

华富天益货币市场基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 30 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 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 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 | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 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 | 20 |
| §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 | 43 |
| 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 | 46 |
| §8 基金份额持有人信息 | 47 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 47 |
| 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 | 48 |
| §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 | 49 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 49 |
| 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 | 49 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 49 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 | 51 |
| 10.9 其他重大事件 | 51 |
| §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 | 52 |
| §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 | 26,180,608,440.37 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 | 31,021,469.52 份 | 26,149,586,970.85 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 | 上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋 |
| 邮政编码 | 200120 | 200126 |
| 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) | |
|---------------|-------------------------------------|----------------|
| | 华富天益货币 A | 华富天益货币 B |
| 本期已实现收益 | 76,517.90 | 330,552,791.45 |
| 本期利润 | 76,517.90 | 330,552,791.45 |
| 本期净值收益率 | 0.9580% | 1.0764% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) | |
| | 期末基金资产净值 | 31,021,469.52 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) | |
| | 累计净值收益率 | 17.1884% |

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 | 0.1551% | 0.0008% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0441% | 0.0008% |
| 过去三个月 | 0.4880% | 0.0008% | 0.3366% | 0.0000% | 0.1514% | 0.0008% |
| 过去六个月 | 0.9580% | 0.0007% | 0.6695% | 0.0000% | 0.2885% | 0.0007% |
| 过去一年 | 1.7687% | 0.0009% | 1.3500% | 0.0000% | 0.4187% | 0.0009% |
| 过去三年 | 6.1335% | 0.0011% | 4.0500% | 0.0000% | 2.0835% | 0.0011% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.1884% | 0.0021% | 8.6844% | 0.0000% | 8.5040% | 0.0021% |

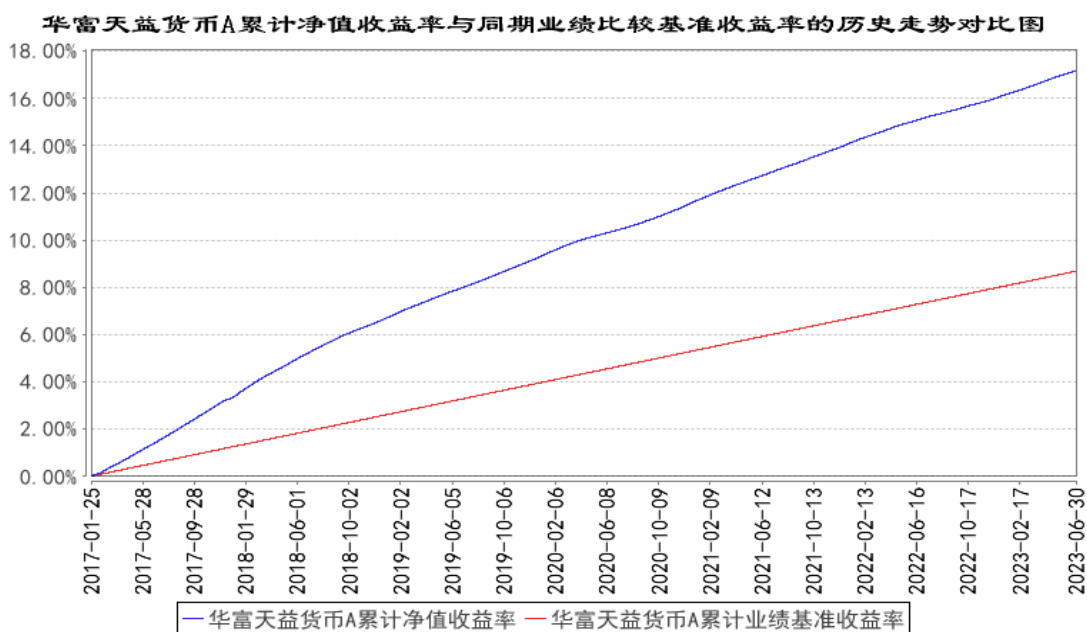
华富天益货币 B

| 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 | 0.1722% | 0.0006% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0612% | 0.0006% |
| 过去三个月 | 0.5459% | 0.0007% | 0.3366% | 0.0000% | 0.2093% | 0.0007% |

