华富天盈货币市场基金

2018年第三季度报告

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月26日

§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责任。

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2018年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2018年7月1日至2018年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富天盈货币
交易代码	004228
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月3日
报告期末基金份额总额	120,067,162.04份
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、资金流动趋势、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。
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华富天盈货币A / 华富天盈货币B
下属分级基金的交易代码	004228 / 004296
报告期末下属分级基金的份额总额	8,850,105.02份 / 111,217,057.02份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)	
	华富天盈货币A	华富天盈货币B
1.本期已实现收益	73,480.33	898,074.03
2.本期利润	73,480.33	898,074.03
3.期末基金资产净值	8,850,105.02	111,217,057.02

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

华富天盈货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7341%	0.0054%	0.3403%	0.0000%	0.3938%	0.0054%

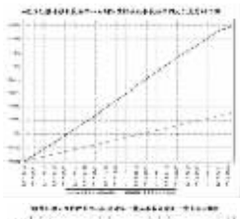
注:业绩比较基准收益率=同期七天通知存款利率(税后),业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

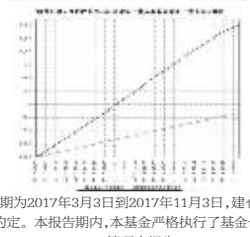
华富天盈货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7950%	0.0054%	0.3403%	0.0000%	0.4547%	0.0054%

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





注:本基金建仓期为2017年3月3日到2017年11月3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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姚姣姣	华富天盈货币市场基金基金经理、华富天益货币市场基金基金经理、华富货币市场基金基金经理、华富短稳纯债债券型基金基金经理、华富恒益18个月定期开放债券型基金基金经理	2017年3月14日	-	六年	复旦大学金融学硕士,研究生学历。先后任职于广发银行股份有限公司、上海农商银行股份有限公司,2016年11月加入华富基金管理有限公司。
倪莉莎	华富天盈货币市场基金基金经理、华富恒财定期开放债券型基金基金经理、华富恒益3个月定期开放债券型基金基金经理、华富恒益3个月定期开放债券型基金基金经理、华富恒益18个月定期开放债券型基金基金经理、华富悦享定期开放债券型基金基金经理、华富悦享一年定期开放债券型基金基金经理、公司公募投资决策委员会委员、公司总经理助理、固定收益部总监	2017年9月12日	-	四年	英国曼彻斯特大学管理学硕士,研究生学历。2014年2月加入华富基金管理有限公司,先后担任集中交易部助理交易员、交易员、固定收益部华富货币市场基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富恒财分级债券型基金的基金经理助理。
胡伟	-	2017年3月3日	2018年9月7日	十四年	中南财经政法大学经济学硕士,本科学历,曾任珠海市商业银行资金营运部交易员,从事债券研究及债券交易工作,2006年11月加入华富基金管理有限公司,曾任债券交易员,华富货币市场基金基金经理助理、固定收益部副总监,2009年10月19日至2014年11月17日任华富货币市场基金基金经理,2014年8月17日至2015年2月11日任华富灵活配置混合型基金基金经理,2016年6月28日至2017年7月4日任华富灵活配置混合型基金基金经理,2015年3月16日至2018年6月31日任华富旺财保本混合型基金基金经理,2013年4月24日至2018年9月14日任华富保本混合型基金基金经理,2014年5月7日至2018年9月26日任华富恒财定期开放债券型基金基金经理,2017年11月22日至2018年9月26日任华富恒益18个月定期开放债券型基金基金经理,2014年12月17日至2018年9月7日任华富恒稳纯债债券型基金基金经理,2011年10月10日至2018年9月14日任华富收益增强债券型基金基金经理,2015年6月31日至2018年9月14日任华富恒利债券型基金基金经理,2016年3月23日至2018年9月14日任华富安福保本混合型基金基金经理,2016年11月28日至2018年9月7日任华富弘鑫灵活配置混合型基金基金经理,2017年1月26日至2018年9月7日任华富天益货币市场基金基金经理,2017年3月3日至2018年9月7日任华富天盈货币市场基金基金经理,2017年12月13日至2018年9月26日任华富星玉衡一年定期开放混合型基金基金经理,2018年6月21日至2018年9月26日任华富可转债债券型基金基金经理。

