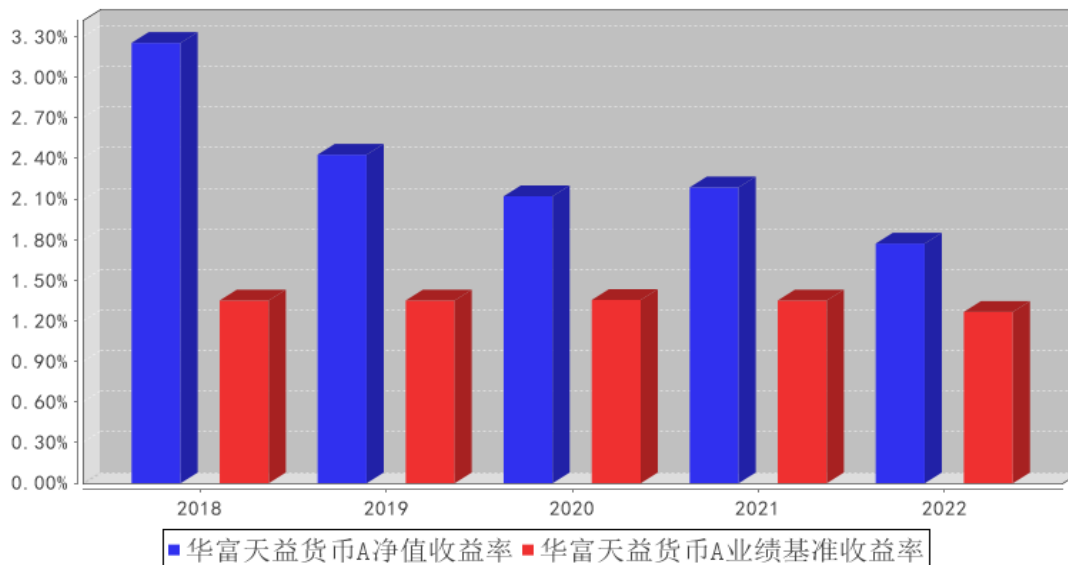
华富天益货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



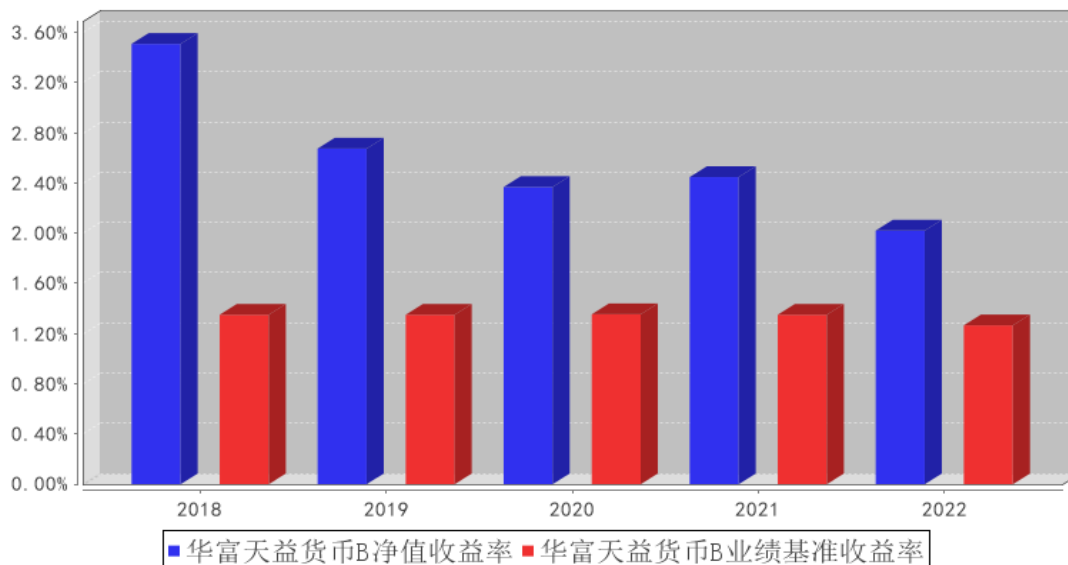
注：本基金建仓期为 2017 年 1 月 25 日到 2017 年 7 月 25 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了基金合同的相关规定。

### 3.2.3 过去五年基金每年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基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



华富天益货币B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

#### 华富天益货币 A

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2022 年	105,259.27	7.90	-	105,267.17	-
2021 年	39,082.97	1,498.19	-	40,581.16	-
2020 年	11,913.20	58.71	-	11,971.91	-
合计	156,255.44	1,564.80	-	157,820.24	-