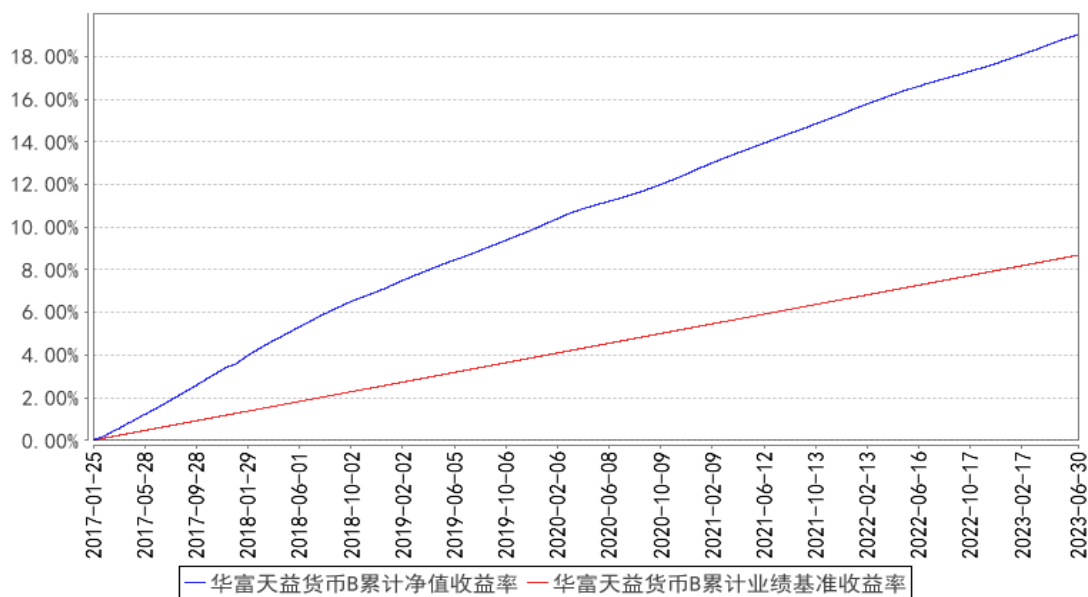
| | | | | | | |
|------------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去六个月 | 1.0764% | 0.0007% | 0.6695% | 0.0000% | 0.4069% | 0.0007% |
| 过去一年 | 2.0128% | 0.0009% | 1.3500% | 0.0000% | 0.6628% | 0.0009% |
| 过去三年 | 6.9237% | 0.0011% | 4.0500% | 0.0000% | 2.8737% | 0.0011% |
| 自基金合同生效起至今 | 19.0451% | 0.0021% | 8.6844% | 0.0000% | 10.3607% | 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 2023 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

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、华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富时代锐选混合型证券投资基金、华富匠心领航 18 个月持有期混合型证券投资基金、华富数字经济混合型证券投资基金共六十只基金。

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 | | |
| 姚姣姣 | 本基金的基金经理 | 2017 年 1 月 25 日 | - | 十一年 | 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 日起任华富恒稳纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2017 年 1 月 25 日起任华富天益货币市场基金基金经理，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

2023 年上半年世界经济复苏乏力，全球通胀水平仍然较高，主要经济体货币政策紧缩外溢效应突出，在复杂严峻的外部环境下，我国经济增长整体回升，增速快于主要发达国家，彰显出我国经济发展的强大韧性。但是同时国内经济也面临着后续动能不足的挑战。2023 年是我国疫后复苏的第一年，一季度经济恢复好于预期，但是二季度经济增长动能明显减弱。主要原因在于，首先，积压需求在一季度基本释放充分，其次，房地产市场预期转弱抑制了商品房销售与房地产投资，最后，居民消费信心恢复仍然缓慢。二季度社会消费品零售总额两年平均增速仅 2.8%，远低于疫情前 8% 的水平。

而上半年的政策整体基调为“重托底，不刺激”，重点强调高质量发展，不搞大水漫灌强刺

激。从财政政策来看，3月初两会确立 5% 的增长目标，处于市场预期下缘，强刺激预期被证伪；从地产政策来看，因城施策的政策基调保持定力，地产相关政策更侧重于防风险，例如出台保交楼贷款支持计划、住房租赁贷款支持计划、民企债券融资支持工具等，主要重点支持房地产市场平稳运行；从货币政策来看，央行通过降准、降息等方式保障流动性合理充裕。3月17日，央行降准 25bp，释放中长期流动性；6月份，央行依次下调 7 天 OMO 利率、SLF 利率、MLF 利率和 LPR，下调幅度均为 10bp。

