

# 富安达现金货币市场证券投资基金

## 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2020 年 04 月 20 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年4月17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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2019年1月1日起至12月31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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 债券回购融资情况	51
8.3 基金投资组合平均剩余期限	52
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	53
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	54
8.8 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	55
8.9 投资组合报告附注	55
§9 基金份额持有人信息	56

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	57
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	57
§10 开放式基金份额变动.....	58
§11 重大事件揭示.....	58
11.1 基金份额持有人大会决议.....	58
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
11.4 基金投资策略的改变.....	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	63
11.9 其他重大事件.....	63
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§13 备查文件目录.....	67
13.1 备查文件目录.....	67
13.2 存放地点.....	68
13.3 查阅方式.....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富安达现金货币市场证券投资基金	
基金简称	富安达现金货币	
基金主代码	710501	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年01月29日	
基金管理人	富安达基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	717,237,581.77份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富安达现金货币A	富安达现金货币B
下属分级基金的交易代码	710501	710502
报告期末下属分级基金的份额总额	35,365,279.56份	681,872,302.21份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将在保持基金资产安全性和高流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金管理人采用自上而下的富安达多维经济模型，运用定性与定量分析方法，通过对宏观经济指标的分析，包括全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平变动趋势、市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、货币供应量等，对短期利率走势进行综合判断，并根据动态预期决定和调整组合的平均剩余期限。在预期市场利率水平将上升时，适度缩短投资组合的平均剩余期限；在预期市场利率水平将下降时，适度延长投资组合的平均剩余期限。
业绩比较基准	同期活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金是货币市场基金，其长期风险和预期收益率低于股票型基金、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	富安达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李理想
	联系电话	021-61870999
	电子邮箱	service@fadfunds.com
客户服务电话	400-630-6999	95559
传真	021-61870888	021-62701216
注册地址	上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）长宁区仙霞路1 8号
邮政编码	200122	200336
法定代表人	蒋晓刚	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号普华永道中心11 楼
注册登记机构	富安达基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1568号中 建大厦29楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2019年		2018年		2017年	
	富安达现 金货币 A	富安达现 金货币 B	富安达现 金货币 A	富安达现 金货币 B	富安达现 金货币 A	富安达现 金货币 B
本期已实现 收益	946,537. 73	16,677,6 57.05	3,236,03 3.13	15,144,2 23.01	4,513,21 0.72	12,605,2 97.75
本期利润	946,537. 73	16,677,6 57.05	3,236,03 3.13	15,144,2 23.01	4,513,21 0.72	12,605,2 97.75
本期净值收 益率	2.2847%	2.5307%	3.1547%	3.4040%	3.8547%	4.1035%
3.1.2 期末 数据和指标	2019年末		2018年末		2017年末	
期末基金资 产净值	35,365,2 79.56	681,872, 302.21	48,875,1 56.27	577,622, 842.84	342,519, 898.99	630,304, 657.81
期末基金份 额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计 期末指标	2019年末		2018年末		2017年末	
累计净值收 益率	25.2674%	27.3693%	22.4694%	24.2255%	18.7240%	20.1361%

注：

1. 本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。
2. 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。由于本基金为采用摊余成本法核算的货币市场基金，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. 本基金收益分配按月结转份额。

## 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

富安达现金货币A

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.5576%	0.0027%	0.0883%	0.0000%	0.469 3%	0.002 7%
过去六个月	1.1280%	0.0022%	0.1766%	0.0000%	0.951 4%	0.002 2%
过去一年	2.2847%	0.0025%	0.3506%	0.0000%	1.934 1%	0.002 5%
过去三年	9.5786%	0.0047%	1.0555%	0.0000%	8.523 1%	0.004 7%
过去五年	16.3480%	0.0077%	1.7664%	0.0000%	14.581 6%	0.007 7%
自基金合同 生效起至今	25.2674%	0.0081%	2.4537%	0.0000%	22.813 7%	0.008 1%

## 富安达现金货币B

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.6184%	0.0027%	0.0883%	0.0000%	0.530 1%	0.002 7%
过去六个月	1.2505%	0.0022%	0.1766%	0.0000%	1.073 9%	0.002 2%
过去一年	2.5307%	0.0025%	0.3506%	0.0000%	2.180 1%	0.002 5%
过去三年	10.3714%	0.0047%	1.0555%	0.0000%	9.315 9%	0.004 7%
过去五年	17.7536%	0.0077%	1.7664%	0.0000%	15.987 2%	0.007 7%
自基金合同 生效起至今	27.3693%	0.0081%	2.4537%	0.0000%	24.915 6%	0.008 1%

