

# 圆信永丰丰润货币市场基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:圆信永丰基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 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及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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和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6月30日止。

## 1.2 目录

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| §1 重要提示及目录                               | 2  |
| 1.1 重要提示                                 | 2  |
| 1.2 目录                                   | 3  |
| §2 基金简介                                  | 5  |
| 2.1 基金基本情况                               | 5  |
| 2.2 基金产品说明                               | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                          | 5  |
| 2.4 信息披露方式                               | 6  |
| 2.5 其他相关资料                               | 6  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                         | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                          | 6  |
| 3.2 基金净值表现                               | 7  |
| §4 管理人报告                                 | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                         | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明               | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                  | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明              | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望              | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                  | 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真实、准确和完整发表意见        | 13 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）                       | 13 |
| 6.1 资产负债表                                | 13 |
| 6.2 利润表                                  | 15 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                         | 17 |
| 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细   | 46 |
| 7.9 投资组合报告附注                             | 46 |
| §8 基金份额持有人信息                             | 48 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                    | 48 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况                   | 48 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                 | 48 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况         | 49 |
| §9 开放式基金份额变动                             | 49 |

|                                    |    |
|------------------------------------|----|
| §10 重大事件揭示                         | 49 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议                   | 49 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动   | 49 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼        | 50 |
| 10.4 基金投资策略的改变                     | 50 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况              | 50 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况      | 50 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况             | 50 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况              | 52 |
| 10.9 其他重大事件                        | 52 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息                 | 53 |
| 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 | 54 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息                | 54 |
| §12 备查文件目录                         | 54 |
| 12.1 备查文件目录                        | 54 |
| 12.2 存放地点                          | 54 |
| 12.3 查阅方式                          | 54 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                   |                   |
|-----------------|-------------------|-------------------|
| 基金名称            | 圆信永丰丰润货币市场基金      |                   |
| 基金简称            | 丰润货币              |                   |
| 基金主代码           | 004178            |                   |
| 基金运作方式          | 契约型开放式            |                   |
| 基金合同生效日         | 2017年03月10日       |                   |
| 基金管理人           | 圆信永丰基金管理有限公司      |                   |
| 基金托管人           | 兴业银行股份有限公司        |                   |
| 报告期末基金份额总额      | 1,770,971,446.35份 |                   |
| 基金合同存续期         | 不定期               |                   |
| 下属分级基金的基金简称     | 丰润货币A             | 丰润货币B             |
| 下属分级基金的交易代码     | 004178            | 004179            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 7,108.77份         | 1,770,964,337.58份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                       |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金将以价值分析为基础，宏观与微观、定性<br>与定量相结合，通过专业的流动性管理力争为投资者<br>实现资产的保值、增值。结合宏观分析和微观分析制<br>定投资策略，力求在满足流动性需要的基础上实现更<br>高的收益率。      |
| 投资策略   | 本基金的投资将以保证资产的流动性为基本原<br>则，力求在对国内外宏观经济走势、货币财政政策变<br>动等因素充分评估的基础上，科学预计未来利率走势，<br>择优筛选并优化配置投资范围内的各种金融工具，进<br>行积极的投资组合管理。 |
| 业绩比较基准 | 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，是证券投资基金中的低<br>风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型<br>基金、混合型基金、债券型基金。                                                   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                                              | 基金托管人                        |
|-------------|------|----------------------------------------------------|------------------------------|
| 名称          |      | 圆信永丰基金管理有限公司                                       | 兴业银行股份有限公司                   |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 兰文伟                                                | 龚小武                          |
|             | 联系电话 | 021-60366000                                       | 021-52629999-212056          |
|             | 电子邮箱 | service@gtsfund.com.cn                             | gongxiaowu@cib.com.cn        |
| 客户服务电话      |      | 4006070088                                         | 95561                        |
| 传真          |      | 021-60366001                                       | 021-62159217                 |
| 注册地址        |      | 中国（福建）自由贸易试验区<br>厦门片区（保税港区）海景南<br>二路45号4楼402单元之175 | 福建省福州市台江区江滨中<br>大道398号兴业银行大厦 |
| 办公地址        |      | 上海市浦东新区世纪大道152<br>8号陆家嘴基金大厦19楼                     | 上海市银城路167号兴业大厦<br>4楼         |
| 邮政编码        |      | 200122                                             | 200120                       |
| 法定代表人       |      | 胡荣炜                                                | 吕家进                          |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                                   |
|---------------------|-------------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报                                                             |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.gtsfund.com.cn">http://www.gtsfund.com.cn</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦19楼                                        |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                       |
|--------|--------------|----------------------------|
| 注册登记机构 | 圆信永丰基金管理有限公司 | 上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦19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<br>(2023年01月01日-2023年06月30日) |               |
|---------------|----------------------------------|---------------|
|               | 丰润货币A                            | 丰润货币B         |
| 本期已实现收益       | 68.97                            | 23,711,983.15 |
| 本期利润          | 68.97                            | 23,711,983.15 |
| 本期净值收益率       | 0.9952%                          | 1.1215%       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末<br>(2023年06月30日)            |               |
|               | 期末基金资产净值                         | 7,108.77      |
| 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<br>(2023年06月30日)            |               |
|               | 累计净值收益率                          | 17.4929%      |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于按摊余成本法核算的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。

注2：本基金自合同生效日起按日结转份额。

### 3.2 基金净值表现

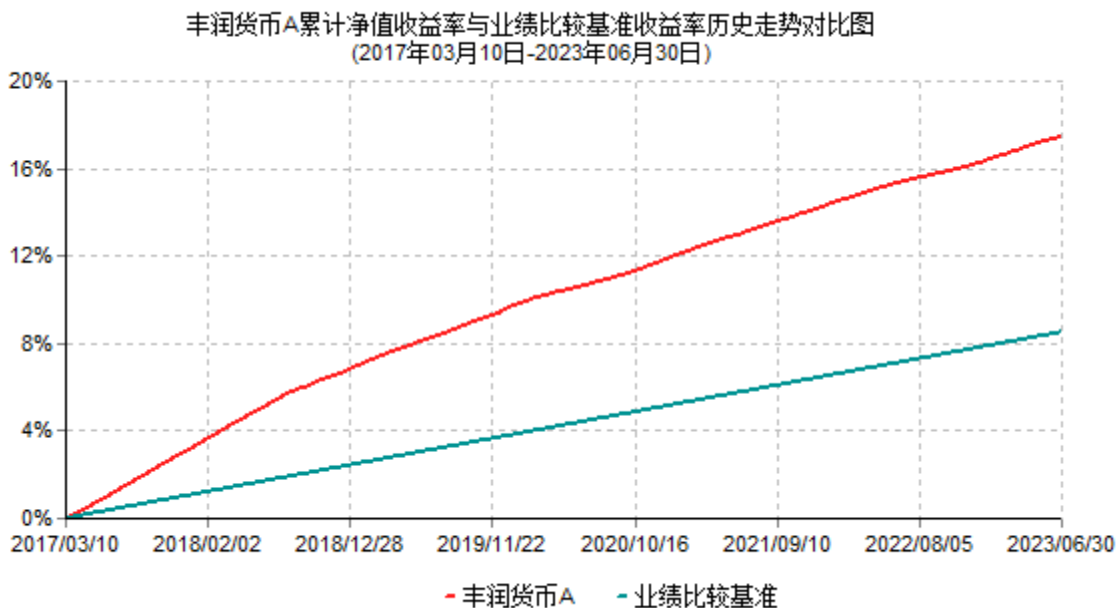
#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