2023 年的资金面整体来说是比较友好的，总量相对宽松，价格平稳。从资金量来看，央行通过续作逆回购、超量续作 MLF 等方式呵护流动性。今年以来，央行逆回购操作相比往年更加频繁，临近跨月、跨季逆回购存量高于往年同期，跨月、跨季资金量相对充裕且上半年 MLF 连续超额续作也保证了总量充裕。上半年资金价格波动放大，春节后资金价格波动较大，流动性“先紧后松”，节后至 2 月底，由于信贷放量消耗超储且央行“长钱”投放较少，资金价格不断抬升；3 月央行呵护流动性，通过超量续作 MLF、降准 25bp 等方式引导资金价格回归政策利率，资金价格中枢回落；4 月中下旬税期+跨季，资金价格波动加大，但价格中枢有所回落，税期平稳度过；5 月资金价格明显回落；6 月跨季资金面趋紧，资金价格中枢、波动率均有所上升，但依然处在可控范围。

短端资产市场表现以同业存单为锚，自 2022 年 12 月中旬同业存单收益率触顶后，同业存单收益率水平在一季度呈现宽幅区间震荡走势，低点在 2.4% 左右，高点在 2.75% 左右。而进入二季度以来，随着货币政策宽松基调的确立，同业存单收益率一路下行，在 6 月中心降息后破 2022 年 12 月以来的新低，最低达到 2.26%。

本基金在上半年货币市场整体偏宽松市场环境下合理安排现金流，在保证流动性和安全性的前提下，适当兼顾收益率。

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 份额净值增长率为 0.9580%，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 份额净值增长率为 1.0764%，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，在降息政策之后资金利率普遍易松难紧。4 月开始基本面环比走弱，5-6 月延续这种复苏动力不足的情景，下半年基本面面临边际降速风险依然还在，本次降息极有可能是对去年四季度阶段性紧货币结束后的宽松重启。下半年大概率资金面依然整体偏松，资金利率预计先下后上，尤其是 7-8 月可能将是资金利率的年内低点，同业存单仍在下行半途，这一市场环境可

能进一步加大资金在月内、季内的配置需求和月末、季末的时点需求之间的规模大比例波动，这是货币基金下半年要保持警惕的地方。

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、督察长、副总经理、基金运营部负责人、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 76,517.90 元，B 级应分配收益 330,552,791.45 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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或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、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华富天益货币市场基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 4,173,178,752.24 | 5,784,384,910.91 |
| 结算备付金 | | 172,077,400.00 | 263,766,863.68 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 11,712,345,593.53 | 13,078,566,319.66 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 11,357,813,514.62 | 11,984,301,647.64 |
| 资产支持证券投资 | | 354,532,078.91 | 1,094,264,672.02 |
| 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 | 10,396,268,472.19 | 9,252,889,073.62 |
| 应收清算款 | | - | 3,262,724.66 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 32,500,000.00 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 26,486,370,217.96 | 28,382,869,892.53 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 300,024,424.20 | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |

| | | | |
|-------------|---------|-------------------|-------------------|
| 应付管理人报酬 | | 3,854,147.02 | 3,845,836.31 |
| 应付托管费 | | 1,284,715.67 | 1,281,945.43 |
| 应付销售服务费 | | 257,689.48 | 259,259.85 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 86,900.43 | 278,318.82 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 253,900.79 | 255,641.38 |
| 负债合计 | | 305,761,777.59 | 5,921,001.79 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 26,180,608,440.37 | 28,376,948,890.74 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | - | - |
| 净资产合计 | | 26,180,608,440.37 | 28,376,948,890.74 |
| 负债和净资产总计 | | 26,486,370,217.96 | 28,382,869,892.53 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 26,180,608,440.37 份，其中华富天益货币 A 基金份额总额 31,021,469.52 份，基金份额净值 1.0000 元；华富天益货币 B 基金份额总额 26,149,586,970.85 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 365,985,703.00 | 396,384,109.36 |
| 1. 利息收入 | | 199,711,448.05 | 220,503,526.79 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 78,227,812.90 | 87,051,958.20 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 121,483,635.15 | 133,451,568.59 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 166,274,254.95 | 175,872,463.87 |
| 其中：股票投资收益 | | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 155,514,930.29 | 148,984,588.92 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.12 | 10,759,994.41 | 26,887,874.95 |