注：本基金业绩比较基准为同期活期存款利率（税后）。

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

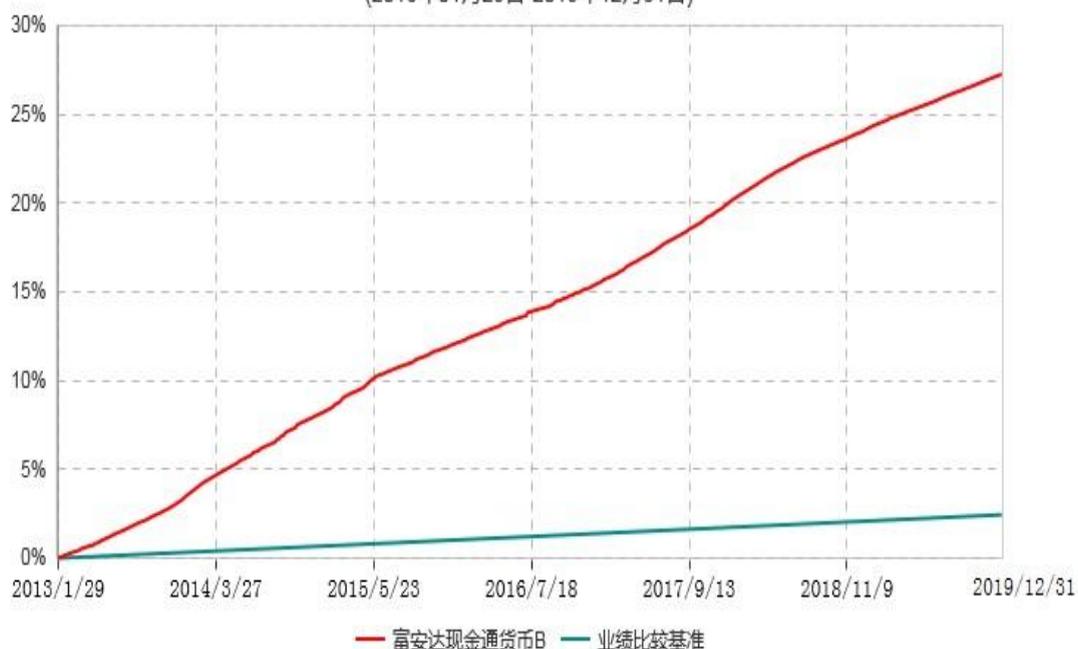
富安达现金货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年01月29日-2019年12月31日)



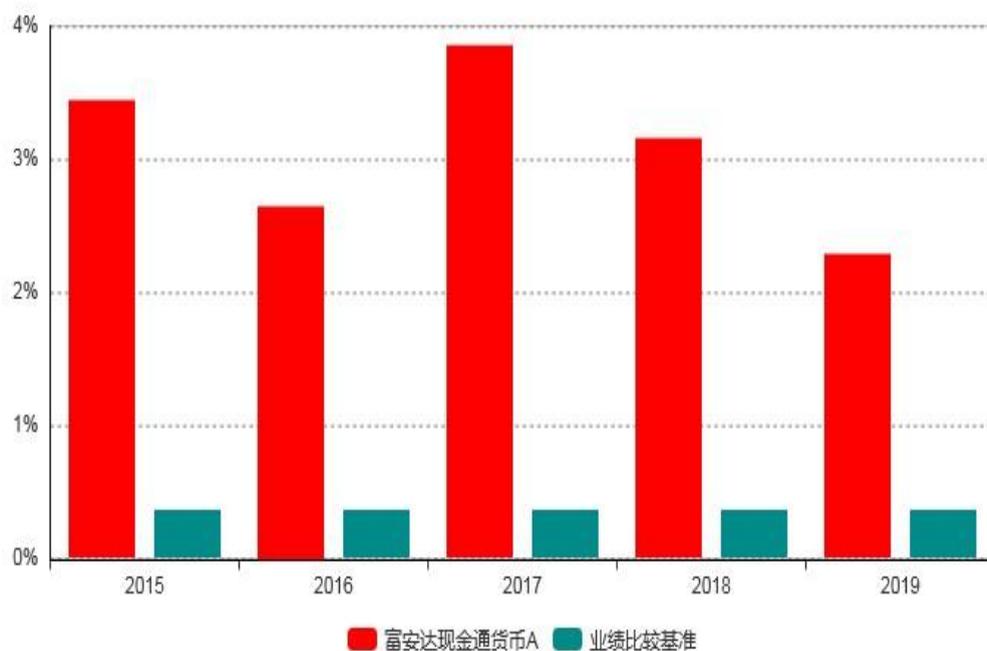
富安达现金货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

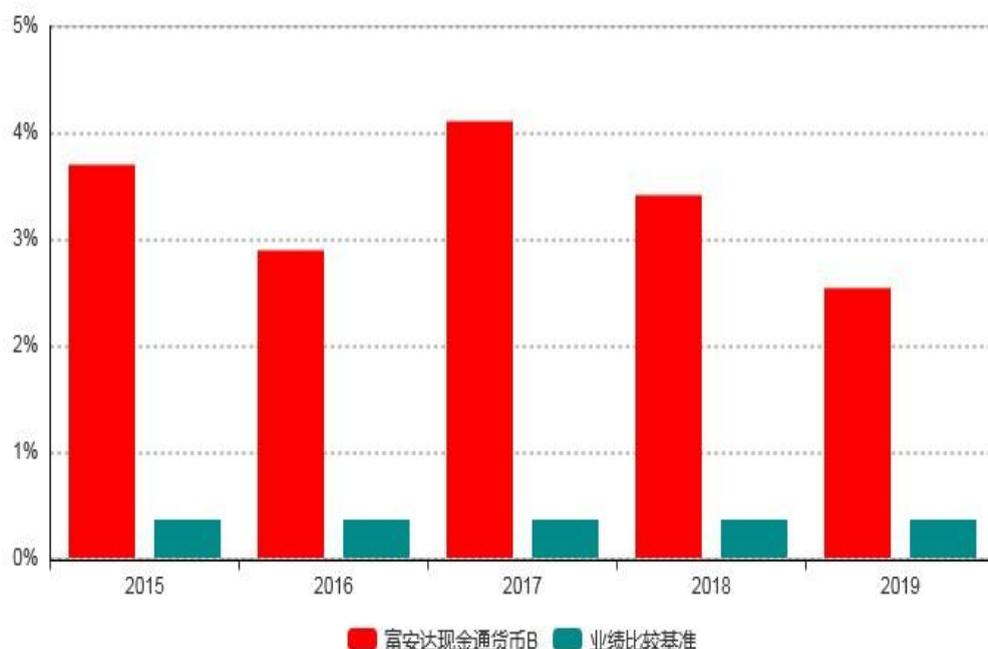
(2013年01月29日-2019年12月31日)



