

富安达神州天添利货币市场基金

2026年第2季度报告

2026年06月30日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期:2026年07月18日

目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	6
4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明	7
4.3 公平交易专项说明	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	7
4.5 报告期内基金的业绩表现	8
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	8
§5 投资组合报告	8
5.1 报告期末基金资产组合情况	8
5.2 报告期债券回购融资情况	9
5.3 基金投资组合平均剩余期限	9
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	10
5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	10
5.6 报告期末按公允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	10
5.7 “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	11
5.8 报告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	11
5.9 投资组合报告附注	11
§6 开放式基金份额变动	12
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	12
§8 影响投资者决策的其他重要信息	12
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	12
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	12
§9 备查文件目录	13
9.1 备查文件目录	13
9.2 存放地点	13
9.3 查阅方式	13

§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。基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同约定，于2026年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

富安达神州天添利货币市场基金由南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划变更注册而来。2025年10月28日，南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划的集合计划份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议通过了《关于南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划变更管理人并转型变更为富安达神州天添利货币市场基金有关事项的议案》，同意南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划变更管理人，管理人由南京证券股份有限公司变更为富安达基金管理有限公司，南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划变更为富安达神州天添利货币市场基金，即本基金；并进行相关调整。上述集合计划份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自2025年11月17日起，《富安达神州天添利货币市场基金基金合同》生效，原《南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。富安达基金管理有限公司开始正式管理富安达神州天添利货币市场基金。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达神州天添利货币
基金主代码	025747
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025年11月17日
报告期末基金份额总额	520,767,011.12份
投资目标	安全性和流动性优先，在此基础上追求适度收益。
投资策略	1、资产配置策略 本基金根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等的综合判断，并结合各类资产的估值水平、流动性特征、风险收益特征，决定各类资产的配置比例，并

	适时进行动态调整。 2、久期管理策略 本基金根据对未来短期利率走势的研判，结合基金资产流动性的要求动态调整组合久期。当预期短期利率上升时，降低组合久期，以规避资本损失或获得较高的再投资收益；在预期短期利率下降时，提高组合久期，以获得资本利得或锁定较高的利率水平。 3、个券选择策略 在个券选择上，本基金将综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值，发掘出具备相对价值的个券。 4、利用短期市场机会的灵活策略 由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况会造成短期内市场失衡；新股、新债发行以及年末效应等因素会使市场资金供求发生短时的失衡。这种失衡将带来一定市场机会。通过分析短期市场机会发生的动因，研究其中的规律，据此调整组合配置，改进操作方法，积极利用市场机会获得超额收益。 5、现金流管理策略 本基金将根据对申购赎回现金流情况变化的动态预测，结合对市场资金面等因素的分析，合理配置和动态调整组合现金流，在充分保持基金流动性的基础上争取较高收益。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金的类型为货币市场基金，预期收益和预期风险低于债券型基金、混合型基金和股票型基金。
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司

注：富安达神州天添利货币市场基金由南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划变更注册而来。自2025年11月17日起，《富安达神州天添利货币市场基金基金合同》生效。

§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（2026年04月01日 - 2026年06月30日）
1.本期已实现收益	1,066,691.73
2.本期利润	1,066,691.73
3.期末基金资产净值	520,767,011.12

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《基金合同》生效日为2025年11月17日，截至本报告期末，基金成立未满1年。

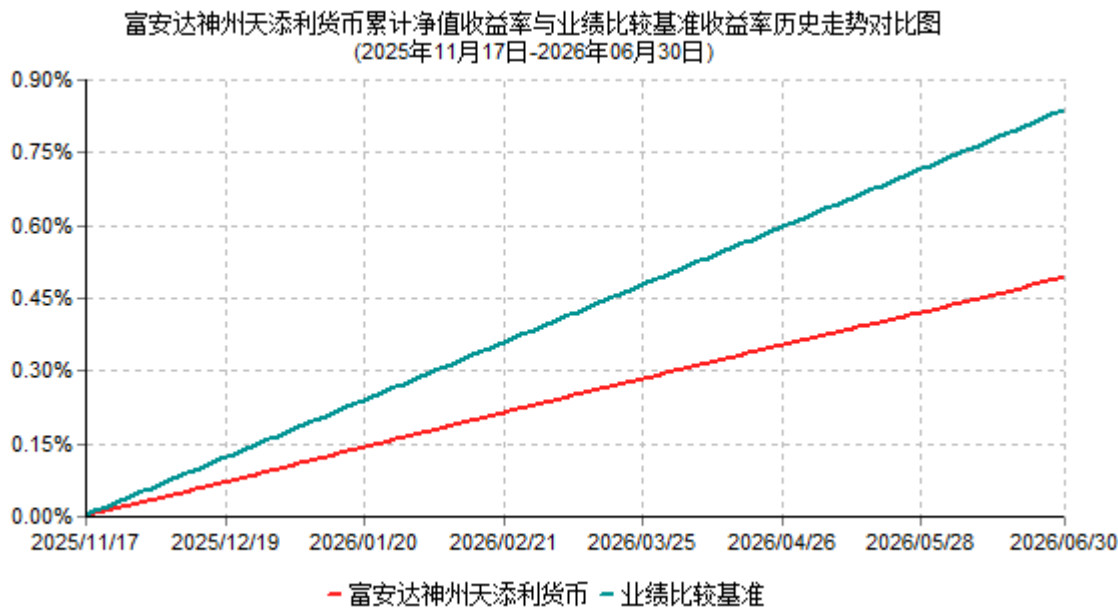
3.2 基金净值表现

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

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	0.1957%	0.0005%	0.3371%	0.0000%	-0.1414%	0.0005%
过去六个月	0.3953%	0.0004%	0.6717%	0.0000%	-0.2764%	0.0004%
自基金合同生效起至今	0.4936%	0.0003%	0.8394%	0.0000%	-0.3458%	0.0003%