| | | | |
|-------------------------------------|----------|----------------|----------------|
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | -669.75 | - |
| 3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | - | - |
| 4. 汇兑收益（损失以“- ”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“- ”号填列） | 6.4.7.17 | - | 8,118.70 |
| 减：二、营业总支出 | | 35,356,393.65 | 37,419,782.81 |
| 1. 管理人报酬 | | 23,074,687.91 | 24,816,270.88 |
| 2. 托管费 | | 7,691,562.64 | 8,272,090.28 |
| 3. 销售服务费 | | 1,547,453.91 | 1,659,862.06 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 2,827,277.27 | 2,419,665.01 |
| 其中：卖出回购金融资产 支出 | | 2,827,277.27 | 2,419,665.01 |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 64,673.36 | 103,397.31 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.19 | 150,738.56 | 148,497.27 |
| 三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列） | | 330,629,309.35 | 358,964,326.55 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以 “-”号填列） | | 330,629,309.35 | 358,964,326.55 |
| 五、其他综合收益的税后 净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 330,629,309.35 | 358,964,326.55 |

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：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | | |
|--------|----------------------------|--------|-------|-------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末 | 28,376,948,890.74 | - | - | 28,376,948,890.74 |

| | | | | |
|---|--------------------|---|-----------------|--------------------|
| 净资产 (基金 净值) | | | | |
| 加：会 计政策 变更 | - | - | - | - |
| 前期 差错 更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本 期期初 净资产 (基金 净值) | 28,376,948,890.74 | - | - | 28,376,948,890.74 |
| 三、本 期增减 变动额 (减少 以“-” 号填 列) | -2,196,340,450.37 | - | - | -2,196,340,450.37 |
| (一)、 综合收 益总额 | - | - | 330,629,309.35 | 330,629,309.35 |
| (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) | -2,196,340,450.37 | - | - | -2,196,340,450.37 |
| 其中： 1. 基金 申购款 | 23,971,065,597.66 | - | - | 23,971,065,597.66 |
| 2 . 基金 赎回款 | -26,167,406,048.03 | - | - | -26,167,406,048.03 |
| (三)、 本期向 | - | - | -330,629,309.35 | -330,629,309.35 |

| | | | | |
|-----------------------------------|--|--------|-------|-------------------|
| 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） | | | | |
| （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） | 26,180,608,440.37 | - | - | 26,180,608,440.37 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 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 | -124,429,508.84 | - | - | -124,429,508.84 |

| | | | | |
|--|--------------------|---|-----------------|--------------------|
| (减少以“-”号填列) | | | | |
| (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、本期期末净资产 | 30,090,165,052.38 | - | - | 30,090,165,052.38 |

| | | | | |
|--------|--|--|--|--|
| (基金净值) | | | | |
|--------|--|--|--|--|

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：

| | | |
|------------|------------|-----------|
| <u>赵万里</u> | <u>曹华玮</u> | <u>邵恒</u> |
| 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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

本报告期本基金会计政策无变更。

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。

(五) 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 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 261,216,807.52 |
| 等于：本金 | 261,213,793.46 |
| 加：应计利息 | 3,014.06 |
| 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 | 3,911,961,944.72 |
| 等于：本金 | 3,900,000,000.00 |
| 加：应计利息 | 11,961,944.72 |
| 减：坏账准备 | — |
| 合计 | 4,173,178,752.24 |

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 2023 年 6 月 30 日 | | | |
|----|------------------------|------|------|---------|
| | 按实际利率计算的账面价值 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 (%) |
| | | | | |

| | | | | | |
|--------|-------|-------------------|-------------------|--------------|---------|
| 债券 | 交易所市场 | 100,069,041.10 | 99,959,041.10 | -110,000.00 | -0.0004 |
| | 银行间市场 | 11,257,744,473.52 | 11,262,496,247.76 | 4,751,774.24 | 0.0181 |
| | 合计 | 11,357,813,514.62 | 11,362,455,288.86 | 4,641,774.24 | 0.0177 |
| 资产支持证券 | | 354,532,078.91 | 354,605,878.91 | 73,800.00 | 0.0003 |
| 合计 | | 11,712,345,593.53 | 11,717,061,167.77 | 4,715,574.24 | 0.0180 |