丰润货币A

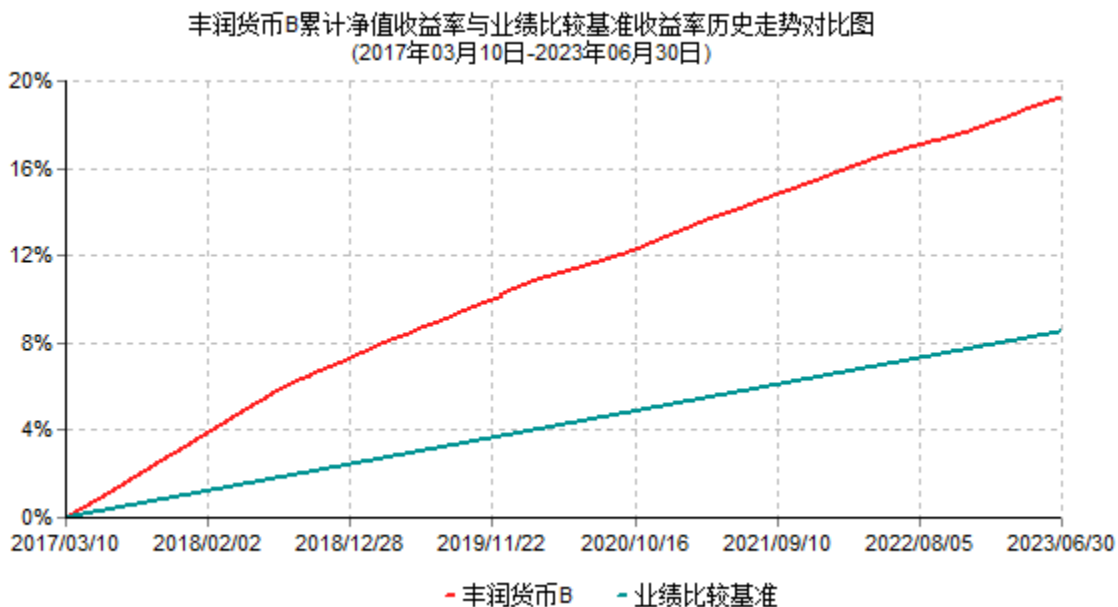
| 阶段    | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③     | ②-④     |
|-------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.1514%      | 0.0031%             | 0.1110%            | 0.0000%                   | 0.0404% | 0.0031% |
| 过去三个月 | 0.4642%      | 0.0020%             | 0.3366%            | 0.0000%                   | 0.1276% | 0.0020% |
| 过去六个月 | 0.9952%      | 0.0022%             | 0.6695%            | 0.0000%                   | 0.3257% | 0.0022% |
| 过去一年  | 1.8027%      | 0.0021%             | 1.3500%            | 0.0000%                   | 0.4527% | 0.0021% |
| 过去三年  | 6.1335%      | 0.0023%             | 4.0500%            | 0.0000%                   | 2.0835% | 0.0023% |
| 自基金合同 | 17.4929%     | 0.0040%             | 8.5216%            | 0.0000%                   | 8.9713% | 0.0040% |

| 生效起至今          |              |                     |                    |                           |          |         |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|----------|---------|
| 丰润货币B          |              |                     |                    |                           |          |         |
| 阶段             | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③      | ②-④     |
| 过去一个月          | 0.1720%      | 0.0031%             | 0.1110%            | 0.0000%                   | 0.0610%  | 0.0031% |
| 过去三个月          | 0.5275%      | 0.0020%             | 0.3366%            | 0.0000%                   | 0.1909%  | 0.0020% |
| 过去六个月          | 1.1215%      | 0.0022%             | 0.6695%            | 0.0000%                   | 0.4520%  | 0.0022% |
| 过去一年           | 2.0503%      | 0.0021%             | 1.3500%            | 0.0000%                   | 0.7003%  | 0.0021% |
| 过去三年           | 6.8904%      | 0.0023%             | 4.0500%            | 0.0000%                   | 2.8404%  | 0.0023% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 19.2608%     | 0.0040%             | 8.5216%            | 0.0000%                   | 10.7392% | 0.0040% |

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







## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

圆信永丰基金管理有限公司是经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”或“证监会”）证监许可[2013]1514号文批准，于2014年1月2日成立的合资基金管理公司。本公司由厦门国际信托有限公司与台湾永丰证券投资信托股份有限公司合资设立，持股比例分别为51%和49%，注册资本贰亿元人民币。公司注册地位于厦门，主要业务经营团队位于上海，是厦门首家证券投资基金管理公司，也是海西首家两岸合资的证券投资基金管理公司。

截止2023年6月30日，公司旗下共管理31只开放式基金产品，包括4只股票型基金、18只混合型基金、8只债券型基金和1只货币市场基金。

#### 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 |        |    |
|    |    |                 |      |        |    |

|     |         |            |   |     |                                                                                                                                |
|-----|---------|------------|---|-----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 林铮  | 本基金基金经理 | 2017-03-10 | - | 14年 | 厦门大学经济学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司固收投资部总监。历任厦门国贸集团投资研究员，国贸期货宏观金融期货研究员，海通期货股指期货分析师，圆信永丰基金管理有限公司专户投资部副总监、固收投资部副总监。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格证。 |
| 刘莎莎 | 本基金基金经理 | 2020-02-27 | - | 13年 | 南京财经大学金融学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司固收投资部基金经理。历任江南农村商业银行公司业务部办事员、资金业务部业务主管、风险管理部业务主管，圆信永丰基金管理有限公司固收投资部货币基金经理助理。国籍：中国。获得的相关业务资格：基金从业资格证。  |

注1：证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

注2：林铮的"任职日期"为基金合同生效之日，刘莎莎的"任职日期"为公告确定的任职日期。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在风险可控的前提下为基金份额持有人谋求最大利益。基金管理人遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、该基金基金合同的规定。基金经理对个券和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和《圆信永丰基金管理有限公司公平交易管理办法》的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保基金管理人管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