注：本基金于 2013 年 1 月 29 日成立。根据《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》规定，本基金建仓期为 6 个月，建仓截止日为 2013 年 7 月 28 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 富安达现金货币A

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应 付赎回款转 出金额	应付利润本 年变动	年度利润分配合 计	备注
2019年	949,240.87	-	-2,703.14	946,537.73	-
2018年	3,289,903.47	-	-53,870.34	3,236,033.13	-
2017年	4,461,104.50	-	52,106.22	4,513,210.72	-
合计	8,700,248.84	-	-4,467.26	8,695,781.58	-

#### 富安达现金货币B

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应 付赎回款转 出金额	应付利润本 年变动	年度利润分配合 计	备注
2019年	16,692,973.79	-	-15,316.74	16,677,657.05	-
2018年	15,195,429.27	-	-51,206.26	15,144,223.01	-

2017年	12,530,315.71	-	74,982.04	12,605,297.75	-
合计	44,418,718.77	-	8,459.04	44,427,177.81	-

## § 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

富安达基金管理有限公司由南京证券股份有限公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司三家单位共同发起设立。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦，注册资本8.18亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念，以基金持有人利益最大化为首要经营目标，为客户提供卓越的理财服务。

截至2019年12月31日，公司共管理十二只开放式基金：富安达优势成长混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达现金货币市场证券投资基金、富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金、富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金、富安达消费主题灵活配置混合型证券投资基金、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达中证500指数增强型证券投资基金。

#### 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		
张凯瑜	本基金的基金经理	2013-01-29	-	11年	硕士。历任太平人寿保险有限公司产品市场部产品管理员；爱建证券有限责任公司固定收益部债券交易员。2011年5月加入富安达基金管理有限公司。2013年1月起任富安达现金通

					货币市场证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金基金经理（2013年10月25日至2016年10月25日期间）、富安达长盈保本混合型证券投资基金的基金经理（2016年7月22日至2018年5月21日期间）、富安达富利纯债债券型证券投资基金的基金经理。
孙辰 旻	本基金的基金经理助理	2019- 09-25	-	6 年	硕士。历任富安达资产管理（上海）有限公司产品设计专员。2016年3月加入富安达基金管理有限公司任交易员。2019年9月起任富安达现金货币市场证券投资基金基金经理助理兼债券研究员。

注：

1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，任职日期为基金合同生效日。
2. 证券从业的含义遵从行业协会关于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合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

本基金无违法、违规行为。

本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》，并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系，涵盖了所有投资组合，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节，确保公平对待旗下的每一个投资组合。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截止报告日，公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析，按照特定计算周期，分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异，未发现公平交易异常情形。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

### 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

报告期内，全年经济和金融市场波动不断，股票市场行情较好，债券市场阶段性承压，整体表现波澜不惊，年末债券迎来牛市行情。在经济下滑、中美贸易摩擦、人民币贬值的背景下，市场避险情绪升温，债券市场有所表现。年末，央行通过下调MLF利率、降准等措施，给予了市场充分的流动性。2019年底以来爆发的新型冠状病毒疫情，对金融市场造成一定的影响。2020年初，股市在受到短暂冲击之后企稳，但随着海外疫情的爆发，股市又出现下跌；债市则持续牛市行情。报告期内，民企与低等级企业盈利能力较弱，负债到期有结构性压力，债券违约事件不断。我们在报告期内，坚持选择短久期、低风险的资产，在严格控制风险、确保流动性的前提下，根据市场波动情况对持仓进行灵活调整。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达现金货币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2.2591%，同期业绩比较基准收益率为0.3506%；截至报告期末富安达现金货币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2.5307%，同期业绩比较基准收益率为0.3506%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020年债券到期规模较大。今年以来，债券市场利率整体下行，流动性持续宽裕。债券市场发行量增加，一级市场需求旺盛。短期来看，经济数据短期向好；受新型冠状

病毒疫情因素影响，通胀超出市场预期；地方债供给等因素，债券市场可能会有阶段性调整。今年以来，债券市场短端利率较低，期限利差高，信用债收益率和利差维持低位，但低评级利差仍然较高，加上债券违约事件不断，市场对低信用保持谨慎。对货币基金来说，类货币基金理财产品对标货币基金的政策可能利好短久期债券。货币政策大概率会维持宽松。债券市场的走势预计将向着基本面以及流动性等因素为重心回归，考虑到疫情仍未结束，企业复工持续拖延，经济仍继续承压，债券市场仍有交易性机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人持续推进内控体系和机制建设，强化内部管理，不断提升自身合规风控能力。报告期内，公司进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，强化内控基础建设；牵头开展了多形式的合规培训，强化员工职业道德教育和合规意识培育，从源头上防范合规风险；建立健全防控内幕交易机制，确保基金投资的独立性、公平性和合规性；加强业务日常合规审核和合规监测，并加大对重要业务和关键业务环节的监督检查，确保各项法规和管理制度有效落实，使业务在可稽可控的范围内有序开展。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，建立健全全面风险管理体系，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保护基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司总经理担任估值委员会主席，研究发展部、投资管理部、监察稽核部和基金事务部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金每日计算分配收益，收益分配采用红利再投资方式，按月结转份额。