注：1) 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2) 偏离度=偏离金额/摊余成本确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/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 2023年6月30日 | |
|-------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 8,602,908,985.44 | - |
| 银行间市场 | 1,793,359,486.75 | - |
| 合计 | 10,396,268,472.19 | - |

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 2023年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 165,257.63 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 165,257.63 |
| 应付利息 | - |
| 应付审计费 | 19,835.79 |
| 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 | 253,900.79 |
|----|------------|

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 10,280,724.74 | 10,280,724.74 |
| 本期申购 | 54,200,840.39 | 54,200,840.39 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -33,460,095.61 | -33,460,095.61 |
| 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 | 31,021,469.52 | 31,021,469.52 |

华富天益货币 B

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|--------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 28,366,668,166.00 | 28,366,668,166.00 |
| 本期申购 | 23,916,864,757.27 | 23,916,864,757.27 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -26,133,945,952.42 | -26,133,945,952.42 |
| 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 | 26,149,586,970.85 | 26,149,586,970.85 |

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 |
|----------------|-----------|-------|-----------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期利润 | 76,517.90 | - | 76,517.90 |
| 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 | -76,517.90 | - | -76,517.90 |
| 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 |
|----------------|-----------------|-------|-----------------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期利润 | 330,552,791.45 | - | 330,552,791.45 |
| 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 | -330,552,791.45 | - | -330,552,791.45 |
| 本期末 | - | - | - |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 31,656.88 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 76,607,246.07 |
| 结算备付金利息收入 | 1,588,909.95 |
| 其他 | - |
| 合计 | 78,227,812.90 |

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。

6.4.7.10 股票投资收益

注：无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 155,301,592.10 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 213,338.19 |
| 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 | 155,514,930.29 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 23,308,046,735.55 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 23,239,229,673.47 |
| 减：应计利息总额 | 68,578,998.89 |
| 减：交易费用 | 24,725.00 |
| 买卖债券差价收入 | 213,338.19 |

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|--------------------------|----------------------------|
| 资产支持证券投资收益——利息收入 | 10,759,994.41 |
| 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 | 10,759,994.41 |

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额 | 854,252,280.57 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 836,000,000.00 |
| 减：应计利息总额 | 18,252,280.57 |
| 减：交易费用 | - |
| 资产支持证券投资收益 | - |

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

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

注：本基金本报告期内无其他收入。

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 2023年1月1日至2023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 | 53,815.40 |
| 账户维护费 | 17,580.00 |
| 合计 | 150,738.56 |

6.4.7.20 分部报告

无。

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 | 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 |
| 上海华富利得资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |

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：本基金本报告期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|-------|----------------------------|---------------------------|---------------------------------|---------------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) |
| 华安证券 | 60,200,000,000.00 | 28.28 | - | - |

注：本表中“当期债券回购成交总额”为当期通过交易单元进行的交易所债券回购成交总额。

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无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6 月30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 23,074,687.91 | 24,816,270.88 |
| 其中：支付销售机构的客户维护 | 615,449.54 | 534,220.49 |

| | | |
|---|--|--|
| 费 | | |
|---|--|--|

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 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （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 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 7,691,562.64 | 8,272,090.28 |

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|---------------------------------|--------------|--------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 华富天益货币 A | 华富天益货币 B | 合计 |
| 华富基金管理有限公司 | 2,270.38 | 1,399,419.48 | 1,401,689.86 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 3.62 | 16,094.64 | 16,098.26 |
| 华安证券 | 11.5 | 13,139.24 | 13,150.74 |
| 合计 | 2,285.50 | 1,428,653.36 | 1,430,938.86 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 华富天益货币 A | 华富天益货币 B | 合计 |
| 华富基金管理有限公司 | 2,389.04 | 1,528,303.24 | 1,530,692.28 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | - | - | - |
| 华安证券 | 5.78 | 6,532.80 | 6,538.58 |
| 合计 | 2,394.82 | 1,534,836.04 | 1,537,230.86 |

注：本基金 A 类按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率每日计提，B 类按前一日基金资产净值的 0.01% 年费率每日计提，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 × 年销售服务费率 / 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 × 年销售服务费率 / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | | | | | |
|--|--------|------|-------|------|------------|-----------|
| 银行间市场交易的 各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 上海浦东发展银行 (托管人) | - | - | - | - | 700,000.00 | 27,260.27 |
| 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的 各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| - | - | - | - | - | - | - |