基金管理人各类基金资产、资产管理计划资产独立运作。对于交易所市场投资，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照价格优先、时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资，基金管理人通过交易对手控制和询价机制，严格防范对手风险并抽检价格公允性；对于申购投资行为，基金管理人遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过每季度和每年度对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，基金管理人未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，基金管理人未发现存在有可能导致不公平交易和利益输送等的异常交易行为。

基金管理人旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，从银行间质押式回购加权利率来看，二季度资金面较一季度宽松，银行间机构杠杆水平有所上升。二季度资金面整体均衡偏松，7天利率整体在政策利率下方波动，二季度平均利率2.16%，较一季度下降约19BP。从银行间杠杆来看，由于资金利率处于低位，质押式回购成交量较高，显示债券市场杠杆率水平较高，交易较为拥挤。

预计下半年流动性仍延续均衡偏宽松态势，资金利率中枢总体偏低位震荡。一是在当期稳增长目标下仍需维持较宽松的流动性环境，年内货币政策预计延续总量适度、结构精准、节奏平稳总基调。二是央行6月调降政策利率意在引导企业综合融资成本下行，有助于引导资金流向实体经济，后续实体融资需求可能缓慢修复，资金流动将更为畅通，预计资金利率进一步下行概率不大；三是三季度MLF到期规模有所回升，央行在部分时点投放力度整体提高，预计税期、季末时点资金面波动幅度可能较二季度加大。

本基金上半年维持平均剩余期限在监管规定上限运行，杠杆水平在110%以下，二季度，由于产品规模变动较大，月末融资成本较高，产品收益率有所波动。下半年，产品将适当保留一定的平均剩余期限和杠杆额度，寻找机会增加资产配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末丰润货币A基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.9952%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%；截至报告期末丰润货币B基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为1.1215%，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

从基本面上看，经济在二季度出现了明显的增速放缓，由于宽信用政策相对克制，经济预期有所弱化，但在7月政治局会议之后，预期有所改善；另一方面，在经济增长放缓背景下，货币政策将维持相对宽松，而总量宽松政策能否进一步落地，需要关注经济复苏的持续性以及人民币贬值压力。

债券市场，预计整体收益率将维持区间震荡走势。随着7月降息落地后，后续债券收益率继续大幅下行的空间有限：从供求关系上看，二季度供给大幅低于预期后，三季度面临明显放量的境况，供需缺口将明显放大；另一方面，银行资本工具也有可能在三季度进一步放量；另外需要关注《商业银行资本管理办法》如果在明年实施，随着实施节点临近，根据资本节约的导向，银行资本在配置调整过程中，会加剧阶段性供需矛盾；上半年由于实体经济较弱，主动宽信用而溢出到债券市场的资金，未来随着信用供给恢复，未来债券市场需求侧面临下行的风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并设立估值委员会具体负责监督执行。估值委员会的成员由首席投资官或其授权代表、清算登记部分管领导、研究部负责人、监察稽核部总监、风险管理部总监、清算登记部总监和经办基金会计组成。估值委员会负责组织制定、评估和适时修订基金估值政策和程序，并指导和监督整个估值流程。估值委员会成员包括基金核算、行业研究等方面的业务骨干，均具有基金从业

资格、专业胜任能力和丰富的工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理不属于公司估值委员会成员，不介入基金日常估值业务。

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债数据估值服务；本基金与中证指数有限公司根据《中证债券估值数据服务协议》而取得中证数据估值服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书等有关规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人，当日收益参与下一日的收益分配，并定期支付且结转为相应的基金份额。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认真复核了中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### §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：圆信永丰丰润货币市场基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 537,039,355.14     | 563,248,816.19      |
| 结算备付金      |         | 755,245.29         | 71,591.82           |
| 存出保证金      |         | 20,680.41          | 38,037.83           |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 876,420,260.40     | 981,046,385.13      |
| 其中：股票投资    |         | -                  | -                   |
| 基金投资       |         | -                  | -                   |
| 债券投资       |         | 876,420,260.40     | 981,046,385.13      |
| 资产支持证券投资   |         | -                  | -                   |
| 贵金属投资      |         | -                  | -                   |
| 其他投资       |         | -                  | -                   |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                  | -                   |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | 583,015,563.86     | 707,692,941.42      |
| 债权投资       |         | -                  | -                   |
| 其中：债券投资    |         | -                  | -                   |
| 资产支持证券投资   |         | -                  | -                   |
| 其他投资       |         | -                  | -                   |
| 其他债权投资     |         | -                  | -                   |
| 其他权益工具投资   |         | -                  | -                   |
| 应收清算款      |         | -                  | 24,411,639.18       |
| 应收股利       |         | -                  | -                   |
| 应收申购款      |         | 79,095,506.09      | 64,004.00           |
| 递延所得税资产    |         | -                  | -                   |
| 其他资产       | 6.4.7.5 | -                  | -                   |
| 资产总计       |         | 2,076,346,611.19   | 2,276,573,415.57    |

| 负债和净资产      | 附注号     | 本期末<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|-------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>负债：</b>  |         |                    |                     |
| 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   |         | 304,686,111.72     | 30,004,644.62       |
| 应付清算款       |         | -                  | -                   |
| 应付赎回款       |         | -                  | -                   |
| 应付管理人报酬     |         | 312,761.36         | 400,321.75          |
| 应付托管费       |         | 78,190.37          | 100,080.43          |
| 应付销售服务费     |         | 15,639.55          | 20,017.60           |
| 应付投资顾问费     |         | -                  | -                   |
| 应交税费        |         | 11,285.87          | 4,434.04            |
| 应付利润        |         | 76,832.90          | 349,386.85          |
| 递延所得税负债     |         | -                  | -                   |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 194,343.07         | 332,006.93          |
| 负债合计        |         | 305,375,164.84     | 31,210,892.22       |
| <b>净资产：</b> |         |                    |                     |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 1,770,971,446.35   | 2,245,362,523.35    |
| 其他综合收益      |         | -                  | -                   |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | -                  | -                   |
| 净资产合计       |         | 1,770,971,446.35   | 2,245,362,523.35    |
| 负债和净资产总计    |         | 2,076,346,611.19   | 2,276,573,415.57    |

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额1,770,971,446.35份，其中圆信永丰丰润货币市场基金A类基金份额7,108.77份，圆信永丰丰润货币市场基金B类基金份额1,770,964,337.58份。

