

**华安日日鑫货币市场基金**  
**2016 年年度报告**  
**2016 年 12 月 31 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

## §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| <b>§2 基金简介</b>                          | 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  |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>          | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现                              | 8  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 12 |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | 13 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 13 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 16 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 16 |
| 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             | 17 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 18 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 19 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 20 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 21 |
| 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       | 22 |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | 22 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 22 |
| 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 | 22 |
| 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       | 22 |
| <b>§6 审计报告</b>                          | 22 |
| 6.1 管理层对财务报表的责任                         | 22 |
| 6.2 注册会计师的责任                            | 23 |
| 6.3 审计意见                                | 23 |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | 23 |
| 7.1 资产负债表                               | 23 |
| 7.2 利润表                                 | 25 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 26 |
| 7.4 报表附注                                | 28 |
| <b>§8 投资组合报告</b>                        | 53 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 53 |
| 8.2 债券回购融资情况                            | 54 |
| <b>8.3 基金投资组合平均剩余期限</b>                 | 54 |
| 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         | 55 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 55 |
| 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      | 56 |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 8.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....         | 56        |
| 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 ..... | 56        |
| 8.9 投资组合报告附注 .....                          | 56        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>57</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 57        |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人 .....                      | 58        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 58        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>59</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>59</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 59        |
| 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 .....      | 59        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 60        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 60        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 60        |
| 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 .....         | 60        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 60        |
| 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        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                     | <b>68</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 68        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 68        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 68        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称            | 华安日日鑫货币市场基金        |                    |                    |
| 基金简称            | 华安日日鑫货币            |                    |                    |
| 基金主代码           | 040038             |                    |                    |
| 交易代码            | 040038             |                    |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                    |                    |
| 基金合同生效日         | 2012 年 11 月 26 日   |                    |                    |
| 基金管理人           | 华安基金管理有限公司         |                    |                    |
| 基金托管人           | 中国建设银行股份有限公司       |                    |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 9,019,960,403.33 份 |                    |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                    |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 华安日日鑫货币 A          | 华安日日鑫货币 B          | 货币 ETF             |
| 下属分级基金的交易代码     | 040038             | 040039             | 511600             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 223,769,425.92 份   | 4,405,024,912.91 份 | 4,391,166,064.50 份 |

注：自 2016 年 9 月 12 日起，本基金新增场内基金份额（H 类基金份额）简称为“货币 ETF”，基金份额净值为 100.00 元，本表所列场内份额数据面值已折算为 1.00 元；场外基金份额（A 类基金份额）简称为“华安日日鑫货币 A”，基金份额净值为 1.00 元；场外基金份额（B 类基金份额）简称为“华安日日鑫货币 B”，基金份额净值为 1.00 元。

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                         |
|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 为满足投资人现金管理和日常理财需求，本基金在力求本金安全、确保基金资产流动性的基础上，追求稳定的当期收益，谋求资产的稳定增值。                                                                                         |
| 投资策略 | 本基金将根据市场情况和可投资品种的容量，在严谨深入的研究分析基础上，综合考量宏观经济形势、市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等，确定各类货币市场工具的配置比例并进行积极的投资组合管理，在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。 |

|        |                                                            |
|--------|------------------------------------------------------------|
| 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。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                    | 基金托管人                |
|-------------|------|--------------------------|----------------------|
| 名称          |      | 华安基金管理有限公司               | 中国建设银行股份有限公司         |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 钱鲲                       | 田青                   |
|             | 联系电话 | 021-38969999             | 010-67595096         |
|             | 电子邮箱 | qiankun@huaan.com.cn     | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话      |      | 4008850099               | 010-67595096         |
| 传真          |      | 021-68863414             | 010-66275853         |
| 注册地址        |      | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层 | 北京市西城区金融大街25号        |
| 办公地址        |      | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼    |
| 邮政编码        |      | 200120                   | 100033               |
| 法定代表人       |      | 朱学华                      | 王洪章                  |

## 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、上海证券报、证券时报         |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.huaan.com.cn         |
| 基金年度报告备置地点          | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                 | 办公地址                 |
|--------|--------------------|----------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市世纪大道100号环球金融中心50楼 |
| 注册登记机构 | 华安基金管理有限公司         | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31  |

|  |  |        |
|--|--|--------|
|  |  | 层、32 层 |
|--|--|--------|

### §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 | 2016 年         |                  |                  | 2015 年         |                |        | 2014 年           |                |        |
|---------------|----------------|------------------|------------------|----------------|----------------|--------|------------------|----------------|--------|
|               | 华安日日鑫货币 A      | 华安日日鑫货币 B        | 货币 ETF           | 华安日日鑫货币 A      | 华安日日鑫货币 B      | 货币 ETF | 华安日日鑫货币 A        | 华安日日鑫货币 B      | 货币 ETF |
| 本期已实现收益       | 8,444,929.69   | 47,321,677.38    | 18,538,260.71    | 18,674,067.65  | 25,862,104.45  | -      | 17,349,357.98    | 9,750,134.60   | -      |
| 本期利润          | 8,444,929.69   | 47,321,677.38    | 18,538,260.71    | 18,674,067.65  | 25,862,104.45  | -      | 17,349,357.98    | 9,750,134.60   | -      |
| 本期净值收益率       | 2.5756%        | 2.8222%          | 0.6858%          | 3.6984%        | 3.9478%        | -      | 4.6074%          | 4.8569%        | -      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末        |                  |                  | 2015 年末        |                |        | 2014 年末          |                |        |
|               | 华安日日鑫货币 A      | 华安日日鑫货币 B        | 货币 ETF           | 华安日日鑫货币 A      | 华安日日鑫货币 B      | 货币 ETF | 华安日日鑫货币 A        | 华安日日鑫货币 B      | 货币 ETF |
| 期末基金资产净值      | 223,769,425.92 | 4,405,024,912.91 | 4,391,166,064.50 | 373,339,854.99 | 967,536,923.32 | -      | 1,231,181,488.78 | 280,367,833.75 | -      |
| 期末基金份额净值      | 1.0000         | 1.0000           | 1.0000           | 1.0000         | 1.0000         | -      | 1.0000           | 1.0000         | -      |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2016 年末        |                  |                  | 2015 年末        |                |        | 2014 年末          |                |        |
|               | 华安日日鑫货币 A      | 华安日日鑫货币 B        | 货币 ETF           | 华安日日鑫货币 A      | 华安日日鑫货币 B      | 货币 ETF | 华安日日鑫货币 A        | 华安日日鑫货币 B      | 货币 ETF |
| 累计净值收益率       | 16.0781%       | 17.2221%         | 0.6858%          | 13.1635%       | 14.0049%       | -      | 9.1281%          | 9.6757%        | -      |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，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。