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未发生转融通证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 | 496,201.44 | 0.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 1,384.93 | 33,608,505.23 |
| 报告期间因拆分变动份额 | 0.00 | 0.00 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 497,586.37 | 33,608,505.23 |
| 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 | 0.0000% | 0.0000% |

| 占基金总份额比例 | | |
|---------------------------------|---|---|
| 项目 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| | 华富天益货币 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 |
| 报告期内申购/买入总份额 | 412.39 | 39,202,651.19 |
| 报告期内因拆分变动份额 | -82,795.31 | 82,795.31 |
| 减：报告期内赎回/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% |

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。

6.4.10.5.2 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 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | |
|----------------|------------------------|------------------------------|--------------------------|------------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%) | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%) |
| 上海华富利得资产管理有限公司 | 8,412,276.35 | 0.0300 | 15,882,067.06 | 0.0600 |
| 上海浦东发展银行总行 | 19,274,655,994.21 | 73.6200 | 22,056,044,630.00 | 77.7300 |

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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-------|--|--|
| | | |

| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
|----------------|----------------|-----------|---------------|-----------|
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 261,216,807.52 | 31,656.88 | 17,248,167.03 | 45,421.44 |

注：本表仅列示活期存款余额及产生的利息收入。

6.4.10.7 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及上年度可比期间内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 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 |
| 76,517.90 | - | - | 76,517.90 | - |
| 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 |
| 330,552,791.45 | - | - | 330,552,791.45 | - |

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 300,024,424.20 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|--------|----------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 220211 | 22 国开 11 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.58 | 2,400,000 | 243,792,483.86 |
| 230201 | 23 国开 01 | 2023 年 7 月 3 日 | 100.84 | 784,000 | 79,056,165.05 |
| 合计 | | | | 3,184,000 | 322,848,648.91 |

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市场债券正回购余额。

6.4.12.4 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。

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发行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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 1,737,231,550.22 | 2,717,266,714.16 |
| 合计 | 1,737,231,550.22 | 2,717,266,714.16 |

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 | 上年度末 |
|--------|-----|------|
|--------|-----|------|

| | 2023 年 6 月 30 日 | 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-----------------|------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 354,532,078.91 | 1,094,264,672.02 |
| 合计 | 354,532,078.91 | 1,094,264,672.02 |

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 8,083,335,856.91 | 7,674,233,689.69 |
| 合计 | 8,083,335,856.91 | 7,674,233,689.69 |

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 1,575,922,182.35 | 2,667,227,262.11 |
| AAA 以下 | 261,378,408.97 | 50,039,452.05 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 1,837,300,591.32 | 2,717,266,714.16 |

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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 354,532,078.91 | 1,094,264,672.02 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 354,532,078.91 | 1,094,264,672.02 |

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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 7,684,201,705.80 | 6,675,099,344.17 |
| AAA 以下 | 399,134,151.11 | 999,134,345.52 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 8,083,335,856.91 | 7,674,233,689.69 |

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银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所交易。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。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天。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，正回购余额在每个交易日均不超过基金资产净值的 20%。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本 期 末 202 3 年 6 月 30 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|----------------|------------------|------------------|-------|-------|-----|------------------|
| 资 产 | | | | | | | |
| 银 行 存 款 | 261,216,807.52 | 1,103,647,944.31 | 2,808,314,000.41 | | | | 4,173,178,752.24 |
| 结 | 172,077,400.00 | | | | | | 172,077,400.00 |

| | | | | | | |
|--------------------------------------|-------------------|------------------|------------------|--|---------------|-------------------|
| 算 备 付 金 | | | | | | |
| 存 出 保 证 金 | - | | | | | - |
| 交 易 性 金 融 资 产 | 1,791,862,476.63 | 5,071,222,243.98 | 4,849,260,872.92 | | | 11,712,345,593.53 |
| 衍 生 金 融 资 产 | | | | | | - |
| 买 入 返 售 金 融 资 产 | 10,396,268,472.19 | - | | | | 10,396,268,472.19 |
| 债 权 投 资 | | | | | | - |
| 应 收 股 利 | | | | | | - |
| 应 收 申 购 款 | | | | | 32,500,000.00 | 32,500,000.00 |
| 应 收 | | | | | | - |