注:胡伟的任职日期指该基金成立之日,姚姣姣、倪莉莎的任职日期及胡伟的离任日期指公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上,证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规,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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度以来,经济景气度逐渐趋弱。首先表现在贸易对经济的拉动作用逐渐弱化,中美贸易摩擦影响预期将逐渐显现并得到确认;消费方面,市场对个税调整能否对冲下行压力预期不一,增速回落总体承压;投资方面,货币和财政政策传导至信用宽松渠道是否通畅、实体经济特别是制造业投资回升持续性存疑,积极财政政策有望带动基建投资逐步企稳回升,地产投资受政策主导依然压制。

本季度市场对CPI增速担忧情绪逐渐加重。叠加数据短期受蔬菜和猪肉价格等短期因素冲击,CPI增速略超市场预期。同时,受供给侧调整持续营销,上游生产资料价格上涨明显强于下游加工工业,PPI 环比略超市场预期。综合来看,市场对通货膨胀的预期逐渐加强,但受经济基本面下行预期影响,边际影响可控。

流动性方面,7月以来,资金利率中枢明显下移。央行投放力度明显加大,并表态要加强货币和财政政策的协调。整个三季度,除去地方债缴款等短期扰动因素,债券市场流动性比较稳定充裕,资金流向仍偏向高等级、中短久期资产,即流动性的宽松并未带来信用偏好下沉。

债券市场三季度受通胀预期与地方债供给增加影响,利率品种震荡与调整为主,信用品种之间的利差仍较大,市场对信用风险偏好仍保持较低水平,即更偏好高等级信用。

华富天盈货币市场基金,在本季度流动性较为宽松的环境下,择时积极配置货币市场工具,利用适度的杠杆增强收益。特别是在9月后,在预期经济基本面下行,流动性传统紧张的季末月份收益率回升不明显的前提下,择时配置信用等级高,流动性好的资产,维持适当杠杆水平。同时兼顾本基金久期短,流动性要求高的特点,通过对宏观与债券市场趋势的判断,自上而下地通过择时,为持有人获取稳定收益。

展望四季度,CPI 仍存进一步小幅走高的可能,但在内需总体依旧较为疲弱的情况下,预计全年整体通胀依旧可控。预计四季度经济仍存下行压力,四季度GDP 增速能够稳定回落。货币政策维持适度宽松,但预计将比最宽松时期有所收紧,但资金利率仍有望维持在相对低位。

具体来说,政策上来看,央行货币政策仍将继续适度呵护流动性,资金价格将维持在低位,但持续下跌可能性也不大。主要原因在于宽货币对经济的支撑作用边际影响逐渐减小,特别是经过3季度货币宽松向信用宽松传导并没有立竿见影的作用,故预计四季度资金面仍维持稳定适度宽松。四季度,随着地方债供给高峰已过,债券市场后市下行的主要阻力因素为通货膨胀的担忧和美国国债收益率的走高。但受经济基本面走弱以及资金面充裕的双重支持,四季度债券市场行情预计会跟随以上多空因素的边际变化而变动。需要继续注意的是,受信用环境收紧影响,中小企业、民企等债券市场融资愈发困难,在持续收紧非标融资途径的前提下,四季度信用事件仍可能不断发生和传导,低评级信用利差仍有继续走扩的可能。

经济受内外部多因素影响,下行压力仍较大,政策方面的发力,对经济支撑作用在四季度可能难以立刻显现。但可以预见,财政政策也向更积极的方向转变,减税降费等刺激经济等政策也在推进。因此四季度,市场是否适应了中美贸易摩擦常态化,市场对频繁出台的支持政策的效果预期,是债券市场甚至整个资本市场波动加大的基础。考虑经济的趋势惯性,预计年内我国经济增速将是温和下行的总体态势,对债市中长期看利多,但由于短期支持经济的政策力度可能超预期,短期波动幅度可能增大。