本报告期内本基金A类收益分配金额为949,240.87元，B类收益分配金额为16,692,973.79元。

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

无

### § 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，托管人在富安达现金货币市场证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，富安达基金管理有限公司在富安达现金货币市场证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向A级份额持有人分配利润：946,537.73元，向B级份额持有人分配利润：16,677,657.05元。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达现金货币市场证券投资基金的年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第20964号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	富安达现金货币市场证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了富安达现金货币市场证券投资基金(以下简称“富安达现金通基金”)的财务报表,包括2019年12月31日的资产负债表,2019年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了富安达现金通基金2019年12月31日的财务状况以及2019年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于富安达现金通基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	富安达现金通基金的基金管理人富安达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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

	<p>作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估富安达现金通基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算富安达现金通基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督富安达现金通基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发</p>

	<p>表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对富安达现金通基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致富安达现金通基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	陈熹   陶文欣
会计师事务所的地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2020-04-17

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：富安达现金通货币市场证券投资基金

报告截止日：2019年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	160,269,275.80	165,000,235.97
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	349,451,602.28	271,115,022.52
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		349,451,602.28	271,115,022.52
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	206,800,990.21	170,980,936.48
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,815,159.66	3,700,206.81
应收股利		-	-
应收申购款		37,655.00	16,519,250.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		718,374,682.95	627,315,652.32
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年12月31日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		302,358.56	-
应付管理人报酬		267,450.07	165,920.59
应付托管费		81,045.48	50,278.96
应付销售服务费		15,396.73	15,211.12
应付交易费用	7.4.7.7	23,875.04	18,589.95
应交税费		-	2,842.75
应付利息		-	-
应付利润		47,789.96	65,809.84
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	399,185.34	499,000.00
负债合计		1,137,101.18	817,653.21
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	717,237,581.77	626,497,999.11
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		717,237,581.77	626,497,999.11
负债和所有者权益总计		718,374,682.95	627,315,652.32

注：报告截止日2019年12月31日，富安达现金通A类基金和富安达现金通B类基金份额净值均为1.0000元，基金份额总额717,237,581.77份，其中富安达现金通A类基金份额35,365,279.56份，富安达现金通B类基金份额681,872,302.21份。

## 7.2 利润表

会计主体：富安达现金货币市场证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年01月01日至2019年12月31日	上年度可比期间2018年01月01日至2018年12月31日
一、收入		21,193,791.78	21,369,907.90
1. 利息收入		20,642,950.48	20,663,667.22
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,067,718.41	6,633,637.32

债券利息收入		11,450,793.52	8,808,852.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,124,438.55	5,221,177.23
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		550,841.30	706,240.68
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	550,841.30	706,240.68
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		3,569,597.00	2,989,651.76
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	2,364,379.52	1,823,572.70
2. 托管费	7.4.10.2. 2	716,478.70	552,597.75
3. 销售服务费	7.4.10.2. 3	171,984.90	287,822.04
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		88,395.04	54,975.35

其中：卖出回购金融资产支出		88,395.04	54,975.35
6. 税金及附加		549.61	2,878.39
7. 其他费用	7.4.7.20	227,809.23	267,805.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,624,194.78	18,380,256.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,624,194.78	18,380,256.14

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达现金货币市场证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	626,497,999.11	-	626,497,999.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,624,194.78	17,624,194.78
三、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)	90,739,582.66	-	90,739,582.66
其中：1. 基金申购款	1,394,707,761.31	-	1,394,707,761.31
2. 基金赎回款	-1,303,968,178.65	-	-1,303,968,178.65
四、本期向基金份	-	-17,624,194.78	-17,624,194.78

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)			
五、期末所有者权益(基金净值)	717,237,581.77	-	717,237,581.77
项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	972,824,556.80	-	972,824,556.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,380,256.14	18,380,256.14
三、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)	-346,326,557.69	-	-346,326,557.69
其中：1. 基金申购款	1,302,838,539.15	-	1,302,838,539.15
2. 基金赎回款	-1,649,165,096.84	-	-1,649,165,096.84
四、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)	-	-18,380,256.14	-18,380,256.14
五、期末所有者权益(基金净值)	626,497,999.11	-	626,497,999.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

蒋晓刚

孙爱民

孙爱民

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

富安达现金货币市场证券投资基金(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[2012] 1440号《关于核准富安达现金货币市场证券投资基金募集的批复》核准,由富安达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《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》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人民币993,919,179.25元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第25号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》于2013年1月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为994,024,416.12份基金份额,其中认购资金利息折合105,236.87份基金份额。本基金的基金管理人为富安达基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据经批准的《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》和《富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据投资者认(申)购的金额,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,形成A类和B类两类基金份额,其中A类基金份额按照0.25%的年费率计提销售服务费,B类基金份额按照0.01%的年费率计提销售服务费。本基金A类、B类两种收费模式并存,各类基金份额分别设置基金代码,并单独公布每万份基金净收益和7日年化收益率。投资者可自行选择认(申)购的基金份额等级,不同基金份额等级之间不得互相转换,但因认购、申购、赎回、基金转换等交易而发生的基金份额自动升级或者降级的除外。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,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(397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及中国证监会、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:同期活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于2020年4月17日批准报出。

### 7.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年度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2019年12月31日的财务状况以及2019年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损