| | | | | | | | |
|-----------|-------------------|------------------|------------------|---|---|---------------|-------------------|
| 清算款 | | | | | | | |
| 其他资产 | | | | | | | - |
| 资产总计 | 12,621,425,156.34 | 6,174,870,188.29 | 7,657,574,873.33 | - | - | 32,500,000.00 | 26,486,370,217.96 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 3,854,147.02 | 3,854,147.02 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 1,284,715.67 | 1,284,715.67 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 300,024,424.20 | - | - | - | - | - | 300,024,424.20 |
| 应 | - | - | - | - | - | 257,689.48 | 257,689.48 |

| | | | | | | | |
|------------------|-------------------|------------------|------------------|------|------|---------------|-------------------|
| 付销售服务费 | | | | | | | |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 86,900.43 | 86,900.43 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 253,900.79 | 253,900.79 |
| 负债总计 | 300,024,424.20 | - | - | - | - | 5,737,353.39 | 305,761,777.59 |
| 利率敏感度缺口 | 12,321,400,732.14 | 6,174,870,188.29 | 7,657,574,873.33 | - | - | 26,762,646.61 | 26,180,608,440.37 |
| 上年度末 2022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 |

| | | | | | | |
|----------|------------------|------------------|------------------|---|---|-------------------|
| 31 日 | | | | | | |
| 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 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 3,262,724.66 | 3,262,724.66 |
| 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 |

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

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（2023年6月30日） | 上年度末（2022年12月31日） |
| 分析 | 市场利率上升 25 基点 | -7,442,733.10 | -10,163,680.85 |
| | 市场利率下降 25 基点 | 7,456,849.32 | 10,108,096.94 |

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 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。

6.4.13.4.3.2 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。

6.4.13.4.4 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（2023年6月30日） | 上年度末（2022年12月31日） |

| | | | |
|--|----|---------------|----------------|
| | 合计 | 72,622,984.38 | 116,251,064.87 |
|--|----|---------------|----------------|

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 11,712,345,593.53 | 13,078,566,319.66 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 11,712,345,593.53 | 13,078,566,319.66 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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 | 11,712,345,593.53 | 44.22 |
| | 其中：债券 | 11,357,813,514.62 | 42.88 |
| | 资产支持证 券 | 354,532,078.91 | 1.34 |
| 2 | 买入返售金融资产 | 10,396,268,472.19 | 39.25 |
| | 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 | 4,345,256,152.24 | 16.41 |
| 4 | 其他各项资产 | 32,500,000.00 | 0.12 |
| 5 | 合计 | 26,486,370,217.96 | 100.00 |

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例 (%) | |
|----|--------------|----------------|--------------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 1.26 | |
| | 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 | 300,024,424.20 | 1.15 |
| | 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%。

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 | 60 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 61 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 41 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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 | 48.17 | 1.15 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 12.82 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 9.57 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 10.67 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 19.65 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 100.87 | 1.15 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,437,177,066.39 | 5.49 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,437,177,066.39 | 5.49 |
| 4 | 企业债券 | 100,069,041.10 | 0.38 |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,737,231,550.22 | 6.64 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 8,083,335,856.91 | 30.88 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 11,357,813,514.62 | 43.38 |
| 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 | 230201 | 23 国开 01 | 6,300,000 | 635,272,754.88 | 2.43 |
| 2 | 112211098 | 22 平安银行 CD098 | 5,000,000 | 501,700,000.00 | 1.92 |
| 3 | 112303051 | 23 农业银行 CD051 | 3,000,000 | 299,800,673.23 | 1.15 |
| 4 | 112215356 | 22 民生银行 CD356 | 3,000,000 | 299,356,212.27 | 1.14 |
| 5 | 112206227 | 22 交通银行 CD227 | 3,000,000 | 299,192,697.02 | 1.14 |
| 6 | 112303005 | 23 农业银行 CD005 | 3,000,000 | 299,094,380.39 | 1.14 |
| 7 | 112316049 | 23 上海银行 CD049 | 2,500,000 | 248,218,009.28 | 0.95 |
| 8 | 220211 | 22 国开 11 | 2,400,000 | 243,792,483.86 | 0.93 |
| 9 | 112397044 | 23 浙江泰隆 商行 CD046 | 2,000,000 | 199,753,039.52 | 0.76 |
| 10 | 112397076 | 23 汉口银行 CD125 | 2,000,000 | 199,750,137.02 | 0.76 |

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|----------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25 (含) -0.5% 间的次数 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0295% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0294% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0148% |