2、自 2016 年 9 月 12 日起,本基金增设 H 类份额，简称为“货币 ETF”。

### 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

##### 1. 华安日日鑫货币 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      | 0.5676%  | 0.0018%     | 0.2722%    | 0.0000%       | 0.2954%  | 0.0018% |
| 过去六个月      | 1.1640%  | 0.0016%     | 0.5444%    | 0.0000%       | 0.6196%  | 0.0016% |
| 过去一年       | 2.5756%  | 0.0023%     | 1.0830%    | 0.0000%       | 1.4926%  | 0.0023% |
| 过去三年       | 11.2694% | 0.0042%     | 3.2430%    | 0.0000%       | 8.0264%  | 0.0042% |
| 自基金合同生效起至今 | 16.0781% | 0.0043%     | 4.4295%    | 0.0000%       | 11.6486% | 0.0043% |

##### 2. 华安日日鑫货币 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      | 0.6285%  | 0.0018%     | 0.2722%    | 0.0000%       | 0.3563%  | 0.0018% |
| 过去六个月      | 1.2864%  | 0.0016%     | 0.5444%    | 0.0000%       | 0.7420%  | 0.0016% |
| 过去一年       | 2.8222%  | 0.0023%     | 1.0830%    | 0.0000%       | 1.7392%  | 0.0023% |
| 过去三年       | 12.0717% | 0.0042%     | 3.2430%    | 0.0000%       | 8.8287%  | 0.0042% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.2221% | 0.0043%     | 4.4295%    | 0.0000%       | 12.7926% | 0.0043% |

##### 3. 货币 ETF:

| 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      | 0.5663%  | 0.0018%     | 0.2722%    | 0.0000%       | 0.2941% | 0.0018% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.6858%  | 0.0017%     | 0.3284%    | 0.0000%       | 0.3574% | 0.0017% |

注：自 2016 年 9 月 12 日起,本基金增设 H 类份额，简称为“货币 ETF”。

本基金自成立起至 2016 年 8 月 29 日,利润分配是按月结转份额。自 2016 年 8 月 30 日起至今,利润分配是按日结转份额。

本基金业绩比较基准：同期七天通知存款利率（税后）。

根据本基金合同的有关规定：本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：现金，通知存款，短期融资券，一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单，期限在一年以内

（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，剩余期限（或回售期限）在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据，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金融工具。

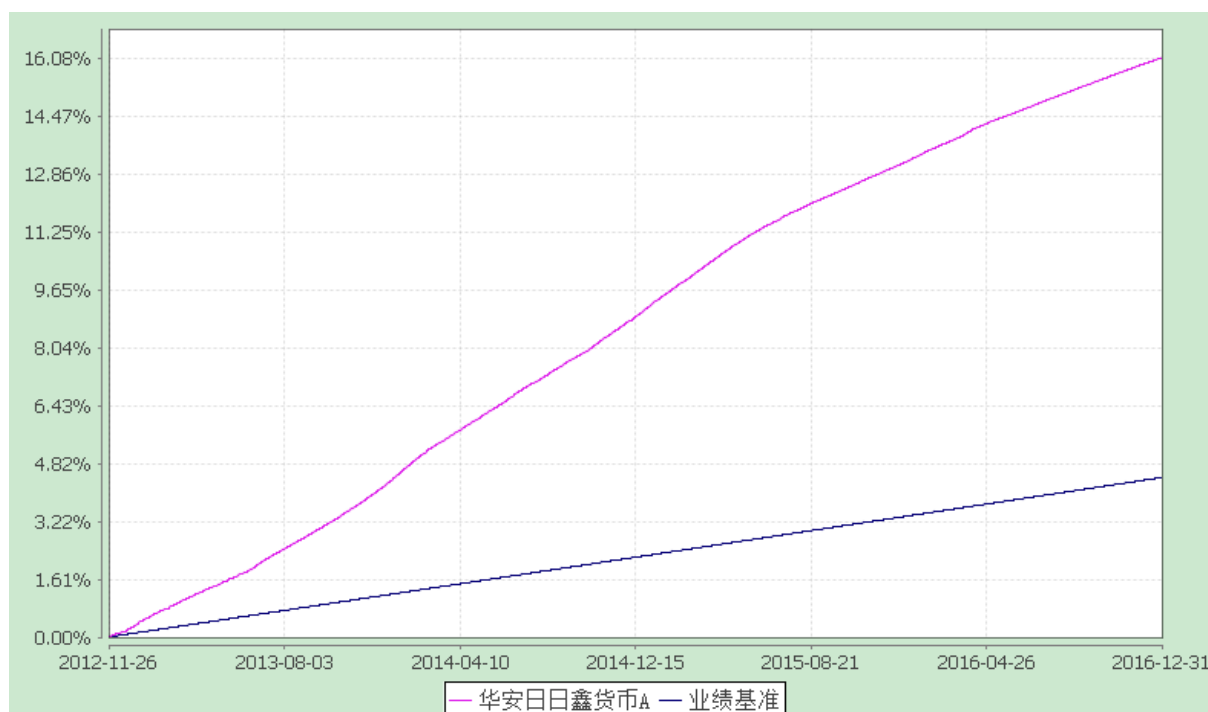
### 3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 华安日日鑫货币市场基金