益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，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；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致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，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的A和B类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产自持证券处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。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元分配后转入所有者权益，每月集中宣告收益分配并将当月收益结转至投资人基金账户。

#### 7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
活期存款	269,275.80	235.97
定期存款	160,000,000.00	165,000,000.00

其中：存款期限1个月以内	90,000,000.00	75,000,000.00
存款期限1-3个月	70,000,000.00	60,000,000.00
存款期限3个月以上	-	30,000,000.00
其他存款	-	-
合计	160,269,275.80	165,000,235.97

注：定期存款期限指于资产负债表日定期存单剩余到期期限。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	349,451,602.28	349,770,000.00	318,397.72	0.0444
	合计	349,451,602.28	349,770,000.00	318,397.72	0.0444
资产支持证券		-	-	-	-
合计		349,451,602.28	349,770,000.00	318,397.72	0.0444
项目		上年度末2018年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	271,115,022.52	271,436,900.00	321,877.48	0.0514
	合计	271,115,022.52	271,436,900.00	321,877.48	0.0514
资产支持证券		-	-	-	-
合计		271,115,022.52	271,436,900.00	321,877.48	0.0514

注：

1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；
2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	206,800,990.21	-
合计	206,800,990.21	-
项目	上年度末2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	170,980,936.48	-
合计	170,980,936.48	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	663.63	42.40
应收定期存款利息	627,850.00	700,520.05
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	3,852.00	-
应收债券利息	1,019,243.55	2,688,288.22
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	163,550.48	311,356.14
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	1,815,159.66	3,700,206.81

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	23,875.04	18,589.95
合计	23,875.04	18,589.95

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	185.34	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	399,000.00	499,000.00
合计	399,185.34	499,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 富安达现金货币A

金额单位：人民币元

项目 (富安达现金货币A)	本期2019年01月01日至2019年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	48,875,156.27	48,875,156.27
本期申购	82,553,556.03	82,553,556.03
本期赎回(以“-”号填列)	-96,063,432.74	-96,063,432.74
本期末	35,365,279.56	35,365,279.56

##### 7.4.7.9.2 富安达现金货币B

金额单位：人民币元

项目 (富安达现金货币B)	本期2019年01月01日至2019年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	577,622,842.84	577,622,842.84
本期申购	1,312,154,205.28	1,312,154,205.28
本期赎回(以“-”号填列)	-1,207,904,745.91	-1,207,904,745.91
本期末	681,872,302.21	681,872,302.21

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

## 7.4.7.10.1 富安达现金货币A

单位：人民币元

项目 (富安达现金货币A)	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	946,537.73	-	946,537.73
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	-946,537.73	-	-946,537.73
本期末	-	-	-

## 7.4.7.10.2 富安达现金货币B

单位：人民币元

项目 (富安达现金货币B)	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	16,677,657.05	-	16,677,657.05
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	-16,677,657.05	-	-16,677,657.05
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年12月31日	上年度可比期间2018年01月01日至2018年12月31日
活期存款利息收入	11,770.03	4,097.35
定期存款利息收入	2,982,886.91	6,610,511.56
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	73,061.47	19,028.41
其他	-	-
合计	3,067,718.41	6,633,637.32

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	550,841.30	706,240.68
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	550,841.30	706,240.68

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,913,533,367.74	1,512,148,372.21
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,900,549,785.86	1,495,434,484.40
减：应收利息总额	12,432,740.58	16,007,647.13
买卖债券差价收入	550,841.30	706,240.68

**7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无股利收益。

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无公允价值变动收益。

**7.4.7.18 其他收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

**7.4.7.19 交易费用**

本基金本报告期内及上年度可比期间无交易费用。

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年 12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	160,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	11,809.23	11,605.53
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	-	200.00
合计	227,809.23	267,805.53

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富安达基金管理有限公司（“富安达基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
南京证券股份有限公司（“南京证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
江苏交通控股有限公司（“江苏交通”）	基金管理人的股东
南京市河西新城国有资产经营控股（集团）有限责任公司（“南京河西”）	基金管理人的股东
富安达资产管理（上海）有限公司（“富安达资管”）	基金管理人的全资子公司

注：

1. 本报告期内，关联方关系未发生变化。
2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至201 9年12月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至201 8年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,364,379.52	1,823,572.70
其中：支付销售机构的客户维护费	56,021.63	105,356.07

注：

1. 支付基金管理人富安达基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%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×0.33%÷当年天数。
2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服

务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	716,478.70	552,597.75

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%÷当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2019年01月01日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达现金货币A	富安达现金货币B	合计
富安达基金	8,841.44	65,826.42	74,667.86
交通银行	18,753.28	0.00	18,753.28
南京证券	5,427.02	0.00	5,427.02
合计	33,021.74	65,826.42	98,848.16
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达现金货币A	富安达现金货币B	合计
富安达基金	11,298.12	42,550.65	53,848.77
交通银行	37,067.41	0.00	37,067.41
南京证券	2,657.86	0.00	2,657.86

合计	51,023.39	42,550.65	93,574.04
----	-----------	-----------	-----------

注：支付基金销售机构的销售服务费分别按前一日A类基金份额和B类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给富安达基金，再由富安达基金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类基金份额的基金资产净值 × 约定年费率 ÷ 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

富安达现金货币A

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12 月31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	0.00	0.00

份额		
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%

富安达现金货币B

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月31日
报告期初持有的基金份额	51,728,485.55	72,559,238.77
报告期间申购/买入总份额	31,086,188.74	39,169,246.78
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	39,000,000.00	60,000,000.00
报告期末持有的基金份额	43,814,674.29	51,728,485.55
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.11%	8.26%