#### 华富天益货币 B

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2022 年	656,872,645.25	33,858.73	-	656,906,503.98	-
2021 年	801,704,431.27	2,088,403.02	-	803,792,834.29	-
2020 年	838,473,007.06	938,371.23	-	839,411,378.29	-
合计	2,297,050,083. 58	3,060,632.98	-	2,300,110,716. 56	-

## § 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 12 月 31 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、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、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、华富安业一年持有期债券型证券投资基金、华富消费成长股票型证券投资基金、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、华富时代锐选混合型证券投资基金、华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金共五十八只基金。

#### 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，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 4 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 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，自 2022 年 7 月 18 日起任华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在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 公平交易制度和控制方法

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》，公司制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公司的公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体控制措施如下：

在研究分析和投资决策环节，公司通过建立规范、完善的研究管理平台，为所有的投资组合经理提供公平的研究服务和支持。公司的各类投资组合，在保证其决策相对独立的同时，在获取投资信息、投资建议及决策实施方面均享有公平的机会。各投资组合经理根据其管理的投资组合的投资风格和投资策略，制定客观、完整的交易决策规则，并按照这些规则进行投资决策，保证各投资组合投资决策的客观性和独立性。

在交易执行环节，公司设立独立的集中交易部门，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易执行的公平原则：“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。公司通过完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，确保各投资组合获得公平的交易机会。

在行为监控和分析评估环节，公司将公平交易作为日常交易监控的重要关注内容，加强对投资交易行为的监察稽核力度，公司集中交易部、监察稽核部等相关部门严格按照公司关于异常交易的界定规则对违反公平交易原则的异常交易进行识别、监控与分析。每日交易时间结束后，集中交易部对每一笔公平交易的执行结果进行登记，逐笔备注发生公平交易各指令的先后顺序及实际执行结果，由具体执行的交易员签字确认留档，并交监察稽核部备案。公司监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，对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）同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，根据纳入样本内的数据分析结果，未发现明显异常情况。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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 年四季度受国内疫情扩散，国际环境更趋复杂严峻等因素影响，国内经济基本面继续探底，PMI 季度内连续位于容枯线以下，创年内新低。疫情影响下，制造业生产活动放缓，订单下降，进出口也继续回落，内外需均呈现疲弱状态。四季度二十大闭幕标志着中国的新政治周期开启，政治的不确定性大大下降，防疫政策的转向也意味着再平衡疫情防控和经济社会发展的内在需要逐渐提升，主要矛盾将转向对国内经济基本面提振的诉求。而海外环境方面，美国加息周期开始放缓，美元流动性边际宽松，全球市场风险偏好开始回升。这些政策层面的变化使得四季度成为了 2022 年与 2023 年之间的关键拐点。

2022 年的资金面整体流动性充裕，平稳偏松，但是四季度迎来了明显的拐点，导致全年先松后紧，也给债券市场带来了直接的冲击。3 月底由于疫情形势的严峻，资金面迎来全年最松的阶段，市场利率低于政策利率的幅度和时间创纪录。4 月份社融和 M2 增速的剪刀差转负，商业银行资产荒现象明显，对应大行在质押式回购市场的净融出金额创历史新高。同时，不同于往年，财政因素在这一阶段对资金面利多作用明显，表现为央行上缴结存利润主要用于留抵退税、专项债 8 月底前基本使用完毕。10 月底，以大行净融出超季节性缩量为标志，资金面快速收敛，市场利率加快向政策利率靠拢，这也导致债券市场全年最大一波跌幅，11 月底，为阻断银行理财破净-赎回负反馈，央行重新加大维稳力度，隔夜利率再度接近 1%，

本基金在全年合理安排现金流，提前配置合理久期的资产以保证产品的流动性和安全性。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期，华富天益货币 A 份额净值增长率为 1.7708%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。

报告期，华富天益货币 B 份额净值增长率为 2.0208%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。

#### 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，与疫情防控优化节奏、经济恢复程度密切相关，2023 年资金面或前松后

紧。2023 年一季度，资金面可能延续平稳甚至偏宽松，随着疫情防控优化，感染人数和重症人数可能会有阶段性的暂时性上升，反过来又会对经济运行有负面影响，因此需要央行再度维持宽松的货币政策，对应资金面很可能平稳偏松。待疫情冲击过后，二季度及至下半年，市场利率可能加速向政策利率回归，2023 年下半年随着经济复苏步入正轨，国内通胀抬升或成为主要矛盾，货币市场可能面临较大的资金面收紧风险。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2022 年度，为加强公司内部控制，监察稽核工作从制度建设和内部监察稽核入手为公司持续发展奠定坚实的基础。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，独立、客观、公正地开展基金运作和公司管理的合规性监察，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