后市策略方面,我们预计政策方面对信用环境的改善提供有力支持,效率高、资质好的企业在融资方面可能受惠,盈利较好、行业优势突出的信用债券更可能获得趋势上的机会。但债务负担沉重、行业景气度低、优势不明显和盲目扩张的企业,在去杠杆的后续影响下信用风险可能点状发生,仍需管理人谨慎挖掘与调研。天盈货币市场基金将继续把控制信用风险和保证流动性放在首要位置,发挥管理人宏观市场研究和信用研究领域的专业性,结合市场行情与预判,通过精细化操作,努力择时,为持有人合理增加收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2017年3月3日正式成立。三季度华富天盈货币A类基金份额净值收益率为0.7341%,期间业绩比较基准0.3403%,期间年化收益率2.9018%。华富天盈货币B类基金份额净值收益率为0.7950%,期间业绩比较基准0.3403%,期间年化收益率3.1419%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	59,991,142.43	49.27
	其中:债券	59,991,142.43	49.27
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	27,180,280.77	22.32
	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	34,080,336.11	27.99
4	其他资产	500,493.93	0.41
5	合计	121,752,453.24	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	4.24
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额(元) / 占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,467,877.77 / 1.24
	其中:买断式回购融资	- / -

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	54
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	69
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

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。

5.3.2 报告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	51.01	1.24
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	20.11	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	8.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	8.33	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	12.50	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.99	1.24

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注:本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,002,960.41	4.17
	其中:政策性金融债	5,002,960.41	4.17
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	35,042,948.51	29.19
6	中期票据	-	-
7	同业存单	19,945,233.51	16.61
8	其他	-	-
9	合计	59,991,142.43	49.96
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。

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011801232	18绍伯租债SCP003	100,000	10,026,308.53	8.35
2	011801182	18恒集SCP006	100,000	10,016,584.84	8.34
3	011801209	18中电投SCP018	100,000	10,000,025.10	8.33
4	111713118	17浙商银行CD118	100,000	9,980,913.96	8.31
5	111814027	18江苏银行CD027	100,000	9,964,319.55	8.30
6	180201	18国开01	50,000	5,002,960.41	4.17
7	011801293	18环球租赁SCP007	50,000	5,000,030.04	4.16

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"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	0.17596%
报告期内偏离度的最低值	0.0517%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.09423%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:报告期内不存在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

注:报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持为人民币1.00元。

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

5.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	500,493.93
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	500,493.93

5.9.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华富天盈货币A	华富天盈货币B
报告期期初基金份额总额	5,822,888.84	112,318,982.99
报告期期间基金总申购份额	23,656,753.17	3,898,074.03
报告期期间基金总赎回份额	20,629,536.99	5,000,000.00
报告期期末基金份额总额	8,850,105.02	111,217,057.02