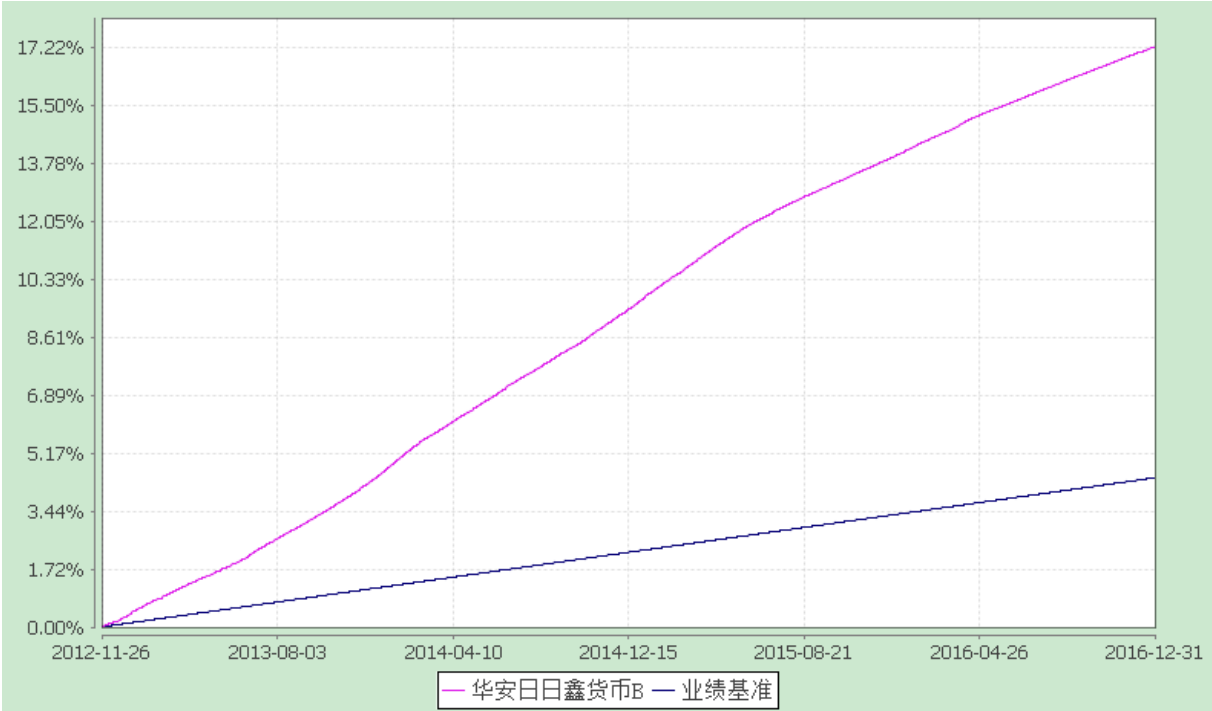
自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012 年 11 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日)