1、逐步建立和完善架构清晰、控制有效的内部控制机制。2022 年制定了《华富基金管理有限公司培训生管理办法》，明确了公司培训生管理工作的实施流程与规范秩序；制定了《华富基金管理有限公司互联网平台管理办法》，根据法规要求以及公司业务发展现状加强了对公司各互联网平台账号、发布内容、日常监控等方面的管理；根据《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》修订了《华富基金管理有限公司章程》；修订了《华富基金管理有限公司投资决策委员会工作规程》，优化了公募和专户投资决策委员会的人员架构、职责内容和议事规则。

2、多方位开展监察稽核工作，不断提高稽核覆盖面和检查力度。通过定期和不定期监察稽核工作的开展，公司的各个部门、各项业务的规范性和完善性都得到了较大的提高，各部门及时发现和弥补了制度建设中的漏洞和缺陷，实际业务操作流程更加科学有效。

3、加强风险监控，严格控制投资风险，通过对各基金的运行状况、投资比例、相关指标进行监控和跟踪，及时报告异常情况，确保基金投资规范运作。

4、扩大风险控制工作的覆盖面。风险控制工作不再局限于投资管理，从公司运营整体规范要求，风险控制渗透在业务的各个环节和所有部门，每月定时向风险控制委员会报告，进行及时的风险揭示。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

#### 4.7 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。报告期内相关基金估值政策由天健会计师事务所（特殊普通合伙）进行审核并出具报告，由托管银行进行复核。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。

#### 4.8 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。本基金在本年度 A 级应分配收益 105,267.17 元，B 级应分配收益 656,906,503.98 元，已全部分配，符合法律法规和《基金合同》的相关规定。

#### 4.9 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出现基金资产净值低于五千万元或基金持有人数不满二百人的情形。

## § 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”）在对华富天益货币市场基金的托管过程中，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，对华富天益货币市场基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金收益的计算以及基金费用开支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 托管人对本年度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、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审〔2023〕6-129号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华富天益货币市场基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了华富天益货币市场基金（以下简称天益货币基金）财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表，以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了天益货币基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况，以及 2022 年度的经营成果和净资产（基金净值）变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于天益货币基金及其管理人华富基金管理有限公司（以下简称基金管理人），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>基金管理人管理层（以下简称管理层）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时，管理层负责评估天益货币基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层（以下简称治理层）负责监督天益货币基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一） 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二） 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三） 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四） 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对天益货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致天益货币基金不能持续经营。</p> <p>（五） 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>天健会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>樊冬   朱慧</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号新湖商贸大厦 6 楼</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2023 年 03 月 30 日</p>

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	5,784,384,910.91	4,414,963,801.08
结算备付金		263,766,863.68	170,909,090.91
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	13,078,566,319.66	14,815,572,771.92
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		11,984,301,647.64	12,981,505,542.67
资产支持证券投资		1,094,264,672.02	1,834,067,229.25
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	9,252,889,073.62	10,727,042,643.57
应收清算款		3,262,724.66	8,433,010.61
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	83,923,717.44
资产总计		28,382,869,892.53	30,220,845,035.53
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,845,836.31	4,124,349.57
应付托管费		1,281,945.43	1,374,783.18
应付销售服务费		259,259.85	275,774.19
应付投资顾问费		-	-
应交税费		278,318.82	227,318.69
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	255,641.38	248,248.68
负债合计		5,921,001.79	6,250,474.31
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	28,376,948,890.74	30,214,594,561.22
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-	-
净资产合计		28,376,948,890.74	30,214,594,561.22
负债和净资产总计		28,382,869,892.53	30,220,845,035.53

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 28,376,948,890.74 份，其中华富天益货币 A 基金份额总额 10,280,724.74 份，基金份额净值 1.0000 元；华富天益货币 B 基金份额总额 28,366,668,166.00 份，基金份额净值 1.0000 元。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		731,602,727.05	885,825,947.73
1. 利息收入		394,678,083.85	884,117,225.94
其中：存款利息收入	7.4.7.9	151,189,240.29	198,785,237.55
债券利息收入		-	354,156,325.42
资产支持证券利息收入		-	55,507,952.15
买入返售金融资产收入		243,488,843.56	275,667,710.82
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		336,916,524.50	1,668,345.20
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	284,610,190.52	90,537.84
资产支持证券投资	7.4.7.12	52,306,333.98	1,577,807.36
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的		-	-