## 6.2 利润表

会计主体：圆信永丰丰润货币市场基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目                            | 附注号      | 本期<br>2023年01月01日至<br>2023年06月30日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至202<br>2年06月30日 |
|-------------------------------|----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 一、营业总收入                       |          | 27,026,468.05                     | 61,192,836.98                          |
| 1.利息收入                        |          | 14,806,799.38                     | 31,995,756.10                          |
| 其中：存款利息收入                     | 6.4.7.9  | 3,723,698.01                      | 9,453,099.95                           |
| 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                    |          | 11,083,101.37                     | 22,542,656.15                          |
| 证券出借利息收入                      |          | -                                 | -                                      |
| 其他利息收入                        |          | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）              |          | 12,219,668.67                     | 29,197,080.88                          |
| 其中：股票投资收益                     | 6.4.7.10 | -                                 | -                                      |
| 基金投资收益                        | 6.4.7.11 | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益                        | 6.4.7.12 | 12,219,668.67                     | 29,197,080.88                          |
| 资产支持证券投资                      | 6.4.7.13 | -                                 | -                                      |
| 收益                            |          |                                   |                                        |
| 贵金属投资收益                       | 6.4.7.14 | -                                 | -                                      |
| 衍生工具收益                        | 6.4.7.15 | -                                 | -                                      |
| 股利收益                          | 6.4.7.16 | -                                 | -                                      |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认<br>产生的收益 |          | -                                 | -                                      |
| 其他投资收益                        |          | -                                 | -                                      |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.17 | -                                 | -                                      |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）             |          | -                                 | -                                      |
| 5.其他收入（损失以“-”                 | 6.4.7.18 | -                                 | -                                      |



|                            |            |               |               |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 号填列)                       |            |               |               |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 3,314,415.93  | 7,859,991.44  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 2,103,099.56  | 4,926,115.23  |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 525,775.04    | 1,231,528.78  |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 105,163.71    | 246,314.49    |
| 4. 投资顾问费                   |            | -             | -             |
| 5. 利息支出                    |            | 411,277.42    | 1,261,176.05  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 411,277.42    | 1,261,176.05  |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.19   | -             | -             |
| 7. 税金及附加                   |            | 6,224.75      | 24,632.26     |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 162,875.45    | 170,224.63    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 23,712,052.12 | 53,332,845.54 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 23,712,052.12 | 53,332,845.54 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -             | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 23,712,052.12 | 53,332,845.54 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：圆信永丰丰润货币市场基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目              | 本期                      |        |       |                  |
|-----------------|-------------------------|--------|-------|------------------|
|                 | 2023年01月01日至2023年06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） | 2,245,362,523.35        | -      | -     | 2,245,362,523.35 |
| 加：会计政策变         | -                       | -      | -     | -                |

|                                          |                   |   |                |                   |
|------------------------------------------|-------------------|---|----------------|-------------------|
| 更                                        |                   |   |                |                   |
| 前期差错更正                                   | -                 | - | -              | -                 |
| 其他                                       | -                 | - | -              | -                 |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 2,245,362,523.35  | - | -              | 2,245,362,523.35  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -474,391,077.00   | - | -              | -474,391,077.00   |
| （一）、综合收益总额                               | -                 | - | 23,712,052.12  | 23,712,052.12     |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -474,391,077.00   | - | -              | -474,391,077.00   |
| 其中：1.基金申购款                               | 3,791,804,299.08  | - | -              | 3,791,804,299.08  |
| 2.基金赎回款                                  | -4,266,195,376.08 | - | -              | -4,266,195,376.08 |
| （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） | -                 | - | -23,712,052.12 | -23,712,052.12    |
| （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）                          | 1,770,971,446.35  | - | -              | 1,770,971,446.35  |

| 值)                                  |                                    |        |                |                    |
|-------------------------------------|------------------------------------|--------|----------------|--------------------|
| 项目                                  | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06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）                     | 6,596,076,419.01                   | -      | -              | 6,596,076,419.01   |
| 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）                     | 6,596,076,419.01                   | -      | -              | 6,596,076,419.01   |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -645,835,058.70                    | -      | -              | -645,835,058.70    |
| （一）、综合收益总额                          | -                                  | -      | 53,332,845.54  | 53,332,845.54      |
| （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） | -645,835,058.70                    | -      | -              | -645,835,058.70    |
| 其中：1.基金申购款                          | 13,068,979,155.52                  | -      | -              | 13,068,979,155.52  |
| 2.基金赎回款                             | -13,714,814,214.22                 | -      | -              | -13,714,814,214.22 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产                 | -                                  | -      | -53,332,845.54 | -53,332,845.54     |

|                       |                  |   |   |                  |
|-----------------------|------------------|---|---|------------------|
| 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)       | 5,950,241,360.31 | - | - | 5,950,241,360.31 |

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:

胡荣炜

姚德明

刘雪峰

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

圆信永丰丰润货币市场基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2016]3070号《关于准予圆信永丰丰润货币市场基金注册的批复》注册,由圆信永丰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰丰润货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,800,940,379.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第251号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《圆信永丰丰润货币市场基金基金合同》于2017年3月10日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,800,996,400.53份基金份额,其中认购资金利息折合56,021.53份基金份额。本基金的基金管理人为圆信永丰基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《圆信永丰丰润货币市场基金基金合同》和《圆信永丰丰润货币市场基金招募说明书》,圆信永丰丰润货币基金根据销售服务费收取费率的不同,将基金份额分为不同的类别。年销售服务费率为0.25%的基金份额,称为A类基金份额;年销售服务费率为0.01%的基金份额,称为B类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码,并分别公布基金份额的每万份基金已实现收益和7日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰丰润货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的工具,包括现金;期限在1年以内(含1年)

的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券及法律法规或中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：七天通知存款利率(税后)。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《圆信永丰丰润货币市场基金 基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况以及2023年中期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号

《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2023年06月30日 |
|--------|--------------------|
| 活期存款   | 2,634,752.00       |
| 等于：本金  | 2,631,956.47       |
| 加：应计利息 | 2,795.53           |
| 减：坏账准备 | -                  |
| 定期存款   | 534,404,603.14     |
| 等于：本金  | 533,000,000.00     |
| 加：应计利息 | 1,404,603.14       |

|              |                |
|--------------|----------------|
| 减：坏账准备       | -              |
| 其中：存款期限1个月以内 | -              |
| 存款期限1-3个月    | 300,048,722.22 |
| 存款期限3个月以上    | 234,355,880.92 |
| 其他存款         | -              |
| 等于：本金        | -              |
| 加：应计利息       | -              |
| 减：坏账准备       | -              |
| 合计           | 537,039,355.14 |

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 |        | 本期末<br>2023年06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  | 170,987,816.36     | 170,715,697.72 | -272,118.64 | -0.0154 |
|    | 银行间市场  | 705,432,444.04     | 705,941,269.24 | 508,825.20  | 0.0287  |
|    | 合计     | 876,420,260.40     | 876,656,966.96 | 236,706.56  | 0.0134  |
|    | 资产支持证券 | -                  | -              | -           | -       |
|    | 合计     | 876,420,260.40     | 876,656,966.96 | 236,706.56  | 0.0134  |

注1：偏离金额=影子定价-摊余成本；

注2：偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 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06月30日    |           |
|-------|----------------|-----------|
|       | 账面余额           | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -              | -         |
| 银行间市场 | 583,015,563.86 | -         |
| 合计    | 583,015,563.86 | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 其他资产