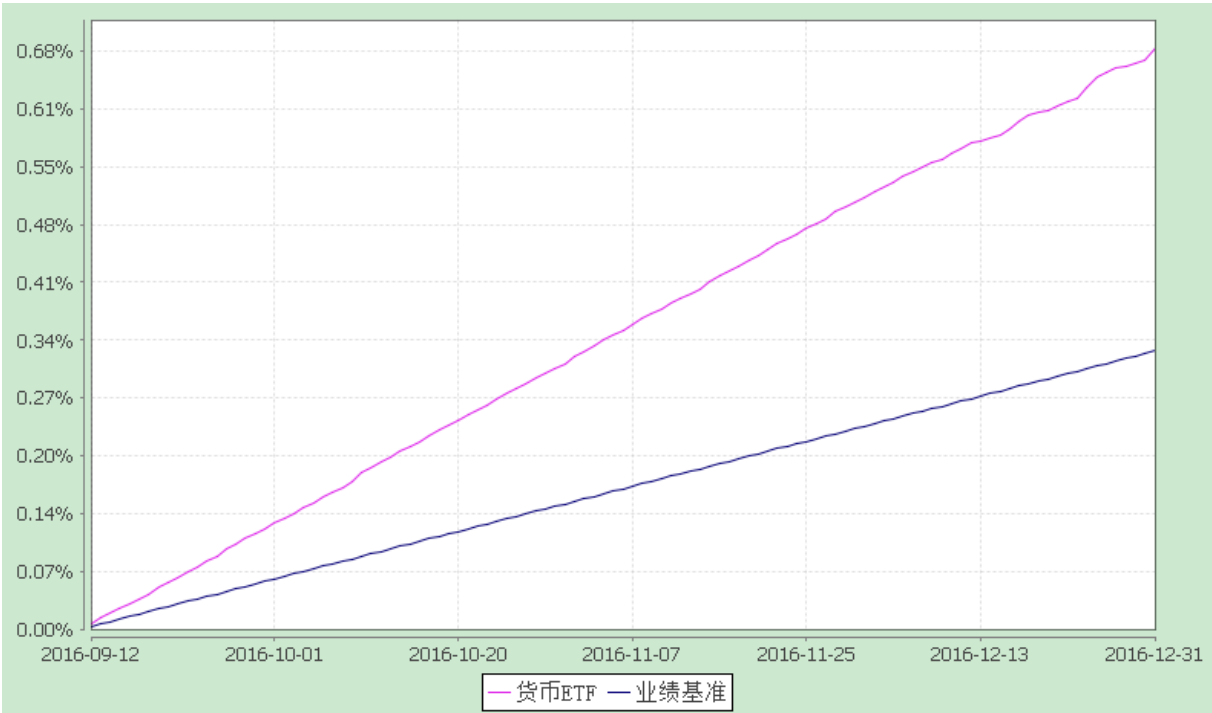
#### 1、华安日日鑫货币 A



#### 2、华安日日鑫货币 B



3、货币 ETF

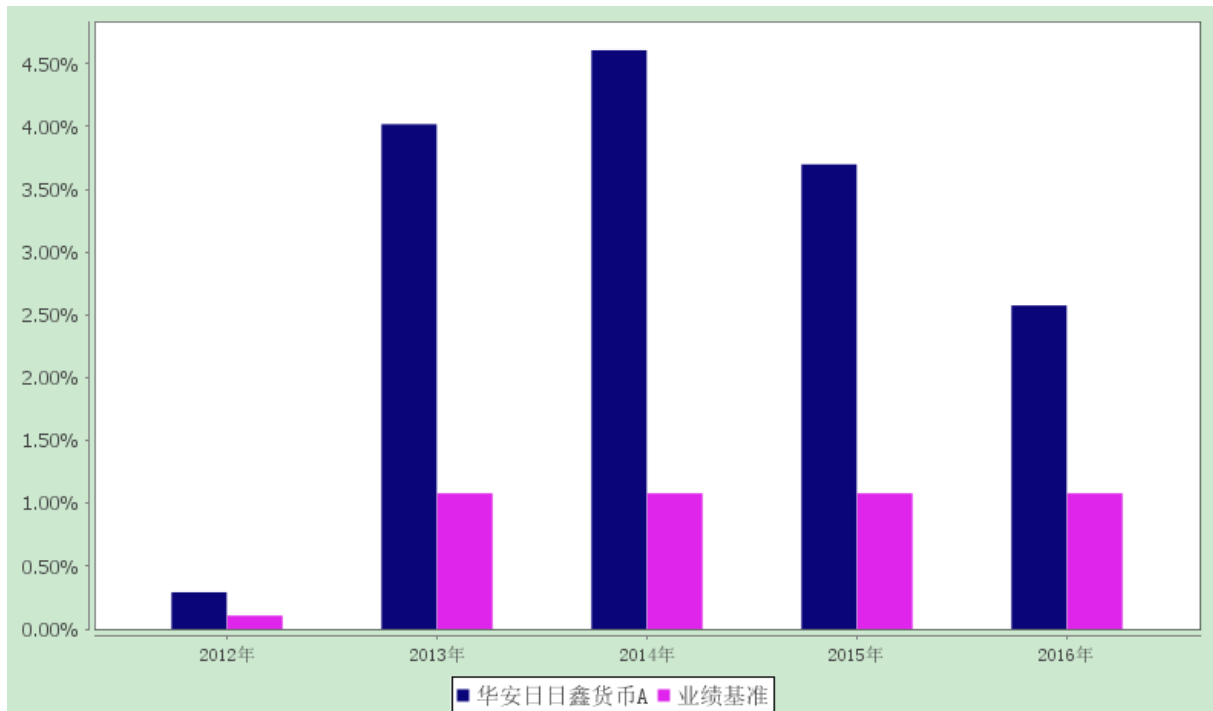


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

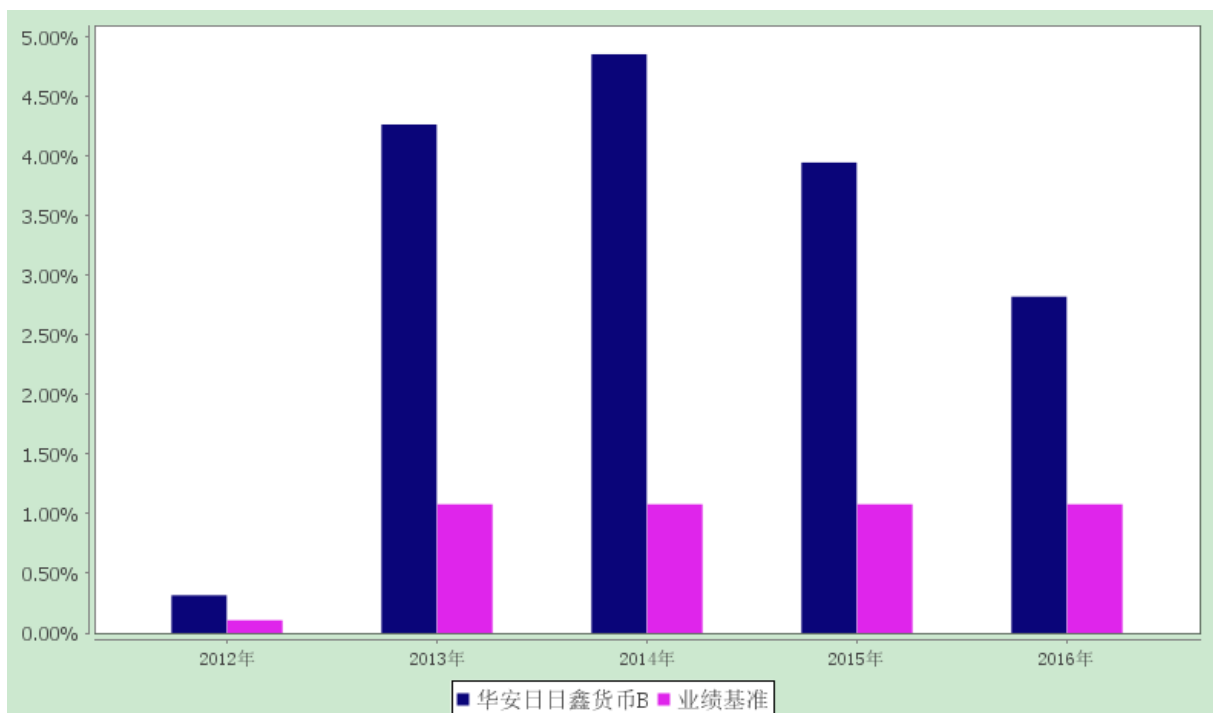
华安日日鑫货币市场基金

自基金合同生效以来基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

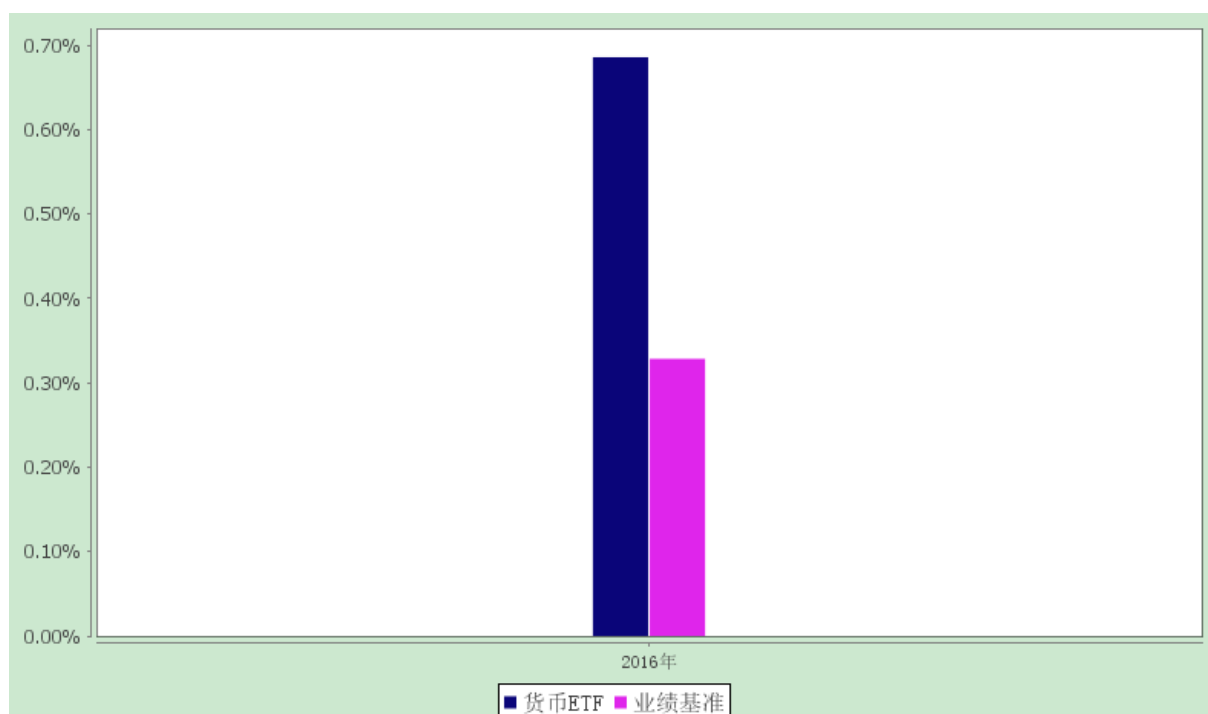
1、华安日日鑫货币 A



## 2、华安日日鑫货币 B



## 3、货币 ETF



注：自 2016 年 9 月 12 日起,本基金增设 H 类份额，简称为“货币 ETF”。

本基金自成立起至 2016 年 8 月 29 日,利润分配是按月结转份额。自 2016 年 8 月 30 日起至今,利润分配是按日结转份额。

合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

华安日日鑫货币 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 |
|--------|---------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 2016 年 | 8,857,390.43  | 512,544.44    | -925,005.18   | 8,444,929.69  | -  |
| 2015 年 | 18,054,190.37 | 3,194,791.80  | -2,574,914.52 | 18,674,067.65 | -  |
| 2014 年 | 14,478,952.90 | 2,133,232.93  | 737,172.15    | 17,349,357.98 | -  |
| 合计     | 41,390,533.70 | 5,840,569.17  | -2,762,747.55 | 44,468,355.32 | -  |

华安日日鑫货币 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 |
|--------|---------------|---------------|--------------|---------------|----|
| 2016 年 | 45,510,067.87 | 1,860,345.04  | -48,735.53   | 47,321,677.38 | -  |
| 2015 年 | 22,993,483.43 | 862,037.12    | 2,006,583.90 | 25,862,104.45 | -  |
| 2014 年 | 7,705,357.61  | 1,841,209.17  | 203,567.82   | 9,750,134.60  | -  |

|    |               |              |              |               |   |
|----|---------------|--------------|--------------|---------------|---|
| 合计 | 76,208,908.91 | 4,563,591.33 | 2,161,416.19 | 82,933,916.43 | - |
|----|---------------|--------------|--------------|---------------|---|

货币 ETF:

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 |
|--------|---------------|---------------|------------|---------------|----|
| 2016 年 | 17,761,916.66 | -             | 776,344.05 | 18,538,260.71 | -  |
| 合计     | 17,761,916.66 | -             | 776,344.05 | 18,538,260.71 | -  |