收益			
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	8,118.70	40,376.59
<b>减：二、营业总支出</b>		74,590,955.90	81,992,532.28
1. 管理人报酬		49,409,013.87	50,006,390.06
2. 托管费		16,469,671.30	16,668,796.72
3. 销售服务费		3,308,053.56	3,338,134.15
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,847,620.15	11,392,340.71
其中：卖出回购金融资产支出		4,847,620.15	11,392,340.71
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		258,954.47	283,875.99
8. 其他费用	7.4.7.19	297,642.55	302,994.65
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		657,011,771.15	803,833,415.45
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		657,011,771.15	803,833,415.45
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		657,011,771.15	803,833,415.45

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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（基金净值）	30,214,594,561.22	-	-	30,214,594,561.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,837,645,670.48	-	-	-1,837,645,670.48
（一）、综合收益总额	-	-	657,011,771.15	657,011,771.15
（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）	-1,837,645,670.48	-	-	-1,837,645,670.48
其中：				
1. 基金申购款	36,060,321,285.18	-	-	36,060,321,285.18
2. 基金赎回款	-37,897,966,955.66	-	-	-37,897,966,955.66
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值	-	-	-657,011,771.15	-657,011,771.15

变动 (净值 减少以 “-”号 填列)				
(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)	28,376,948,890.74	-	-	28,376,948,890.74
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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)	-2,729,179,309.96	-	-	-2,729,179,309.96
(一)、 综合收	-	-	803,833,415.45	803,833,415.45

益总额				
(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)	-2,729,179,309.96	-	-	-2,729,179,309.96
其中: 1. 基金 申购款	37,874,967,068.71	-	-	37,874,967,068.71
2 . 基金赎 回款	-40,604,146,378.67	-	-	-40,604,146,378.67
(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)	-	-	-803,833,415.45	-803,833,415.45
(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)	30,214,594,561.22	-	-	30,214,594,561.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：



赵万里	曹华玮	邵恒
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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）《关于核准华富天益货币市场基金募集的批复》（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。

### 7.4.2 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。

### 7.4.3 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。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.5.1 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。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

###### 1) 自 2022 年 1 月 1 日起适用

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金目前暂无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

###### 2) 2022 年 1 月 1 日前适用

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

###### 1) 自 2022 年 1 月 1 日起适用

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和以摊余成本计量的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

###### 2) 2022 年 1 月 1 日前适用

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 1) 自 2022 年 1 月 1 日起适用

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。在考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息的基础上，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失，应当分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，按照未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。本基金确定金融工具在估值日只具有较低的信用风险的，可以假设该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加（即处于第一阶段）。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：

（1）收取金融资产现金流量的合同权利终止；（2）金融资产已转移，且已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；（3）金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对金融资产的控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

##### 2) 2022 年 1 月 1 日前适用

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收

款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：①收取该金融资产现金流量的合同权利终止；②该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者③该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

##### (1) 估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

- 1) 第一层次输入值是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；
- 2) 第二层次输入值是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，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；
- 3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据做出的财务预测等。

##### (2) 估值方法及关键假设

- 1) 根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告（2017）13号）规定，在下列情况下本基金采用的估值方法及关键假设如下：

① 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。

② 对不存在活跃市场的投资品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

③ 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，对估值进行调整并确定公允价值。

2) 对于发行时明确一定期限限售期的股票（包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），根据中国证券投资基金业协会《关于发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的通知》（中基协发〔2017〕6号），估值处理如下：

① 流通受限股票按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值： $FV=S \times (1-LoMD)$

其中：FV：估值日该流通受限股票的价值；S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值；LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣。

② 引入看跌期权计算该流通受限股票对应的流动性折扣。 $LoMD=P/S$ ，P 是估值日看跌期权的价格。

③ 证券投资基金持有的流通受限股票在估值日按平均价格亚式期权模型确定估值日看跌期权的价格。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比

例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认；

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后最后一位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以红利再投资形式分配。当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益，当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分配权益。“每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以各类基金份额的每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每日进行支付。

#### 7.4.4.12 分部报告

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

##### (1) 金融工具

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》, 公募基金证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

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 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

(2) 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。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

#### 7.4.6 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%

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	4,980,073.36	14,963,801.08
等于：本金	4,979,288.76	14,963,801.08
加：应计利息	784.60	-
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	5,779,404,837.55	4,400,000,000.00
等于：本金	5,750,000,000.00	4,400,000,000.00
加：应计利息	29,404,837.55	
减：坏账准备		
合计	5,784,384,910.91	4,414,963,801.08