无。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年06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      | 69,431.39          |
| 其中：交易所市场    | -                  |
| 银行间市场       | 69,431.39          |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用        | 118,095.94         |
| 其他应付        | 6,815.74           |
| 合计          | 194,343.07         |

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 丰润货币A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(丰润货币A) | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|---------------|-------------------------------|
|---------------|-------------------------------|



|               | 基金份额（份）        | 账面金额           |
|---------------|----------------|----------------|
| 上年度末          | 7,160.22       | 7,160.22       |
| 本期申购          | 57,385,848.95  | 57,385,848.95  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -57,385,900.40 | -57,385,900.40 |
| 本期末           | 7,108.77       | 7,108.77       |

#### 6.4.7.7.2 丰润货币B

金额单位：人民币元

| 项目<br>(丰润货币B) | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |                   |
|---------------|-------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                       | 账面金额              |
| 上年度末          | 2,245,355,363.13              | 2,245,355,363.13  |
| 本期申购          | 3,734,418,450.13              | 3,734,418,450.13  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -4,208,809,475.68             | -4,208,809,475.68 |
| 本期末           | 1,770,964,337.58              | 1,770,964,337.58  |

注：申购含红利再投、转换入和级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 丰润货币A

单位：人民币元

| 项目<br>(丰润货币A)  | 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           | 68.97  | -     | 68.97   |
| 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        | -68.97 | -     | -68.97  |
| 本期末            | -      | -     | -       |

##### 6.4.7.8.2 丰润货币B

单位：人民币元

| 项目<br>(丰润货币B)  | 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           | 23,711,983.15  | -     | 23,711,983.15  |
| 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        | -23,711,983.15 | -     | -23,711,983.15 |
| 本期末            | -              | -     | -              |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 14,447.39                     |
| 定期存款利息收入  | 3,705,368.69                  |
| 其他存款利息收入  | -                             |
| 结算备付金利息收入 | 3,693.12                      |
| 其他        | 188.81                        |
| 合计        | 3,723,698.01                  |

**6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入**  
无。

**6.4.7.11 基金投资收益**  
无。

**6.4.7.12 债券投资收益**

**6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                      |
|------------------------------|-------------------------|
|                              | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 11,956,664.59           |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 263,004.08              |
| 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                           | 12,219,668.67           |

#### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                      |
|------------------------|-------------------------|
|                        | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 2,171,166,607.74        |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,159,872,460.79        |
| 减：应计利息总额               | 11,031,142.87           |
| 减：交易费用                 | -                       |
| 买卖债券差价收入               | 263,004.08              |

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.16 股利收益

无。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

无。

#### 6.4.7.18 其他收入

无。

#### 6.4.7.19 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 审计费用    | 49,588.57               |
| 信息披露费   | 59,507.37               |
| 证券出借违约金 | -                       |
| 汇划手续费   | 36,479.51               |
| 账户维护费   | 17,300.00               |
| 合计      | 162,875.45              |

#### 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

本报告期不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。

##### 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             |
|--------------------------|---------------------|
| 圆信永丰基金管理有限公司（“圆信永丰基金公司”） | 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）       | 基金托管人、基金销售机构        |
| 厦门国际信托有限公司               | 基金管理人的股东            |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,103,099.56                  | 4,926,115.23                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 146,429.56                    | 254,318.26                         |

注：支付基金管理人圆信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023年01月01日至2023<br>年06月30日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022<br>年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 525,775.04                        | 1,231,528.78                           |

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日      |            |            |
|----------------------------|------------------------------------|------------|------------|
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |            |            |
|                            | 丰润货币A                              | 丰润货币B      | 合计         |
| 圆信永丰<br>基金公司               | 1.81                               | 81,082.85  | 81,084.66  |
| 兴业银行                       | 0.00                               | 3,487.26   | 3,487.26   |
| 合计                         | 1.81                               | 84,570.11  | 84,571.92  |
| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |            |            |
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |            |            |
|                            | 丰润货币A                              | 丰润货币B      | 合计         |
| 圆信永丰<br>基金公司               | 1.81                               | 204,059.03 | 204,060.84 |
| 兴业银行                       | 0.70                               | 1,770.27   | 1,770.97   |
| 合计                         | 2.51                               | 205,829.30 | 205,831.81 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日A类基金份额和B类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给圆信永丰基金公司，再由圆信永丰基金公司计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%和0.01%。其计算公式为：

日销售服务费=前一日A/B类基金资产净值×约定年费率/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2023年01月01日至2023年06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     |
| 兴业银行                               | 20,059,216.50 | -    | -     | -    | 41,990,000.00 | 2,176.70 |
| 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06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     |
| 兴业银行                               | -             | -    | -     | -    | -             | -        |

#### 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  
无。

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  
无。

#### 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

丰润货币A

份额单位：份

| 项目                  | 本期<br>2023年01月01日至<br>2023年06月30日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至<br>2022年06月30日 |
|---------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 报告期初持有的基金份额         | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期间申购/买入总份额        | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期间因拆分变动份额         | 0.00                              | 0.00                                   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期末持有的基金份额         | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.00%                             | 0.00%                                  |

丰润货币B

份额单位：份

| 项目                  | 本期<br>2023年01月01日至<br>2023年06月30日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至<br>2022年06月30日 |
|---------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 报告期初持有的基金份额         | 188,861,678.65                    | 115,866,053.47                         |
| 报告期间申购/买入总份额        | 23,908,338.94                     | 61,410,592.67                          |
| 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      | 58,000,000.00                     | 15,000,000.00                          |
| 报告期末持有的基金份额         | 154,770,017.59                    | 162,276,646.14                         |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 8.74%                             | 2.73%                                  |

注1：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。报告期末持有的基金份额占比为占B类基金总份额的比例。

注2：基金管理人圆信永丰基金公司在本期及上年度可比期间内申购/赎回本基金的交易委托圆信永丰直销柜台办理。

#### 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

丰润货币B

| 关联方名称 | 本期末<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>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 |
|------------|----------------|------------------|----------------|------------------|
| 厦门国际信托有限公司 | 300,911,274.07 | 16.9900%         | 0.00           | 0.0000%          |
| 兴业银行       | 520,630,945.12 | 29.4000%         | 514,799,405.64 | 22.9300%         |

注：报告期末持有的基金份额占比为占B类基金总份额的比例。

#### 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<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |              | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |              |
|-----------|-------------------------------|--------------|------------------------------------|--------------|
|           | 期末余额                          | 当期利息收入       | 期末余额                               | 当期利息收入       |
| 兴业银行-活期存款 | 2,634,752.00                  | 14,447.39    | 4,789,000.83                       | 22,592.01    |
| 兴业银行-定期存款 | 312,821,702.67                | 1,482,045.72 | 261,848,429.95                     | 2,880,524.49 |