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投资	2018年7月2日	18,396.02	18,396.02	0.00%
2	红利再投资	2018年7月3日	6,056.76	6,056.76	0.00%
3	红利再投资	2018年7月4日	5,533.06	5,533.06	0.00%
4	红利再投资	2018年7月5日	4,951.53	4,951.53	0.00%
5	红利再投资	2018年7月6日	4,360.92	4,360.92	0.00%
6	红利再投资	2018年7月9日	13,080.89	13,080.89	0.00%
7	红利再投资	2018年7月10日	4,367.62	4,367.62	0.00%
8	红利再投资	2018年7月11日	4,146.88	4,146.88	0.00%
9	红利再投资	2018年7月12日	4,160.07	4,160.07	0.00%
10	红利再投资	2018年7月13日	4,126.11	4,126.11	0.00%
11	红利再投资	2018年7月16日	19,614.23	19,614.23	0.00%
12	红利再投资	2018年7月17日	4,081.89	4,081.89	0.00%
13	红利再投资	2018年7月18日	4,810.20	4,810.20	0.00%
14	红利再投资	2018年7月19日	4,167.28	4,167.28	0.00%
15	红利再投资	2018年7月20日	4,167.52	4,167.52	0.00%
16	红利再投资	2018年7月23日	11,838.03	11,838.03	0.00%
17	红利再投资	2018年7月24日	23,029.05	23,029.05	0.00%
18	红利再投资	2018年7月26日	3,842.62	3,842.62	0.00%
19	红利再投资	2018年7月26日	3,647.61	3,647.61	0.00%
20	红利再投资	2018年7月27日	3,670.37	3,670.37	0.00%
21	红利再投资	2018年7月30日	11,478.12	11,478.12	0.00%
22	红利再投资	2018年7月31日	3,794.64	3,794.64	0.00%
23	红利再投资	2018年8月1日	3,847.78	3,847.78	0.00%
24	红利再投资	2018年8月2日	3,862.34	3,862.34	0.00%
25	红利再投资	2018年8月3日	3,791.68	3,791.68	0.00%
26	红利再投资	2018年8月6日	11,603.19	11,603.19	0.00%
27	红利再投资	2018年8月7日	3,514.83	3,514.83	0.00%
28	红利再投资	2018年8月8日	3,343.00	3,343.00	0.00%
29	红利再投资	2018年8月9日	10,678.12	10,678.12	0.00%
30	红利再投资	2018年8月10日	3,350.46	3,350.46	0.00%
31	红利再投资	2018年8月13日	10,069.92	10,069.92	0.00%
32	红利再投资	2018年8月14日	10,504.02	10,504.02	0.00%
33	红利再投资	2018年8月15日	3,036.50	3,036.50	0.00%
34	红利再投资	2018年8月16日	2,780.99	2,780.99	0.00%
35	红利再投资	2018年8月17日	2,938.06	2,938.06	0.00%
36	红利再投资	2018年8月20日	9,067.93	9,067.93	0.00%
37	红利再投资	2018年8月21日	4,726.64	4,726.64	0.00%
38	红利再投资	2018年8月22日	3,048.24	3,048.24	0.00%
39	红利再投资	2018年8月23日	3,006.17	3,006.17	0.00%
40	红利再投资	2018年8月24日	3,063.78	3,063.78	0.00%
41	申购	2018年8月27日	3,000,000.00	3,000,000.00	0.00%
42	红利再投资	2018年8月27日	9,406.16	9,406.16	0.00%
43	红利再投资	2018年8月28日	198.94	198.94	0.00%
44	红利再投资	2018年8月28日	3,085.57	3,085.57	0.00%
45	红利再投资	2018年8月29日	199.28	199.28	0.00%
46	红利再投资	2018年8月29日	3,090.87	3,090.87	0.00%
47	红利再投资	2018年8月30日	126.57	126.57	0.00%
48	红利再投资	2018年8月30日	1,960.06	1,960.06	0.00%
49	红利再投资	2018年8月31日	3,078.31	3,078.31	0.00%
50	红利再投资	2018年8月31日	198.47	198.47	0.00%
51	红利再投资	2018年9月3日	9,144.31	9,144.31	0.00%
52	红利再投资	2018年9月3日	589.56	589.56	0.00%
53	红利再投资	2018年9月4日	194.86	194.86	0.00%
54	红利再投资	2018年9月4日	3,022.22	3,022.22	0.00%
55	红利再投资	2018年9月5日	196.09	196.09	0.00%
56	红利再投资	2018年9月5日	3,041.47	3,041.47	0.00%
57	红利再投资	2018年9月6日	191.77	191.77	0.00%
58	红利再投资	2018年9月6日	2,974.46	2,974.46	0.00%
59	红利再投资	2018年9月7日	190.54	190.54	0.00%
60	红利再投资	2018年9月7日	2,965.37	2,965.37	0.00%
61	红利再投资	2018年9月10日	581.45	581.45	0.00%
62	红利再投资	2018年9月10日	9,018.52	9,018.52	0.00%
63	红利再投资	2018年9月11日	2,963.37	2,963.37	0.00%
64	红利再投资	2018年9月11日	191.06	191.06	0.00%
65	红利再投资	2018年9月12日	2,949.70	2,949.70	0.00%
66	红利再投资	2018年9月12日	190.18	190.18	0.00%
67	红利再投资	2018年9月13日	192.43	192.43	0.00%
68	红利再投资	2018年9月13日	3,000.10	3,000.10	0.00%
69	红利再投资	2018年9月14日	3,089.69	3,089.69	0.00%
70	红利再投资	2018年9月14日	199.01	199.01	0.00%
71	红利再投资	2018年9月17日	9,314.60	9,314.60	0.00%
72	红利再投资	2018年9月17日	600.64	600.64	0.00%
73	红利再投资	2018年9月18日	200.27	200.27	0.00%
74	红利再投资	2018年9月18日	3,106.25	3,106.25	0.00%
75	红利再投资	2018年9月19日	200.07	200.07	0.00%
76	红利再投资	2018年9月19日	3,103.23	3,103.23	0.00%
77	红利再投资	2018年9月20日	199.07	199.07	0.00%
78	红利再投资	2018年9月20日	3,087.62	3,087.62	0.00%
79	红利再投资	2018年9月21日	200.11	200.11	0.00%
80	红利再投资	2018年9月21日	3,103.74	3,103.74	0.00%
81	红利再投资	2018年9月26日	802.26	802.26	0.00%
82	红利再投资	2018年9月26日	12,443.25	12,443.25	0.00%
83	赎回	2018年9月26日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
84	红利再投资	2018年9月26日	183.61	183.61	0.00%
85	红利再投资	2018年9月26日	2,847.96	2,847.96	0.00%
86	红利再投资	2018年9月27日	199.41	199.41	0.00%
87	红利再投资	2018年9月27日	2,761.20	2,761.20	0.00%
88	红利再投资	2018年9月28日	2,983.93	2,983.93	0.00%
89	红利再投资	2018年9月28日	215.49	215.49	0.00%
合计			8,375,322.86	-1,624,677.14	