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。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 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	11,984,301,647.64	11,978,603,884.73	-5,697,762.91	-0.0201
	合计	11,984,301,647.64	11,978,603,884.73	-5,697,762.91	-0.0201
资产支持证券		1,094,264,672.02	1,092,060,372.02	-2,204,300.00	-0.0078
合计		13,078,566,319.66	13,070,664,256.75	-7,902,062.91	-0.0278
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 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	12,981,505,542.67	12,986,321,000.00	4,815,457.33	0.0159
	合计	12,981,505,542.67	12,986,321,000.00	4,815,457.33	0.0159
资产支持证券		1,834,067,229.25	1,838,189,700.00	4,122,470.75	0.0136
合计		14,815,572,771.92	14,824,510,700.00	8,937,928.08	0.0296

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。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末和上年度末无衍生金融资产/负债。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,099,940,533.78	-
银行间市场	2,152,948,539.84	-
合计	9,252,889,073.62	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	9,400,000,000.00	-
银行间市场	1,327,042,643.57	-
合计	10,727,042,643.57	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末和上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
应计利息	-	83,923,717.44
合计	-	83,923,717.44

## 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 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	86,341.38	78,948.68
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	86,341.38	78,948.68
应付利息	-	-
应付审计费	40,000.00	40,000.00
中债账户维护费	4,500.00	4,500.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
上清账户维护费	4,800.00	4,800.00

合计	255,641.38	248,248.68
----	------------	------------

## 7.4.7.7 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 12 月 31 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	77,826,533.36	77,826,533.36
本期赎回（以“-”号填列）	-75,453,905.85	-75,453,905.85
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	10,280,724.74	10,280,724.74

## 华富天益货币 B

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	35,982,494,751.82	35,982,494,751.82
本期赎回（以“-”号填列）	-37,822,513,049.81	-37,822,513,049.81
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	28,366,668,166.00	28,366,668,166.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.8 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	105,267.17	-	105,267.17
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	-105,267.17	-	-105,267.17
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	656,906,503.98	-	656,906,503.98
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	-656,906,503.98	-	-656,906,503.98
本期末	-	-	-

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	58,600.87	190,949.11
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	147,032,037.12	194,509,267.31
结算备付金利息收入	4,098,602.30	4,085,021.13
其他	-	-
合计	151,189,240.29	198,785,237.55

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。其他为结算保证金利息收入。

## 7.4.7.10 股票投资收益

注：本基金本报告期内和上年度可比期间无股票投资收益

## 7.4.7.11 债券投资收益

## 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	283,246,442.44	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,363,748.08	90,537.84
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	284,610,190.52	90,537.84

7.4.7.11.2 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	36,932,244,673.81	42,487,523,860.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	36,800,668,319.81	42,386,026,480.92
减：应计利息总额	130,192,655.92	101,406,842.21
减：交易费用	19,950.00	-
买卖债券差价收入	1,363,748.08	90,537.84

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 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12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
资产支持证券投资收益——利息收入	52,306,333.98	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-	1,577,807.36
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	52,306,333.98	1,577,807.36

7.4.7.12.2 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	1,873,494,875.58	1,651,279,620.97
减：卖出资产支持证券成本总额	1,834,000,000.00	1,606,587,763.43
减：应计利息总额	39,494,875.58	43,114,050.18
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	1,577,807.36

#### 7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无

#### 7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期和上年度可比期间无衍生工具收益。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

#### 7.4.7.15 股利收益

注：本基金无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

注：注：本基金本报告期内和上年度期间无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	8,118.70	40,376.59
合计	8,118.70	40,376.59

注：其他所列金额为资产支持证券募集期利息收入。

#### 7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	100,712.55	105,689.77
账户维护费	36,930.00	36,300.00
交易费用	-	104.88
其他	-	900.00
合计	297,642.55	302,994.65

注：其他所列金额为上清所查询服务费。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告批准报出日，无重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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	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
安徽省信用融资担保集团有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰金融控股（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期内和上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本报告期内和上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本报告期内和上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。



### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本报告期内和上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期内和上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本报告期内和上年度可比期间内本基金无应付关联方佣金。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	49,409,013.87	50,006,390.06
其中：支付销售机构的客户维护费	1,067,664.28	637,338.25

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）。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	16,469,671.30	16,668,796.72

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  $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

### 7.4.10.2.3 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12月31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）	6,051.93	3,065,299.38	3,071,351.31
上海浦东发展银行股份有限公司（托管人）			
华安证券（管理人股东）	479.33	15,659.69	16,139.02

合计	6,531.26	3,080,959.07	3,087,490.33
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 12 月 31 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)	2,622.91	3,177,036.73
上海浦东发展银行股份有限公司 (托管人)	-	-	-
华安证券(管理人股东)	109.83	9,536.62	9,646.45
合计	2,732.74	3,186,573.35	3,189,306.09