注：本基金的活期银行存款和部分定期存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 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——固定净值型货币市场基金

丰润货币A

单位：人民币元

| 已按再投资形式 | 直接通过应付 | 应付利润 | 本期利润 | 备注 |
|---------|--------|------|------|----|
|         |        |      |      |    |

|       |         |       |       |   |
|-------|---------|-------|-------|---|
| 转实收基金 | 赎回款转出金额 | 本年变动  | 分配合计  |   |
| 69.73 | -       | -0.76 | 68.97 | - |

丰润货币B

单位：人民币元

|                  |                   |              |               |    |
|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润<br>分配合计  | 备注 |
| 23,984,536.34    | -                 | -272,553.19  | 23,711,983.15 | -  |

**6.4.12 期末（2023年06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**

无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额304,686,111.72元，是以如下债券作为抵押：

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        |
|-----------|-------------|------------|--------|-----------|---------------|
| 012381391 | 23皖交控SCP003 | 2023-07-03 | 100.67 | 72,000    | 7,248,520.69  |
| 102001773 | 20广晟MTN004  | 2023-07-04 | 103.11 | 200,000   | 20,621,725.44 |
| 112315259 | 23民生银行CD259 | 2023-07-04 | 99.59  | 1,000,000 | 99,589,328.17 |
| 112319168 | 23恒丰银行CD168 | 2023-07-03 | 99.74  | 300,000   | 29,920,695.08 |
| 180211    | 18国开11      | 2023-07-03 | 103.47 | 300,000   | 31,039,742.17 |
| 1820069   | 18南京银行04    | 2023-07-04 | 103.12 | 100,000   | 10,311,718.34 |
| 200407    | 20农发07      | 2023-07-03 | 102.84 | 300,000   | 30,852,783.28 |

|         |          |            |        |           |                |
|---------|----------|------------|--------|-----------|----------------|
| 2028029 | 20交通银行01 | 2023-07-04 | 102.77 | 200,000   | 20,554,984.24  |
| 210322  | 21进出22   | 2023-07-03 | 102.00 | 15,000    | 1,529,943.84   |
| 210402  | 21农发02   | 2023-07-03 | 101.73 | 200,000   | 20,346,177.38  |
| 2128012 | 21浦发银行01 | 2023-07-04 | 101.80 | 200,000   | 20,360,474.28  |
| 230201  | 23国开01   | 2023-07-03 | 100.79 | 200,000   | 20,157,520.77  |
| 2304112 | 23农发贴现12 | 2023-07-03 | 99.89  | 200,000   | 19,977,163.27  |
| 合计      |          |            |        | 3,287,000 | 332,510,776.95 |

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是将以价值分析为基础，宏观与微观、定性与定量相结合，通过专业的流动性管理力争为投资者实现资产的保值、增值。结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足流动性需要的基础上实现更高的收益率。本基金主要投资于具有良好流动性的工具，包括现金；期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在397天以内（含397天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券及法律法规或中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本基金的基金管理人实行全面风险管理与全员风险管理。基金管理人以各岗位目标责任制为基础的第一道内控防线，员工在自律的前提下，相互监督制衡。各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在授权范围内承担责任；以相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道内控防线，公司在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督责任；以公司督察长、监察稽核部门对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道防线，督察长、监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈；以董事会下属风险与合规管理委员会对公司经营管理和基金运作中的合法合规性实行全面监督的第四道防线。风险与合规管理委员会对公司经营和

基金运作中的风险进行严格的合规检查和风险控制评估并审议公司风险管理工作报告。董事会对基金管理人的风险管理负有最终责任。

本基金的基金管理人建立科学严密的风险评估体系，对内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险；建立完整的风险控制程序，包括风险识别、风险评估、风险控制和风险监督；对各部门和各业务循环存在的风险点进行识别评估，并建立相应的控制措施；使用科学的风险量化技术和严格的风险限额控制对投资风险实行定量分析和

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人兴业银行；定期存款存放在具有基金托管资格的中国民生银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、平安银行股份有限公司以及厦门国际银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不得投资信用等级在AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的10%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | 38,746,926.57      | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |

|     |                |                |
|-----|----------------|----------------|
| 未评级 | 140,727,454.51 | 138,322,081.76 |
| 合计  | 179,474,381.08 | 138,322,081.76 |

注：本期末未评级债券为政策性金融债、金融债及短期融资券，上年度末未评级债券为国债、政策性金融债、金融债及短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 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<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 368,136,265.74     | 556,497,051.26      |
| 合计     | 368,136,265.74     | 556,497,051.26      |

#### 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<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 234,966,603.34     | 204,144,291.08      |
| AAA以下  | -                  | 20,620,738.24       |
| 未评级    | 93,843,010.24      | 61,462,222.79       |
| 合计     | 328,809,613.58     | 286,227,252.11      |

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还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，除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。

于2023年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有304,686,111.72元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过240天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过60天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%。于2023年6月30日，本基金前10名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为82.18%，本基金投资组合的平均剩余期限为60天，平均剩余存续期为60天。本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例为35.47%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的10%。于2023年6月30日，本基金无流动性受限资产。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023年0<br>6月30<br>日 | 6个月以内 | 6个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------------------|-------|--------|------|------|-----|----|
| 资产                         |       |        |      |      |     |    |

|                     |                  |               |      |      |               |                  |
|---------------------|------------------|---------------|------|------|---------------|------------------|
| 银行存款                | 537,039,355.14   | -             | -    | -    | -             | 537,039,355.14   |
| 结算备付金               | 755,245.29       | -             | -    | -    | -             | 755,245.29       |
| 存出保证金               | 20,680.41        | -             | -    | -    | -             | 20,680.41        |
| 交易性金融资产             | 805,481,724.40   | 70,938,536.00 | -    | -    | -             | 876,420,260.40   |
| 买入返售金融资产            | 583,015,563.86   | -             | -    | -    | -             | 583,015,563.86   |
| 应收申购款               | -                | -             | -    | -    | 79,095,506.09 | 79,095,506.09    |
| 资产总计                | 1,926,312,569.10 | 70,938,536.00 | -    | -    | 79,095,506.09 | 2,076,346,611.19 |
| 负债                  |                  |               |      |      |               |                  |
| 卖出回购金融资产款           | 304,686,111.72   | -             | -    | -    | -             | 304,686,111.72   |
| 应付管理人报酬             | -                | -             | -    | -    | 312,761.36    | 312,761.36       |
| 应付托管费               | -                | -             | -    | -    | 78,190.37     | 78,190.37        |
| 应付销售服务费             | -                | -             | -    | -    | 15,639.55     | 15,639.55        |
| 应交税费                | -                | -             | -    | -    | 11,285.87     | 11,285.87        |
| 应付利润                | -                | -             | -    | -    | 76,832.90     | 76,832.90        |
| 其他负债                | -                | -             | -    | -    | 194,343.07    | 194,343.07       |
| 负债总计                | 304,686,111.72   | -             | -    | -    | 689,053.12    | 305,375,164.84   |
| 利率敏感度缺口             | 1,621,626,457.38 | 70,938,536.00 | -    | -    | 78,406,452.97 | 1,770,971,446.35 |
| 上年度末<br>2022年12月31日 | 6个月以内            | 6个月-1年        | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计               |
| 资产                  |                  |               |      |      |               |                  |
| 银行存款                | 563,248,816.19   | -             | -    | -    | -             | 563,248,816.19   |
| 结算备付金               | 71,591.82        | -             | -    | -    | -             | 71,591.82        |
| 存出保证金               | 38,037.83        | -             | -    | -    | -             | 38,037.83        |
| 交易性金融资产             | 889,542,263.38   | 91,504,121.75 | -    | -    | -             | 981,046,385.13   |