注: 自 2016 年 9 月 12 日起,本基金增设 H 类份额, 简称为“货币 ETF”。

本基金自成立起至 2016 年 8 月 29 日,利润分配是按月结转份额。自 2016 年 8 月 30 日起至今,利润分配是按日结转份额。

## §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

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立,是国内首批基金管理公司之一,注册资本 1.5 亿元人民币,公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气(集团)总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资(集团)有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2016 年 12 月 31 日,公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头 ETF、华安上证龙头 ETF 联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证 300 指数(LOF)、华安科技动力混合、华安信用四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金(QDII-LOF)、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略混合、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易 ETF、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安汇财通货币、华安国际龙头(DAX)ETF、华安国际龙头(DAX)ETF 联接、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安

享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息债券、华安创业板 50ETF、华安安进保本混合发起式、华安聚利 18 个月定开债、华安智增精选灵活配置混合、华安新财富灵活配置混合、华安安润灵活配置混合、华安睿享定开混合发起式、华安新希望灵活配置混合、华安鼎丰债券发起式、华安新瑞利灵活配置混合、华安新泰利灵活配置混合、华安新恒利灵活配置混合、华安事件驱动量化策略混合、华安新丰利灵活配置混合等 89 只开放式基金。管理资产规模达到 1632.85 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名  | 职务                 | 任本基金的基金经理<br>（助理）期限 |      | 证券从<br>业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|-----|--------------------|---------------------|------|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                    | 任职日期                | 离任日期 |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 郑可成 | 本基金的基金经理，固定收益部助理总监 | 2012-11-26          | -    | 15 年       | 硕士研究生，15 年证券基金从业经历。2001 年 7 月至 2004 年 12 月在闽发证券有限责任公司担任研究员，从事债券研究及投资，2005 年 1 月至 2005 年 9 月在福建儒林投资顾问有限公司任研究员，2005 年 10 月至 2009 年 7 月在益民基金管理有限公司任基金经理，2009 年 8 月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。<br>2010 年 12 月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 9 月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 11 月起同时担任本基金的基金经理。2012 年 12 月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 5 月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 8 月起同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金、华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月起担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起同时担任华 |

|     |          |            |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|-----|----------|------------|---|-----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          |            |   |     | 安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安添颐养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。2015 年 11 月起, 同时担任华安安益保本混合型证券投资基金的基金经理; 2015 年 12 月起, 同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月起, 同时担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月起, 同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 10 月起, 同时担任华安安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。                                                                      |
| 孙丽娜 | 本基金的基金经理 | 2014-08-30 | - | 6 年 | 硕士研究生, 6 年债券、基金行业从业经验。曾任上海国际货币经纪公司债券经纪人。2010 年 8 月加入华安基金管理有限公司, 先后担任债券交易员、基金经理助理。2014 年 8 月起担任本基金及华安汇财通货币市场基金、华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 10 月起同时担任华安现金富利投资基金的基金经理。2015 年 2 月起担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安添颐养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016 年 10 月起, 同时担任华安安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起, 同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 李邦长 | 本基金的基金经理 | 2016-03-02 | - | 6 年 | 硕士研究生, 具有基金从业资格证书。曾任安永华明会计师事务所审计师, 2010 年 3 月加入华安基金管理有限公司, 先后从事基金运营、债券交易和债券研究等工作, 2014 年 9 月起担任基金经理助理, 2016 年 3 月起担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金、华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2016 年 11 月起, 同时担任华安鼎丰债券型发起式证券投资基金的基金经理。                                                                                                |
| 苏卿云 | 本基金的基金经理 | 2016-12-19 | - | 9 年 | 硕士研究生, 9 年证券行业从业经历。曾任上海证券交易所基金业务部经理。2016 年 7 月加入华安基金, 任指数与量化投资事业总部 ETF 业务负责人。2016 年 12 月起, 担任本基金的基金经理。                                                                                                                                                                                                                                |

注: 此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日, 即以公告日为准。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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

## 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

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》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对

各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的次数为 9 次，未出现异常交易。

### 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

2016 年，全球主要发达经济体通胀预期抬升，货币政策出现边际收紧迹象。美联储如期加息，特朗普新政预计将加大基建支出、大规模减税等刺激政策，美国经济增长趋于加速，通胀水平趋于抬升，消费者信心指数提升；欧元区经济出现回暖态势，包括 GDP、通胀、PMI 和投资者信心指数等数据都有所改善，欧央行议息决议延长 QE 期限，但单月购债规模缩减，且银行业潜在风险不容小觑；日本持续面临低增长和通缩困境，日央行将控制利率曲线列为新政策目标，宽松政策已接近极限。国内经济方面，下半年以来各项指标显示经济基本面有所改善，经济短期有企稳迹象，制造业 PMI 持续创出新高，工业企业利润逐步改善，工业增加值增速稳定，固定资产投资回升，民间投资改善，货币与信贷稳定，社会融资规模超预期；价格方面，工业领域结束多年通缩，CPI 也在 8 月见底之后也出现持续的回升，通胀压力抬头。流动性管理方面，央行除了一季度进行一次降准操作以外，其余操作主要通过公开市场投放和 MLF 等组合方式进行，上半年流动性总体较为宽松，但随着 8 月份央行重启 14 天逆回购开始，货币政策趋紧信号逐步升级，四季度受同业去杠杆及临近

年末等因素叠加影响，银行间资金面扰动较大。2016 年债市表现波动较大，前三季度收益率总体下行，超长久期利率债价值洼地被市场挖掘，30Y 期国债收益率大幅下行；中低等级、中长久期信用债受资产荒背景下的配置压力推动，收益率亦大幅下行，信用利差收窄；但是四季度随着金融去杠杆的深入以及国内外各项经济金融数据对债市构成利空，债市出现大幅调整，收益率大幅上行，信用利差明显走扩。