注：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 类日基金销售服务费 = A 类前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数

B 类日基金销售服务费 = B 类前一日基金资产净值 × 0.01% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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

注：本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有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。

##### 7.4.10.4.2 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

注：本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
	华富天益货币 A	华富天益货币 B
基金合同生效日 ( 2017 年	0.00	0.00

1 月 25 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	82,382.92	0.00
报告期内申购/买入总份额	1,393.29	87,261,765.98
报告期内因拆分变动份额	412,425.23	-412,425.23
减: 报告期内赎回/卖出总份额	0.00	86,849,340.75
报告期末持有的基金份额	496,201.44	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%
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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
报告期内申购/买入总份额	10,578.81	25,081,804.40
报告期内因拆分变动份额	81,804.40	-81,804.40
减: 报告期内赎回/卖出总份额	10,000.29	25,000,000.00
报告期末持有的基金份额	82,382.92	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。

#### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位: 份

##### 华富天益货币 B

关联方名称	本期末 2022 年 12 月 31 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	22,056,044,630.00	77.7300	21,620,495,653.12	71.5600

上海华富利得资产管理有限公司	15,882,067.06	0.0600	0.00	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。

#### 7.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年12月 31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	4,980,073.36	58,600.87	14,963,801.08	190,949.11

注：注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

#### 7.4.10.7 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和上年度可比期间未参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 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
105,259.27	7.90	-	105,267.17	-
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
656,872,645.25	33,858.73	-	656,906,503.98	-

#### 7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金没有因认购新发/增发证券而于本报告期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	200,000,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	2,717,266,714.16	1,260,000,308.96
合计	2,717,266,714.16	1,460,000,308.96

## 7.4.13.2.2 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,094,264,672.02	1,834,067,229.25
合计	1,094,264,672.02	1,834,067,229.25

## 7.4.13.2.3 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	7,674,233,689.69	9,719,990,039.65
合计	7,674,233,689.69	9,719,990,039.65

## 7.4.13.2.4 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	2,667,227,262.11	1,460,000,308.96
AAA 以下	50,039,452.05	-
未评级	-	-
合计	2,717,266,714.16	1,460,000,308.96

## 7.4.13.2.5 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	1,094,264,672.02	1,834,067,229.25
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	1,094,264,672.02	1,834,067,229.25

## 7.4.13.2.6 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	6,675,099,344.17	9,719,990,039.65
AAA 以下	999,134,345.52	-
未评级	-	-
合计	7,674,233,689.69	9,719,990,039.65

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。本基金以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制以确保按摊余成本计算的基金资产净值近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 2 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	2,519,242,991.73	2,361,936,557.69	903,205,361.49	-	-		-5,784,384,910.91

结算备付金	263,766,863.68	-	-	-	-	263,766,863.68
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	1,815,962,610.58	6,712,566,659.14	4,550,037,049.94	-	-	13,078,566,319.66
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	9,252,889,073.62	-	-	-	-	9,252,889,073.62
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
应	-	-	-	-	3,262,724.66	3,262,724.66



收清算款							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,851,861,539.61	9,074,503,216.83	5,453,242,411.43	-	-	3,262,724.66	28,382,869,892.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,845,836.31	3,845,836.31
应付托管费	-	-	-	-	-	1,281,945.43	1,281,945.43
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-

应付销售服务费	-	-	-	-	259,259.85	259,259.85
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	278,318.82	278,318.82
其他负债	-	-	-	-	255,641.38	255,641.38
负债总计	-	-	-	-	5,921,001.79	5,921,001.79
利率敏感度缺口	13,851,861,539.61	9,074,503,216.83	5,453,242,411.43	-	2,658,277.13	-28,376,948,890.74
上年度末 2021 年 12 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

月 31 日						
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	-	-	-	-	8,433,010.61	8,433,010.61

证券清算款							
其他资产	-	-	-	-	-	83,923,717.44	83,923,717.44
资产总计	13,830,089,440.83	8,226,234,539.05	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。

#### 7.4.13.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25	-10,163,680.85	-8,142,546.20

	基点		
	市场利率下降 25 基点	10, 108, 096. 94	8, 154, 583. 85

#### 7. 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。

#### 7. 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。

##### 7. 4. 13. 4. 3. 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。

##### 7. 4. 13. 4. 3. 2 其他价格风险的敏感性分析

注：本期及上期末股票类权益资产占基金资产净值的比例为 0%，因此若除利率和汇率外的其他市场因素变化导致本基金持有的权益性工具的公允价值变动 5%而其他市场变量保持不变，则本基金资产净值不会发生重大变动。