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 | 按实际利率计算 | 占基金资产净值比例 |
|----|------|------|----|---------|-----------|
|----|------|------|----|---------|-----------|

| | | | (份) | 的账面价值 | (%) |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|
| 1 | 180243 | 至信 11 优 | 900,000 | 91,323,695.34 | 0.35 |
| 2 | 180600 | 中诺 1 优 | 620,000 | 63,055,528.77 | 0.24 |
| 3 | 180242 | 至信 7 优 | 600,000 | 60,987,997.81 | 0.23 |
| 4 | 143192 | 徐保 5A | 400,000 | 40,024,547.94 | 0.15 |
| 5 | 180549 | 熙宁 4 优 | 300,000 | 30,606,627.95 | 0.12 |
| 6 | 112868 | 23 和光 01 | 300,000 | 30,230,334.25 | 0.12 |
| 7 | 199230 | 悦诚 03 优 | 200,000 | 20,152,916.16 | 0.08 |
| 8 | 180895 | 至信 16 优 | 180,000 | 18,150,430.69 | 0.07 |

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，中国民生银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、汉口银行股份有限公司、浙江泰隆商业银行股份有限公司、平安银行股份有限公司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 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 32,500,000.00 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 32,500,000.00 |

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 | 143 | 216,933.35 | 30,887,978.17 | 99.57 | 133,491.35 | 0.43 |
| 华富天益货币 B | 74 | 353,372,796.90 | 26,149,586,970.85 | 100.00 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 217 | 120,647,965.16 | 26,180,474,949.02 | 100.00 | 133,491.35 | 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 | 19,274,655,994.21 | 73.62 |
| 2 | 券商类机构 | 525,710,313.39 | 2.01 |
| 3 | 银行类机构 | 375,797,767.65 | 1.44 |
| 4 | 银行类机构 | 316,955,923.27 | 1.21 |
| 5 | 银行类机构 | 301,546,572.60 | 1.15 |
| 6 | 银行类机构 | 301,122,203.12 | 1.15 |
| 7 | 银行类机构 | 296,454,021.61 | 1.13 |
| 8 | 银行类机构 | 215,517,448.42 | 0.82 |
| 9 | 银行类机构 | 210,033,686.50 | 0.80 |
| 10 | 券商类机构 | 202,243,282.41 | 0.77 |

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 | 3,377.75 | 0.0109 |
| | 华富天益货币 B | 0.00 | 0.0000 |
| | 合计 | 3,377.75 | 0.0000 |

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。

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

注：本期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本开放式基金。

§ 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 | 79,724.31 | 200,018,886.26 |
| 本报告期期初基金份 额总额 | 10,280,724.74 | 28,366,668,166.00 |
| 本报告期基金总申购 份额 | 54,200,840.39 | 23,916,864,757.27 |
| 减：本报告期基金总 赎回份额 | 33,460,095.61 | 26,133,945,952.42 |
| 本报告期基金拆分变 动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份 额总额 | 31,021,469.52 | 26,149,586,970.85 |

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，管理人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 首创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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(%) |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | 60,200,000.00 | 28.28 | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | 152,661,000.00 | 71.72 | - | - |
| 首创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 2023年1月17日 |
| 2 | 华富天益货币市场基金 2022 年第 4 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023年1月20日 |
| 3 | 华富天益货币市场基金 2022 年度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023年3月31日 |
| 4 | 华富天益货币市场基金 2023 年第 1 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023年4月21日 |
| 5 | 华富天益货币市场基金“劳动节”假 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023年4月25日 |

| | | | |
|----|---|-------------|------------|
| | 期前暂停申购及转入业务的公告 | 介 | |
| 6 | 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 | 2023年6月1日 |
| 7 | 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 | 2023年6月1日 |
| 8 | 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 | 2023年6月1日 |
| 9 | 关于华富天益货币市场基金取消基金份额自动升降级业务并调整A、B份额最低申购金额与最低持有份额的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023年6月1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 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023年6月17日 |
| 11 | 华富基金管理有限公司关于对华富天益货币市场基金A类基金份额开展销售服务费费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023年6月21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 | 2023. 1. 1- 2023. 6. 30 | 22, 056, 04 4, 630. 00 | 218, 611, 364. 21 | 3, 000, 000 , 000. 00 | 19, 274, 655, 99 4. 21 | 73. 62 00 |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - |
| 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

2023 年 8 月 30 日