本报告期内，我们勤勉尽责，稳健操作，在保证组合流动性安全、剩余期限相对较短的前提下，甄选优质个券，捕捉流动性收紧资金利率冲高机会，投资定存和逆回购等品种锁定高收益，并适时根据市场变化调整组合结构，灵活把握投资机会，为持有人获得了可观的组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

华安日日鑫货币收益率及规模变化：

华安日日鑫货币 A：

投资回报：2.5756% 比较基准：1.0830%

期初规模：3.73 亿 期末规模：2.24 亿

华安日日鑫货币 B：

投资回报：2.8222% 比较基准：1.0830%

期初规模：9.68 亿 期末规模：44.05 亿

自 2016 年 9 月 12 日起,本基金增设 H 类份额。

华安日日鑫货币 H：

投资回报：0.6858% 比较基准：0.3284%

期初规模：1.78 亿 期末规模：43.91 亿

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，发达经济体反思负利率政策实施的弊端和不足，随着特朗普新政实施带来的联动效应，全球利率将面临上行压力，主要货币兑美元走势依然承压；国内经济方面，随着楼市调控政策的继续实施，楼市小周期见顶，地产相关消费增速将逐步回落，房地产去杠杆叠加金融去杠杆的环境下，预计下半年开始经济下行压力可能逐步呈现；而随着农业供给侧改革的推进，以及原油限产决议的签署，生活资料价格的上涨，未来通胀中枢存上行压力；央行货币政策定调稳健中性，未来基础货币投放机制发生变迁，货币闸门调节模式下未来流动性波动将加大，债市风险不可低估。各方因素不明朗前提下，需要做好资产配置久期的控制，降低利率敏感度风险，适时采取波段操作，

赚取价差收益。

我们将继续重视组合的流动性风险，维持适中的久期策略，灵活进行波段操作捕捉市场机会；同时，我们将继续重视债券的信用风险，资产配置向高等级品种倾斜，并关注同业存款和逆回购的价格走势，把握流动性紧张时点的投资机会。我们将秉承稳健、专业的投资理念，优化组合结构，控制风险，勤勉尽责地维护持有人的利益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

- （1）积极配合监管部门新法规的实施，不断完善公司的内部控制制度和业务操作流程；
- （2）继续深化“主动合规”的管理理念，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密、销售适用性等方面的合规培训和内部审计，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。
- （3）完善公司内控建设，强化基金的公平交易和异常交易的检查与监控，防范内幕交易与操纵市场行为的出现，同时进行投资管理人员合规培训、及定期进行基金经理的合规谈话，建立健全坚守“三条底线”的长效机制；
- （4）做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。
- （5）推动落实公司投资、运营业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险发生的概率。
- （6）按照法规的要求，做好旗下各只基金的信息披露工作，做到信息披露的真实、完整、准确、及时。
- （7）有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，强化对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺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，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障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

##### 1、估值政策及重大变化

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

##### 3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：基金投资部兼全球投资部高级总监、投资研究部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

翁启森，基金投资部兼全球投资部高级总监，总经理助理，工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现任华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安大国新经济股票、华安物联网主题股票的基金经理，华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部高级总监。

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安策略优选混合、华安沪港深外延增长混合、华安安禧保本的基金经理，投资研究部高级总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安可转债、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安信用增强债券、华安双债添利债券、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置、华安新乐享保本、华安乐惠保本、华安安华保本、华安安进保本、华安新希望混合、华安睿享定开混合的基金经理，固定收益部总监。

许之彦，指数投资部高级总监，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大

学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安深证 300 指数（LOF）、华安易富黄金 ETF 及联接、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级、华安创业板 50 指数分级、华安创业板 50ETF 的基金经理，指数投资部高级总监。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，现任基金运营部总经理。

## （2）托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

## （3）会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

## 4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

## 5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

## 6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配。本报告期华安日日鑫货币 A 累计收益分配金额 8,444,929.69 元，华安日日鑫货币 B 累计收益分配金额 47,321,677.38 元，华安日日鑫货币 H 累计收益分配金额 18,538,260.71 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

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配金额：华安日日鑫货币 A 为 8,444,929.69 元，华安日日鑫货币 B 为 47,321,677.38 元，华安日日鑫货币 H 为 18,538,260.71 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

本托管人复核审查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。

### §6 审计报告

安永华明（2017）审字第 60971571\_B05 号

华安日日鑫货币市场基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安日日鑫货币市场基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 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。

#### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人华安基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）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而导致的重大错报。

## 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

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。

## 6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华安日日鑫货币市场基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)中国注册会计师

蒋燕华 丁鹏飞

上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

2017-03-24

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华安日日鑫货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产    | 附注号     | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产：   |         | -                       | -                        |
| 银行存款  | 7.4.7.1 | 4,980,265,795.32        | 222,511,774.65           |
| 结算备付金 |         | 20,000,000.00           | -                        |

|                 |            |                                 |                                  |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 存出保证金           |            | -                               | -                                |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 1,320,256,605.84                | 838,884,888.10                   |
| 其中：股票投资         |            | -                               | -                                |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 1,320,256,605.84                | 838,884,888.10                   |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | 2,670,517,965.77                | 453,478,720.22                   |
| 应收证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 33,114,101.61                   | 8,956,049.45                     |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 926,093.11                      | 7,627,763.84                     |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>9,025,080,561.65</b>         | <b>1,531,459,196.26</b>          |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2015 年 12 月 31 日</b> |
| 负债：             |            | -                               | -                                |
| 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       |            | -                               | 186,999,706.50                   |
| 应付证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款           |            | 780,650.11                      | 793,363.58                       |
| 应付管理人报酬         |            | 1,150,416.79                    | 381,627.88                       |
| 应付托管费           |            | 460,166.68                      | 115,644.78                       |
| 应付销售服务费         |            | 673,584.01                      | 82,217.96                        |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 92,077.40                       | 38,621.14                        |
| 应交税费            |            | -                               | -                                |