#### 7. 4. 13. 4. 4 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 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	合计	116, 251, 064. 87	542, 829, 852. 80

#### 7. 4. 14 公允价值

##### 7. 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	13,078,566,319.66	14,815,572,771.92
第三层次	-	-
合计	13,078,566,319.66	14,815,572,771.92

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。  
本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金本报告期无第三层次公允价值余额及变动

###### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：本基金本报告期无第三层次公允价值余额及变动

##### 7.4.14.3 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未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	13,078,566,319.66	46.08
	其中：债券	11,984,301,647.64	42.22
	资产支持证 券	1,094,264,672.02	3.86
2	买入返售金融资产	9,252,889,073.62	32.60
	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	6,048,151,774.59	21.31
4	其他各项资产	3,262,724.66	0.01
5	合计	28,382,869,892.53	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 8.9.3 其他各项资产构成。

## 8.2 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	0.86	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

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

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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	49
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	46

### 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。

### 8.3.2 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	48.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天	-	-



	的浮动利率债		
2	30 天（含）—60 天	15.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	16.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	9.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	10.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.74	-

#### 8.4 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。

#### 8.5 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	459,057,199.15	1.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,133,744,044.64	4.00
	其中：政策性金融债	1,133,744,044.64	4.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,717,266,714.16	9.58
6	中期票据	-	-
7	同业存单	7,674,233,689.69	27.04
8	其他	-	-
9	合计	11,984,301,647.64	42.23
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 8.6 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	220201	22 国开 01	6,300,000	642,776,005.19	2.27
2	112211098	22 平安银行 CD098	5,000,000	501,331,666.67	1.77
3	112215527	22 民生银行 CD527	5,000,000	494,887,407.13	1.74
4	112284507	22 江西银行 CD127	3,000,000	299,488,691.11	1.06
5	112270089	22 南洋商业 银行 CD066	3,000,000	299,459,364.24	1.06
6	112284902	22 厦门银行 CD104	3,000,000	299,411,490.69	1.06
7	112215408	22 民生银行 CD408	3,000,000	298,912,047.44	1.05
8	112215356	22 民生银行 CD356	3,000,000	296,308,660.91	1.04
9	112203093	22 农业银行 CD093	2,810,000	279,864,506.96	0.99
10	229945	22 贴现国债 45	2,400,000	239,373,213.25	0.84

### 8.7 “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	0.0608%
报告期内偏离度的最低值	-0.0747%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0344%

#### 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%。

### 8.8 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	136908	链融 55A1	1,000,000	102,199,232.88	0.36
2	180243	至信 11 优	900,000	90,491,789.59	0.32
3	136922	22 中交 4A	800,000	81,996,273.98	0.29
4	136961	鹏睿 01A	700,000	71,436,453.70	0.25
5	135163	行知优 01	690,000	69,907,367.02	0.25

6	180600	中诺 1 优	620,000	62,467,680.44	0.22
7	136929	恒煦 05A1	600,000	61,239,346.85	0.22
8	135146	瑞新 34A1	600,000	60,870,522.74	0.21
9	135162	鹏睿 02A	600,000	60,808,924.93	0.21
10	180242	至信 7 优	600,000	60,423,872.87	0.21

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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。

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

### 8.9.2 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，江西银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、南洋商业银行(中国)有限公司、国家开发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。

### 8.9.3 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	3,262,724.66
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	3,262,724.66

### 8.9.4 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	160	64,254.53	10,156,718.98	98.79	124,005.76	1.21
华富天益货币 B	51	556,209,179.73	28,366,668,166.00	100.00	0.00	0.00
合计	211	134,487,909.43	28,376,824,884.98	100.00	124,005.76	0.00

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

## 9.2 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	22,056,044,630.00	77.73
2	银行类机构	1,009,839,539.66	3.56
3	银行类机构	887,508,110.85	3.13
4	银行类机构	868,265,137.74	3.06
5	证券类机构	420,865,544.91	1.48
6	银行类机构	327,848,353.32	1.16
7	银行类机构	208,938,566.50	0.74
8	银行类机构	207,783,473.52	0.73
9	银行类机构	202,877,654.93	0.71
10	银行类机构	201,436,743.79	0.71

## 9.3 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

## 9.4 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
--	----	--	---

## § 10 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	79,724.31	200,018,886.26
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	77,826,533.36	35,982,494,751.82
减：本报告期基金总 赎回份额	75,453,905.85	37,822,513,049.81
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	10,280,724.74	28,366,668,166.00

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 11.2 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