|           |                  |               |   |   |               |                  |
|-----------|------------------|---------------|---|---|---------------|------------------|
| 产         |                  |               |   |   |               |                  |
| 买入返售金融资产  | 707,692,941.42   | -             | - | - | -             | 707,692,941.42   |
| 应收清算款     | -                | -             | - | - | 24,411,639.18 | 24,411,639.18    |
| 应收申购款     | -                | -             | - | - | 64,004.00     | 64,004.00        |
| 资产总计      | 2,160,593,650.64 | 91,504,121.75 | - | - | 24,475,643.18 | 2,276,573,415.57 |
| 负债        |                  |               |   |   |               |                  |
| 卖出回购金融资产款 | 30,004,644.62    | -             | - | - | -             | 30,004,644.62    |
| 应付管理人报酬   | -                | -             | - | - | 400,321.75    | 400,321.75       |
| 应付托管费     | -                | -             | - | - | 100,080.43    | 100,080.43       |
| 应付销售服务费   | -                | -             | - | - | 20,017.60     | 20,017.60        |
| 应交税费      | -                | -             | - | - | 4,434.04      | 4,434.04         |
| 应付利润      | -                | -             | - | - | 349,386.85    | 349,386.85       |
| 其他负债      | -                | -             | - | - | 332,006.93    | 332,006.93       |
| 负债总计      | 30,004,644.62    | -             | - | - | 1,206,247.60  | 31,210,892.22    |
| 利率敏感度缺口   | 2,130,589,006.02 | 91,504,121.75 | - | - | 23,269,395.58 | 2,245,362,523.35 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                     |
|----|--------------------|---------------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额<br>(单位：人民币元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2023年06月30日              | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|    | 1.市场利率下降25个基点      | 534,644.11                      | 722,080.97          |
|    | 2.市场利率上升25个基点      | -533,697.40                     | -720,675.40         |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，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

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | -                  | -                   |
| 第二层次          | 876,420,260.40     | 981,046,385.13      |
| 第三层次          | -                  | -                   |
| 合计            | 876,420,260.40     | 981,046,385.13      |

##### 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期末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

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

**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**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他事项。

**§7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 固定收益投资            | 876,420,260.40   | 42.21        |
|    | 其中：债券             | 876,420,260.40   | 42.21        |
|    | 资产支持证券            | -                | -            |
| 2  | 买入返售金融资产          | 583,015,563.86   | 28.08        |
|    | 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      | 537,794,600.43   | 25.90        |
| 4  | 其他各项资产            | 79,116,186.50    | 3.81         |
| 5  | 合计                | 2,076,346,611.19 | 100.00       |

**7.2 债券回购融资情况**

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值比例(%)   |              |
|----|--------------|----------------|--------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 2.61           |              |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              |              |
| 序号 | 项目           | 金额             | 占基金资产净值比例(%) |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 304,686,111.72 | 17.20        |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              | -            |

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

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 60 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 64 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 40 |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限不存在超过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                | 38.07              | 17.20              |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30天(含)—60天           | 31.69              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 3  | 60天(含)—90天           | 23.88              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 4  | 90天(含)—120天          | 1.21               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 5  | 120天(含)—397天(含)      | 17.38              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天       | -                  | -                  |

|  |        |        |       |
|--|--------|--------|-------|
|  | 的浮动利率债 |        |       |
|  | 合计     | 112.23 | 17.20 |

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期不存在超过240天的情况。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种               | 公允价值           | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------------------|----------------|------------------|
| 1  | 国家债券               | -              | -                |
| 2  | 央行票据               | -              | -                |
| 3  | 金融债券               | 185,204,871.14 | 10.46            |
|    | 其中：政策性金融债          | 133,977,694.28 | 7.57             |
| 4  | 企业债券               | 170,987,816.36 | 9.66             |
| 5  | 企业短期融资券            | 100,592,770.47 | 5.68             |
| 6  | 中期票据               | 51,498,536.69  | 2.91             |
| 7  | 同业存单               | 368,136,265.74 | 20.79            |
| 8  | 其他                 | -              | -                |
| 9  | 合计                 | 876,420,260.40 | 49.49            |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -              | -                |

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称              | 债券数量(张)   | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-------------------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 112315259 | 23民生银行C<br>D259   | 1,000,000 | 99,589,328.17 | 5.62         |
| 2  | 112318022 | 23华夏银行C<br>D022   | 1,000,000 | 99,189,807.93 | 5.60         |
| 3  | 112390983 | 23北京农商银<br>行CD016 | 500,000   | 49,906,414.68 | 2.82         |

|    |           |                  |         |               |      |
|----|-----------|------------------|---------|---------------|------|
| 4  | 112204047 | 22中国银行C<br>D047  | 500,000 | 49,835,159.65 | 2.81 |
| 5  | 180211    | 18国开11           | 300,000 | 31,039,742.17 | 1.75 |
| 6  | 102001640 | 20广核电力M<br>TN001 | 300,000 | 30,876,811.25 | 1.74 |
| 7  | 200407    | 20农发07           | 300,000 | 30,852,783.28 | 1.74 |
| 8  | 175350    | 20东债03           | 300,000 | 30,790,471.72 | 1.74 |
| 9  | 137853    | 22中泰S3           | 300,000 | 30,458,363.77 | 1.72 |
| 10 | 012284374 | 22电网SCP023       | 300,000 | 30,331,934.58 | 1.71 |

### 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                  | 0.0308%  |
| 报告期内偏离度的最低值                  | -0.0168% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值       | 0.0124%  |

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.50%的情况。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 基金计价方法说明

鉴于货币市场基金的特性，本基金采用摊余成本法计算基金资产净值，即本基金按持有债券投资的票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价，以摊余的成本计算基金资产净值。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率或交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人采用“影子定价”，即于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对

象进行重新评估，当基金资产净值与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为“公允价值变动损益”，并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1.00元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