注:基金管理人投资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。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	7.1-9.30	51,927,892.36	415,092.94	0.00		52,343,085.30	43.69%
	2	7.1-9.30	46,258,263.75	3,375,322.86	5,000,000.00		44,633,586.61	37.17%
个人	-	-	-	-	-		-	-
产品特有风险								
无								

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、华富天盈货币市场基金基金合同

2、华富天盈货币市场基金托管协议

3、华富天盈货币市场基金招募说明书

4、报告期内华富天盈货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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。

华富恒财定期开放债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月26日

§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责任。

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2018年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2018年7月1日至2018年9月30日。

§2 基金产品概况

转型后:

基金简称	华富恒财分级债券
交易代码	000624
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年8月7日
报告期末基金份额总额	10,460,268.28份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金通过合理灵活的资产配置策略,同时结合组合投资策略等积极把握中国经济增长和债券市场发展机遇,在严格控制投资风险的基础上,追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。
业绩比较基准	中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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
下属分级基金的基金简称	华富恒财定期开放债券A / 华富恒财定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	000624 / 000623
报告期末下属分级基金的份额总额	8,667,237份 / 1,792,031份

转型前:

基金简称	华富恒财分级债券
交易代码	000622
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月7日
报告期末基金份额总额	67,284,291.53份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金通过合理灵活的资产配置策略,同时结合组合投资策略等积极把握中国经济增长和债券市场发展机遇,在严格控制投资风险的基础上,追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。
业绩比较基准	中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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

注:华富恒财分级债券A(000623)8,667.37份,华富恒财分级债券B(000624)67,284,291.53份。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)	
	华富恒财定期开放债券A	华富恒财定期开放债券C
1.本期已实现收益	1,144,174.40	393.40
2.本期利润	-40,658.42	-4.36
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0011	-0.0006
4.期末基金资产净值	10,727,899.72	8,807.61
5.期末基金份额净值	1.0276	1.0162

3.1 主要财务指标(转型前)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年8月6日)
1.本期已实现收益	320,349.12
2.本期利润	1,436,573.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.0183
4.期末基金资产净值	68,415,773.39
5.期末基金份额净值	1.017

3.2 基金净值表现(转型后)

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华富恒财定期开放债券A

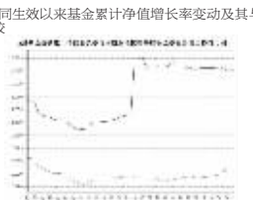
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.06%	0.28%	-0.24%	0.07%	1.30%	0.21%

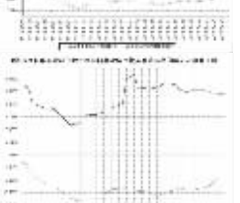
华富恒财定期开放债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.06%	0.13%	-0.24%	0.07%	0.19%	0.06%

注:业绩比较基准收益率=中证全债指数收益率,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累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:本基金转型前为华富恒财分级债券型证券投资基金。根据《华富恒财定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%,但应开放期流动性需要,为保护基金份