- 2022 年 1 月 20 日，因华富中债-0-5 年中高等级信用债收益平衡指数证券投资基金清盘，张娅女士和郜哲先生不再担任华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 2022 年 3 月 9 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘尤之奇先生为华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金基金经理。
- 2022 年 3 月 30 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘陈奇先生为华富时代锐选混合型证券投资基金基金经理。
- 2022 年 4 月 26 日，因华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金清盘，姚姣女士不再担任华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 2022 年 6 月 7 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘倪莉莎女士为华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理。

6. 2022 年 6 月 29 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作安排, 张娅女士不再担任华富新能源股票型发起式证券投资基金基金经理的职务。

7. 2022 年 6 月 29 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作安排, 郜哲先生不再担任华富新能源股票型发起式证券投资基金基金经理的职务。

8. 2022 年 7 月 11 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作需要, 增聘姚姣女士为华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

9. 2022 年 8 月 19 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作需要, 增聘沈成先生为华富科技动能混合型证券投资基金基金经理。

10. 2022 年 8 月 19 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作需要, 增聘陈奇先生为华富竞争力优选混合型证券投资基金基金经理。

11. 2022 年 8 月 19 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作需要, 增聘王羿伟先生为华富国潮优选混合型发起式证券投资基金基金经理。

12. 2022 年 8 月 19 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作安排, 龚炜先生不再担任华富科技动能混合型证券投资基金、华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富国潮优选混合型发起式证券投资基金基金经理的职务。

13. 2022 年 8 月 24 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作安排, 倪莉莎女士不再担任华富天盈货币市场基金基金经理的职务。

14. 2022 年 8 月 25 日, 华富基金管理有限公司第七届董事会第二次会议审议通过, 因工作需要, 聘任李宏升先生担任公司财务负责人, 龚炜先生不再担任公司副总经理。

15. 2022 年 9 月 1 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作需要, 增聘李孝华先生为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

16. 2022 年 9 月 1 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作安排, 姚姣女士不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

17. 2022 年 9 月 19 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作需要, 增聘戴弘毅先生为华富安鑫债券型证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金的基金经理。

18. 2022 年 10 月 14 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作需要, 增聘王羿伟先生为华富竞争力优选混合型证券投资基金基金经理。

19. 经上海浦东发展银行股份有限公司决定, 总行资产托管部原总经理孔建同志自 2022 年 11 月 7 日起不再担任资产托管部总经理职务, 由李国光同志担任部门负责人。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 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。本基金本年度需支付给审计机构天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 4 万元人民币。天健会计师事务所（特殊普通合伙）从 2012 年起为本公司提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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。

#### 11.7.2 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	-	-	607,000,000,000.00	100.00	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：无

### 11.9 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	华富天益货币市场基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 01 月 21 日
2	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	中国证监会指定披露媒介	2022 年 01 月 25 日
3	华富基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 03 月 01 日
4	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	中国证监会指定披露媒介	2022 年 03 月 29 日
5	华富天益货币市场基金 2021 年度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 03 月 31 日
6	华富天益货币市场基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 04 月 22 日
7	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	中国证监会指定披露媒介	2022 年 04 月 23 日
8	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	中国证监会指定披露媒介	2022 年 05 月 28 日
9	华富基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 07 月 14 日
10	华富天益货币市场基金 2022 年第 2 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 07 月 20 日
11	华富天益货币市场基金更新招募说明书	中国证监会指定披露媒介	2022 年 08 月 09 日
12	华富基金管理有限公司关于调整华富天益货币市场基金 A 类基金份额申购、赎回、转换、定投及最低持有份额的数量限制的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 08 月 09 日
13	华富天益货币市场基金 2022 年中期报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 08 月 31 日
14	华富基金管理有限公司关于网上直销平台费率优惠的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 09 月 01 日



15	华富天益货币市场基金“中秋节”假期前暂停申购及转入业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022年09月06日
16	华富天益货币市场基金“国庆节”假期前暂停申购及转入业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022年09月27日
17	华富基金管理有限公司关于网上直销平台费率优惠的公告	中国证监会指定披露媒介	2022年10月18日
18	华富天益货币市场基金 2022 年第 3 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2022年10月26日
19	华富天益货币市场基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2022年11月29日
20	华富天益货币市场基金更新招募说明书	中国证监会指定披露媒介	2022年11月29日
21	华富天益货币市场基金(B类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2022年11月29日
22	华富天益货币市场基金“元旦”假期前暂停申购及转入业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022年12月27日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	2022.1.1-2022.12.31	21,620,495,653.12	435,548,976.88	0.00	22,056,044,630.00	77.7300
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无
---

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 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

2023 年 3 月 31 日