注：

1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入和级别调整入份额；赎回/卖出总份额含转换出、级别调整出份额。
2. 基金管理人富安达基金在本会计期间申购、赎回本基金的交易委托直销办理，无申购、赎回费用。
3. “报告期末持有的基金份额占基金总份额比例”的计算中，基金总份额为基金份额总额，并对上年度末数据按照上述方法进行重述。

4. 本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资富安达现金货币A类基金份额。

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

份额单位：份

富安达现金货币B

关联方名称	本期末 2019年12月31日		上年度末 2018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
富安达资管	104,062,013.88	14.51%	194,301,059.48	31.01%
南京证券	0.00	0.0000%	10,097,482.01	1.61%

注：

1. “报告期末持有的基金份额占基金总份额比例”的计算中，基金总份额为基金份额总额。
2. 本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资富安达现金货币A类基金份额。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行—活期存款	269,275.80	11,770.03	235.97	4,097.35

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金

富安达现金货币A

单位：人民币元

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
949,240.87	-	-2,703.14	946,537.73	-

富安达现金货币B

单位：人民币元

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
16,692,973.79	-	-15,316.74	16,677,657.05	-

#### 7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只主动管理型货币型基金，其长期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，运用理性分析价值，严格控制风险，通过积极的主动管理优化基金的风险与收益，为投资人带来长期稳定的回报。

本基金的基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系，贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。本基金的基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金的基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的合规与风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金的基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本基金的基金管理人设立了独立于各业务部门的监察稽核部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期出具监察稽核报告，报公司督察长、董事会及中国证监会。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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交通银行；定期存款存放在具有基金托管资格的上海银行股份有限公司，民生银行股份有限公司，徽商银行股份有限公司和广发银行股份有限公司，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，不投资于信用等级在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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
A-1	160,001,167.02	110,098,264.63
A-1以下	-	-
未评级	-	46,035,952.54
合计	160,001,167.02	156,134,217.17

注：未评级债券为政策性金融债和短期融资券。

#### 7.4.13.2.2 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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	139,381,023.56	74,928,617.63
合计	139,381,023.56	74,928,617.63

注：同业存单无债项评级。

#### 7.4.13.2.3 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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	50,069,411.70	40,052,187.72

合计	50,069,411.70	40,052,187.72
----	---------------	---------------

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 7.4.13.3 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2019年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

##### 7.4.13.3.1 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2019年12月31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89.55%，本基金投资组合的平均剩余期限为24天，平均剩余存续期为30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超过30%。

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2019年12月31日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的10%。

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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年	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

12月31日							
资产							
银行存款	90,269,275.80	70,000,000.00	-	-	-	-	160,269,275.80
交易性金融资产	209,919,831.45	129,718,781.86	9,812,988.97	-	-	-	349,451,602.28
买入返售金融资产	206,800,990.21	-	-	-	-	-	206,800,990.21
应收利息	-	-	-	-	-	1,815,159.66	1,815,159.66
应收申购款	-	-	-	-	-	37,655.00	37,655.00
资产总计	506,990,097.46	199,718,781.86	9,812,988.97	-	-	1,852,814.66	718,374,682.95
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	302,358.56	302,358.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	267,450.07	267,450.07
应付托管费	-	-	-	-	-	81,045.48	81,045.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,396.73	15,396.73
应付交易费用	-	-	-	-	-	23,875.04	23,875.04
应付利润	-	-	-	-	-	47,789.96	47,789.96
其他负债	-	-	-	-	-	399,185.34	399,185.34
负债总计	-	-	-	-	-	1,137,101.18	1,137,101.18
利率敏感度缺口	506,990,097.46	199,718,781.86	9,812,988.97	-	-	715,713.48	717,237,581.77
上年度末2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	75,000,235.97	60,000,000.00	30,000,000.00	-	-	-	165,000,235.97

款							7
交易性金融资产	144,934,651.40	40,018,617.03	86,161,754.09	-	-	-	271,115,022.52
买入返售金融资产	170,980,936.48	-	-	-	-	-	170,980,936.48
应收利息	-	-	-	-	-	3,700,206.81	3,700,206.81
应收申购款	-	-	-	-	-	16,519,250.54	16,519,250.54
资产总计	390,915,823.85	100,018,617.03	116,161,754.09	-	-	20,219,457.35	627,315,652.32
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	165,920.59	165,920.59
应付托管费	-	-	-	-	-	50,278.96	50,278.96
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,211.12	15,211.12
应付交易费用	-	-	-	-	-	18,589.95	18,589.95
应交税费	-	-	-	-	-	2,842.75	2,842.75
应付利润	-	-	-	-	-	65,809.84	65,809.84
其他负债	-	-	-	-	-	499,000.00	499,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	817,653.21	817,653.21
利率敏感度缺口	390,915,823.85	100,018,617.03	116,161,754.09	-	-	19,401,804.14	626,497,999.11

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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 (单位：人民币元)

	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
1. 市场利率下降25个基点	75,335.43	95,287.70
2. 市场利率上升25个基点	-75,278.21	-95,170.61

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2019年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为349,451,602.28元，无属于第一或第三层次的余额(2018年12月31日：第二层次271,115,022.52元，无第一或第三层次)。

##### (ii) 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。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	349,451,602.28	48.64
	其中：债券	349,451,602.28	48.64
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	206,800,990.21	28.79
	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	160,269,275.80	22.31
4	其他各项资产	1,852,814.66	0.26
5	合计	718,374,682.95	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.48	
	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	-	-
	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