注：本基金收益分配按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：

① 本基金《基金合同》生效日为2025年11月17日，截至本报告期末，基金成立未满1年。

② 根据本基金《基金合同》规定，本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2026年5月16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。

§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		
郑良海	本基金的基金经理	2025-11-21	-	14年	博士。历任上海电气电站集团订单项目处项目经理；山西证券股份有限公司宏观债券分析师；东兴证券股份有限公司债券高级分析师；财通基金管理有限公司固定收益部债券高级研究员。2022年加入富安达基金管理有限公司。现任富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达富禧纯债30天持

					有期债券型证券投资基金、富安达上海清算所0-3年政策性金融债指数证券投资基金、富安达神州天添利货币市场基金、富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：

- ①基金经理任职日期和离任日期为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，即基金的首任基金经理，其任职日期为基金合同生效日，其离职日期为公司作出决定后正式对外公告之日；
- ②证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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、《富安达神州天添利货币市场基金基金合同》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 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。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。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度国内经济整体呈现新旧动能分化加剧的特征，同时受美伊冲突逐步缓和的影响，资源品涨价预期回落，通胀对债市的扰动有所消退。基本面和资金面的宽松形成共振，推动债市收益率整体震荡下行，在4-5月间走出了一段相对鲜明的期限利差压缩行情。进入6月后资金面收敛，债市有所调整。

4-5月资金面的宽松是多种因素共同作用的结果：一是面对美伊战争等外部冲击和稳经济的内在要求，尽管央行在逐步回笼中长期流动性，但在银行存贷增速差持续走阔、企业结汇增加等背景下，银行体系自发性宽松，使得资金的收紧效应存在一定滞后性。二是债市供需矛盾弱于预期，上半年政府债的发行节奏偏慢，供给压力有限。而需求端，存款搬家持续演绎，叠加4月新一轮同业存款自律机制落地，市场影响释放，非银配置资金充裕，加剧了“资产荒”的行情。

报告期内，本基金主要根据资金面变化以及市场行情，结合基金负债端情况，灵活调整组合资产配置比例，在6月市场调整时适当增加了同业存单的配置，组合整体运行状况良好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达神州天添利货币基金份额净值为1.0000元，本报告期内，基金份额净值收益率为0.1957%，同期业绩比较基准收益率为0.3371%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	408,792,030.88	78.42
	其中：债券	408,792,030.88	78.42
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	112,477,841.73	21.58
4	其他资产	-	-
5	合计	521,269,872.61	100.00

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。

5.2 报告期债券回购融资情况

本报告期内无债券回购融资情况。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

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	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	93
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

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无超过120天情况。

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	46.92	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	7.77	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	3.83	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	3.69	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	37.78	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

合计	99.98	-
----	-------	---

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。

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

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限无超过240天情况。

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	公允价值(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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	45,524,711.57	8.74
6	中期票据	-	-
7	同业存单	363,267,319.31	69.76
8	其他	-	-
9	合计	408,792,030.88	78.50
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按公允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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112513090	25浙商银行CD090	500,000	49,947,271.65	9.59
2	112696624	26成都银行CD115	500,000	49,500,202.23	9.51
3	012582449	25昆明交通SCP006	300,000	30,402,893.70	5.84
4	112599266	25南京银行CD149	200,000	19,993,498.78	3.84
5	112621039	26渤海银行CD039	200,000	19,970,177.18	3.83

6	112517181	25光大银行CD181	200,000	19,938,597.50	3.83
7	112695616	26中信百信银行CD010	200,000	19,891,882.84	3.82
8	112610039	26兴业银行CD039	186,000	18,411,018.92	3.54
9	042680027	26西安高新CP001	100,000	10,068,967.55	1.93
10	112599905	25汉口银行CD105	100,000	9,991,017.10	1.92

5.7 “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	0.0636%
报告期内偏离度的最低值	0.0235%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0471%

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%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0.5%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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

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每日计提应收利息，并考虑其买入时的溢价或折价在其剩余期限内平均摊销。

5.9.2 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，本基金投资的前十名证券的发行主体中，浙商银行股份有限公司、成都银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、中信百信银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

在本基金对该证券的投资过程中，本基金管理人在遵守法律法规和公司管理制度的前提下，经公司审慎研究评估，将该证券纳入投资库进行投资。整个过程中严格履行了相关的投资决策程序。

5.9.3 其他资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	506,863,929.78
报告期期间基金总申购份额	4,684,695,710.54
报告期期间基金总赎回份额	4,670,792,629.20
报告期期末基金份额总额	520,767,011.12

注：总申购份额含红利再投导致份额增加的情况；

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1. 2026年4月21日，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
2. 2026年4月21日，富安达神州天添利货币市场基金2026年第1季度报告
3. 2026年4月22日，富安达神州天添利货币市场基金收益支付公告
4. 2026年4月27日，富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告
5. 2026年4月30日，2025年度富安达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露
6. 2026年5月20日，富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告
7. 2026年5月22日，富安达神州天添利货币市场基金收益支付公告
8. 2026年6月23日，富安达神州天添利货币市场基金收益支付公告
9. 2026年6月25日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加万家财富基金销售（天津）有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划变更注册的文件：
《富安达神州天添利货币市场基金招募说明书》；
《富安达神州天添利货币市场基金基金合同》；
《富安达神州天添利货币市场基金托管协议》。
- 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。

9.2 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。

9.3 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）查阅。

富安达基金管理有限公司

2026年07月18日