### 7.9.2 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

通过查阅中国证监会、中国银保监会网站公开目录“行政处罚决定”及查阅相关发行主体的公司公告，在基金管理人知悉的范围内，报告期内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在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。北京农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会北京监管局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。东方证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。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期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 | 20,680.41     |
| 2  | 应收清算款 | -             |
| 3  | 应收利息  | -             |
| 4  | 应收申购款 | 79,095,506.09 |
| 5  | 其他应收款 | -             |
| 6  | 待摊费用  | -             |
| 7  | 其他    | -             |
| 8  | 合计    | 79,116,186.50 |

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 58 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 |
| 丰润货币A | 2,514    | 2.83         | 112.11           | 1.58%  | 6,996.66      | 98.42% |
| 丰润货币B | 1,275    | 1,388,991.64 | 1,715,043,610.16 | 96.84% | 55,920,727.42 | 3.16%  |
| 合计    | 3,789    | 467,398.11   | 1,715,043,722.27 | 96.84% | 55,927,724.08 | 3.16%  |

### 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 | 520,630,945.12 | 29.40% |
| 2  | 信托类机构 | 300,911,274.07 | 16.99% |
| 3  | 保险类机构 | 164,722,790.11 | 9.30%  |
| 4  | 基金类机构 | 154,770,017.59 | 8.74%  |
| 5  | 其他机构  | 69,990,000.00  | 3.95%  |
| 6  | 券商类机构 | 50,598,978.32  | 2.86%  |
| 7  | 保险类机构 | 50,002,777.15  | 2.82%  |
| 8  | 保险类机构 | 49,918,822.83  | 2.82%  |
| 9  | 其他机构  | 49,363,436.73  | 2.79%  |
| 10 | 其他机构  | 44,427,092.99  | 2.51%  |

### 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<br>(份) | 占基金总份额比<br>例 |
|------------------|-------|---------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 丰润货币A | 2.02          | 0.03%        |
|                  | 丰润货币B | 8,116,516.04  | 0.46%        |
|                  | 合计    | 8,116,518.06  | 0.46%        |

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                                     | 份额级别  | 持有基金份额总量的数量区<br>间（万份） |
|----------------------------------------|-------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式<br>基金 | 丰润货币A | 0                     |
|                                        | 丰润货币B | >100                  |
|                                        | 合计    | >100                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基<br>金                    | 丰润货币A | 0                     |
|                                        | 丰润货币B | 0                     |
|                                        | 合计    | 0                     |

#### §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                | 丰润货币A         | 丰润货币B            |
|--------------------------------|---------------|------------------|
| 基金合同生效日(2017年03月10<br>日)基金份额总额 | 940,400.53    | 1,800,056,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 7,160.22      | 2,245,355,363.13 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 57,385,848.95 | 3,734,418,450.13 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 57,385,900.40 | 4,208,809,475.68 |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 7,108.77      | 1,770,964,337.58 |

#### §10 重大事件揭示

##### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会且无决议。

##### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

2023年6月20日，蔡炎坤先生离任公司总经理职务，同日起，胡荣炜先生代为履行公司总经理职责。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

自2023年4月11日起，陈启女士担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，叶文煌先生不再担任基金托管人资产托管部总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 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，本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 安信证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东北证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华泰   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|        |   |   |   |   |   |   |
|--------|---|---|---|---|---|---|
| 证券     |   |   |   |   |   |   |
| 东方财富证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 方正证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 华福证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 开源证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券   | 3 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券   | 3 | - | - | - | - | - |

注1：本报告期内基金无新增证券公司交易单元。

注2：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。

选择租用证券公司基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 资金实力雄厚，财务状况良好；
- (2) 经营行为稳健规范，在业内有良好的声誉；
- (3) 内控制度健全，内部管理严格；并能满足基金运作高度保密的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行交易的需要；并能为基金提供全面的信息服务；
- (5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员；

(6) 具备较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较强的研究综合实力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、策略、行业、个股分析报告及丰富全面的信息服务;合作机构研究强项与我司研究重点匹配度高,能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他业务的开展提供良好的服务和支持。

注3:基金选择证券公司交易单元的选择程序如下:

- (1) 本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后,确定拟选用交易单元的证券经营机构;
- (2) 本基金管理人与和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 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 |              | 基金交易 |              |
|--------|----------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|        | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 安信证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东北证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华泰证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东方财富证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东兴证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 方正证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 广发证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 国信证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华创证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华福证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 开源证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 西部证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 银河证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 浙商证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中泰证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 长江证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 兴业证券   | 331,181,549.08 | 100.00%      | 389,538,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |

### 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

### 10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|------|--------|--------|
|----|------|--------|--------|

|    |                                                   |         |            |
|----|---------------------------------------------------|---------|------------|
| 1  | 圆信永丰基金管理有限公司关于圆信永丰丰润货币市场基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 证监会规定媒介 | 2023-01-17 |
| 2  | 圆信永丰丰润货币市场基金2022年第4季度报告                           | 证监会规定媒介 | 2023-01-20 |
| 3  | 圆信永丰基金管理有限公司关于完成公司法定代表人变更登记的公告                    | 证监会规定媒介 | 2023-01-20 |
| 4  | 圆信永丰丰润货币市场基金2022年年度报告                             | 证监会规定媒介 | 2023-03-31 |
| 5  | 圆信永丰基金管理有限公司圆信永丰丰润货币市场基金招募说明书（更新）                 | 证监会规定媒介 | 2023-04-10 |
| 6  | 圆信永丰丰润货币市场基金2023年第一季度报告                           | 证监会规定媒介 | 2023-04-21 |
| 7  | 圆信永丰基金管理有限公司关于圆信永丰丰润货币市场基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 证监会规定媒介 | 2023-04-26 |
| 8  | 圆信永丰基金管理有限公司关于圆信永丰丰润货币市场基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 证监会规定媒介 | 2023-06-19 |
| 9  | 圆信永丰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告                        | 证监会规定媒介 | 2023-06-21 |
| 10 | 圆信永丰丰润货币市场基金基金产品资料概要更新                            | 证监会规定媒介 | 2023-06-30 |

### §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              | 20230101-20230630      | 514,799,405.64 | 5,831,539.48 | 0.00       | 520,630,945.12 | 29.40% |
| 产品特有风险                                                                        |                |                        |                |              |            |                |        |
| 本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20% 的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 |                |                        |                |              |            |                |        |

**11.2 影响投资者决策的其他重要信息**

无。

**§12 备查文件目录****12.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会批准圆信永丰丰润货币市场基金设立的文件；
- 2、《圆信永丰丰润货币市场基金基金合同》；
- 3、《圆信永丰丰润货币市场基金托管协议》；
- 4、报告期内在规定报刊上披露的各项公告；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

**12.2 存放地点**

基金管理人、基金托管人处

**12.3 查阅方式**

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人圆信永丰基金管理有限公司。

咨询电话：4006070088

公司网址：<http://www.gtsfund.com.cn>

圆信永丰基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日