本基金本报告期内，不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	24
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	16

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	66.51	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	30.64	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	1.38	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	1.37	-
	其中：剩余存续期超过397天	-	-

	的浮动利率债		
	合计	99.90	-

注：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

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过240天的情况。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,069,411.70	6.98
	其中：政策性金融债	50,069,411.70	6.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	160,001,167.02	22.31
6	中期票据	-	-
7	同业存单	139,381,023.56	19.43
8	其他	-	-
9	合计	349,451,602.28	48.72
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

#### 8.6 期末按摊余成本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)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	130217	13国开17	500,000	50,069,411.70	6.98

2	071900112	19浙商证券CP004	300,000	30,000,175.88	4.18
3	071900114	19东北证券CP007	300,000	30,000,075.70	4.18
4	071900143	19东北证券CP008	200,000	20,000,260.05	2.79
5	071900142	19渤海证券CP011	200,000	20,000,253.86	2.79
6	071900149	19天风证券CP005	200,000	20,000,080.80	2.79
7	071900117	19天风证券CP004	200,000	20,000,023.10	2.79
8	111970174	19天津银行CD267	200,000	19,973,111.25	2.78
9	111991148	19西安银行CD002	200,000	19,948,521.28	2.78
10	111921395	19渤海银行CD395	200,000	19,928,277.24	2.78

### 8.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0968%
报告期内偏离度的最低值	0.0010%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0277%

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本基金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

本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

## 8.8 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。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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。

8.9.2 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,815,159.66
4	应收申购款	37,655.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,852,814.66

## 8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
			机构投资者		个人投资者		机构	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
富安达现金货币A	17,721	1,995.67	4,418,854.87	12.49%	30,946,424.69	87.51%	4,418,854.87	12.49%
富安达现金货币B	10	68,187,230.22	681,872,302.21	100.00%	0.00	0.00%	681,872,302.21	100.00%
合计	17,731	40,451.05	686,291,157.08	95.69%	30,946,424.69	4.31%	686,291,157.08	95.69%

							7.	
							08	

### 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	机构	285,264,624.68	39.77%
2	机构	104,062,013.88	14.51%
3	机构	76,641,621.91	10.69%
4	机构	50,000,000.00	6.97%
5	机构	43,814,674.29	6.11%
6	机构	37,721,730.77	5.26%
7	机构	33,249,493.05	4.64%
8	机构	30,052,462.67	4.19%
9	机构	11,800,000.00	1.65%
10	机构	7,868,729.52	1.10%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	富安达现金货币A	18,211.84	0.05%
	富安达现金货币B	0.00	0.00%
	合计	18,211.84	0.00%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	富安达现金货币A	0~10
	富安达现金货币B	0

	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	富安达现金货币A	0
	富安达现金货币B	0
	合计	0

注：

1. 基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为0至10万份（含）。
2. 本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	富安达现金货币A	富安达现金货币B
基金合同生效日(2013年01月29日)基金份额总额	605,313,583.32	388,710,832.80
本报告期期初基金份额总额	48,875,156.27	577,622,842.84
本报告期基金总申购份额	82,553,556.03	1,312,154,205.28
减：本报告期基金总赎回份额	96,063,432.74	1,207,904,745.91
本报告期期末基金份额总额	35,365,279.56	681,872,302.21

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人的重大人事变动：

2019年1月4日，公司股东会解除靳向东同志公司董事会职务，同时聘任杜文毅同志担任公司股东董事；解除杜文毅同志公司监事会职务，同时聘任孙玮同志担任公司股东监事。

2019年5月29日，公司召开全体职工大会免去孙爱民先生职工监事职务。

2019年5月30日，公司发布《富安达基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，聘任孙爱民先生担任公司首席信息官。

2019年12月25日，公司召开全体职工大会，选举戚明龙先生为职工监事。

上述变动中的高级管理人员变更事项已按规定报中国证监会上海监管局及中国基金业协会备案。

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。

### 11.3 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、基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为60,000元人民币。

截至本报告期末，该事务所已向本基金提供7年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
新时代证	1	-	-	-	-	-

券						
西南 证券	1	-	-	-	-	-
华创 证券	1	-	-	-	-	-
浙商 证券	1	-	-	-	-	-
信达 证券	1	-	-	-	-	-
银河 证券	1	-	-	-	-	-
西部 证券	1	-	-	-	-	-
海通 证券	1	-	-	-	-	-
光大 证券	1	-	-	-	-	-
国泰 君安	1	-	-	-	-	-
安信 证券	1	-	-	-	-	-
红塔 证券	1	-	-	-	-	-
中金 公司	1	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
华龙 证券	2	-	-	-	-	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投	2	-	-	-	-	-

国盛 证券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
中投 证券	2	-	-	-	-	-
华宝 证券	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	-	-	-	-	-
西藏 东财	2	-	-	-	-	-
东兴 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源	2	-	-	-	-	-
东方 证券	2	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	-
招商 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	-	-	-	-	-
南京 证券	2	-	-	-	-	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
国海 证券	2	-	-	-	-	-
长江 证券	2	-	-	-	-	-

华金 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
方正 证券	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	3	-	-	-	-	-

注：

1. 为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

（一）财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与公司具有互补性、最近一年内无重大违法违规行为发生；

（二）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（三）能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及其他信息咨询服务；

（四）能根据公司特定要求，提供专门研究报告；

（五）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；能够提供很好的交易执行。

2. 券商专用交易单元选择程序：

（一）券商席位由投资管理部与研究发展部业务人员推荐，经投资管理部、研究发展部部门会议讨论，形成重点评估的券商备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的券商个数不得少于最后选择个数的二倍。

（二）投资管理部、研究发展部全体业务人员遵照券商选择标准的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成券商排名及专用席位租用意见，报公司总经理批准。

（三）公司应与被选择的券商签订书面委托代理协议，明确双方公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。

（四）若签约券商的服务不能满足要求，或签约券商违法违规受到国家有关部门的处罚，公司可以提前终止签署的协议，并撤销租用的席位。

3. 在上述租用的券商交易单元中，(006119)东北证券、(40533)东北证券、(45222)华西

证券、(008920)华西证券为本基金本期新增的交易单元。本基金本期剔除交易单元：  
(004602)华宝证券、(39241)华宝证券、(004507)方正证券。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

### 11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富安达基金管理有限公司2018年12月31日基金净值公告	指定媒介	2019-01-01
2	富安达基金管理有限公司关于基金经理恢复履行职务的公告	指定媒介	2019-01-03
3	富安达现金货币市场证券投资基金2018年第四季度报告	指定媒介	2019-01-19
4	关于富安达现金货币市场证券投资基金2019年春节假期前暂停大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	指定媒介	2019-01-29
5	富安达基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	指定媒介	2019-01-29
6	富安达现金货币市场证券投资基金更新招募说明书（二〇一九年第一号）正文及摘要	指定媒介	2019-03-08
7	富安达现金货币市场证券投资基金2018年年度报告正	指定媒介	2019-03-30

	文及摘要		
8	富安达基金管理有限公司关于与通联支付合作开通招商银行、农业银行、华夏银行及民生银行借记卡网上直销业务并开展费率优惠活动的公告	指定媒介	2019-04-10
9	富安达现金货币市场证券投资基金2019年第一季度报告	指定媒介	2019-04-20
10	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加阳光人寿为代销机构并开通转换业务的公告	指定媒介	2019-04-20
11	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2019-04-24
12	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加西藏东方财富证券股份有限公司代销机构及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2019-04-26
13	富安达基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	指定媒介	2019-05-30
14	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加长江证券为代销机构并开通转换业务的公告	指定媒介	2019-06-05
15	富安达基金管理有限公司关于参加中信证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告	指定媒介	2019-07-01
16	富安达基金管理有限公司20	指定媒介	2019-07-01

	19年6月30日基金净值公告		
17	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加中国人寿为代销机构并开通定投及转换业务的公告	指定媒介	2019-07-17
18	富安达现金货币市场证券投资基金2019年第二季度报告	指定媒介	2019-07-18
19	富安达基金关于参加安信证券费率优惠活动的公告（放开费率折扣限制）	指定媒介	2019-07-29
20	富安达现金货币市场证券投资基金2019年半年度报告	指定媒介	2019-08-27
21	富安达现金货币市场证券投资基金2019年半年度报告摘要	指定媒介	2019-08-27
22	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	指定媒介	2019-08-29
23	富安达现金货币市场证券投资基金更新招募说明书（二〇一九年第二号）	指定媒介	2019-09-05
24	富安达现金货币市场证券投资基金更新招募说明书（二〇一九年第二号）摘要	指定媒介	2019-09-05
25	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	指定媒介	2019-09-21
26	富安达基金管理有限公司关于修订旗下九只基金产品基金合同有关条款的公告	指定媒介	2019-10-22
27	富安达现金货币市场证券投资基金基金合同	指定媒介	2019-10-22
28	富安达现金货币市场证券投资基金托管协议	指定媒介	2019-10-22

29	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	指定媒介	2019-10-23
30	富安达现金货币市场证券投资基金2019年第3季度报告	指定媒介	2019-10-23
31	富安达基金管理有限公司旗下十一只基金更新产品招募说明书及摘要的提示性公告	指定媒介	2019-10-24
32	富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一九年第三号)	指定媒介	2019-10-24
33	富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书(更新)摘要(二〇一九年第三号)	指定媒介	2019-10-24
34	富安达基金关于系统升级暂停服务的公告	指定媒介	2019-10-30
35	富安达基金关于系统升级暂停服务的公告	指定媒介	2019-11-01
36	富安达基金管理有限公司关于基金经理恢复履行职务的公告	指定媒介	2019-11-05
37	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	指定媒介	2019-11-28
38	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	指定媒介	2019-12-11

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

类别		比例达到或者超过20%的时间区间					
机构	1	20190101-20191108	194,301,059.48	9,145,868.30	99,384,913.90	104,062,013.88	14.51%
	2	20191205-20191220	0.00	301,000,000.00	301,000,000.00	0.00	0.00%
	3	20190101-20190315	142,210,216.33	176,981,896.66	242,550,491.08	76,641,621.91	10.69%
	4	20190318-20191231	0.00	365,264,624.68	80,000,000.00	285,264,624.68	39.77%
产品特有风险							
当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大的冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准富安达现金货币市场证券投资基金设立的文件：

《富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书》；

《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》；

《富安达现金货币市场证券投资基金托管协议》。

2. 《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

3. 基金管理人业务资格批件和营业执照；

4. 基金托管人业务资格批件和营业执照；

5. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；

6. 中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

### 13.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.fadfunds.com](http://www.fadfunds.com)）查阅。

富安达基金管理有限公司

二〇二〇年四月二十日