|                   |          |                         |                         |
|-------------------|----------|-------------------------|-------------------------|
| 应付利息              |          | -                       | 10,576.12               |
| 应付利润              |          | 1,654,263.33            | 1,851,659.99            |
| 递延所得税负债           |          | -                       | -                       |
| 其他负债              | 7.4.7.8  | 309,000.00              | 309,000.00              |
| <b>负债合计</b>       |          | <b>5,120,158.32</b>     | <b>190,582,417.95</b>   |
| <b>所有者权益：</b>     |          | -                       | -                       |
| 实收基金              | 7.4.7.9  | 9,019,960,403.33        | 1,340,876,778.31        |
| 未分配利润             | 7.4.7.10 | -                       | -                       |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>9,019,960,403.33</b> | <b>1,340,876,778.31</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>9,025,080,561.65</b> | <b>1,531,459,196.26</b> |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 9,019,960,403.33 份，其中 A 类基金份额总额 223,769,425.92 份；B 类基金份额总额 4,405,024,912.91 份；H 类基金份额总额 4,391,166,064.50 份，H 类基金份额净值为 100.00 元，本表所列 H 类基金份额数据面值已折算为 1.00 元。

## 7.2 利润表

会计主体：华安日日鑫货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------------|----------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>      |          | <b>95,434,523.10</b>                      | <b>54,788,524.35</b>                           |
| 1.利息收入           |          | 97,435,376.15                             | 51,795,312.89                                  |
| 其中：存款利息收入        | 7.4.7.11 | 24,718,064.99                             | 17,788,799.91                                  |
| 债券利息收入           |          | 47,373,336.11                             | 25,718,044.13                                  |
| 资产支持证券利息收入       |          | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资产收入       |          | 25,343,975.05                             | 8,288,468.85                                   |
| 其他利息收入           |          | -                                         | -                                              |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | -2,000,853.05                             | 2,989,669.54                                   |

|                            |          |                      |                      |
|----------------------------|----------|----------------------|----------------------|
| 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 | -2,000,853.05        | 2,989,669.54         |
| 资产支持证券投资收益                 | 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 | -                    | 3,541.92             |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>21,129,655.32</b> | <b>10,252,352.25</b> |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2 | 8,272,849.59         | 3,994,257.10         |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2 | 2,877,465.08         | 1,210,380.80         |
| 3. 销售服务费                   |          | 3,030,842.80         | 1,287,271.32         |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19 | -                    | -                    |
| 5. 利息支出                    |          | 6,449,378.71         | 3,372,696.76         |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 6,449,378.71         | 3,372,696.76         |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.20 | 499,119.14           | 387,746.27           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>74,304,867.78</b> | <b>44,536,172.10</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                    | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>74,304,867.78</b> | <b>44,536,172.10</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安日日鑫货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期                               |       |         |
|----|----------------------------------|-------|---------|
|    | 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）                        | 1,340,876,778.31                 | -              | 1,340,876,778.31   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 74,304,867.78  | 74,304,867.78      |
| 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）      | 7,679,083,625.02                 | -              | 7,679,083,625.02   |
| 其中：1.基金申购款                             | 22,659,781,421.75                | -              | 22,659,781,421.75  |
| 2.基金赎回款                                | -14,980,697,796.73               | -              | -14,980,697,796.73 |
| 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） | -                                | -74,304,867.78 | -74,304,867.78     |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 9,019,960,403.33                 | -              | 9,019,960,403.33   |
| 项目                                     | 上年度可比期间                          |                |                    |
|                                        | 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）                        | 1,511,549,322.53                 | -              | 1,511,549,322.53   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 44,536,172.10  | 44,536,172.10      |
| 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）      | -170,672,544.22                  | -              | -170,672,544.22    |
| 其中：1.基金申购款                             | 7,222,667,423.62                 | -              | 7,222,667,423.62   |
| 2.基金赎回款                                | -7,393,339,967.84                | -              | -7,393,339,967.84  |
| 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） | -                                | -44,536,172.10 | -44,536,172.10     |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,340,876,778.31                 | -              | 1,340,876,778.31   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华安日日鑫货币市场基金 (以下简称“本基金”), 系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]1442 号文《关于核准华安日日鑫货币市场基金募集的批复》的核准, 由华安基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集, 基金合同于 2012 年 11 月 26 日生效, 首次设立募集规模为 926,777,863.81 份基金份额。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。本基金自 2016 年 8 月 30 日起增加 H 类基金份额, A 类基金份额和 B 类基金份额在场外申购和赎回, H 类基金份额在场内申购和赎回。本基金每份 A 类基金份额和 B 类基金份额的面值为人民币 1.00 元, 每份 H 类基金份额的面值为人民币 100.00 元。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司, 托管人为中国建设银行股份有限公司, A 类基金份额和 B 类基金份额的注册登记机构为华安基金管理有限公司, H 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

本基金根据基金份额持有人持有本基金场外份额的数量, 对基金份额持有人持有的场外基金份额按照不同的费率计提销售服务费用, 因此形成不同的基金份额类别: A 类基金份额和 B 类基金份额。若基金份额持有人在单个基金交易账户保留的 A 类基金份额达到或超过 500 万份时, 本基金的注册登记机构自动将其在该基金交易账户保留的 A 类基金份额全部升级为 B 类基金份额。若基金份额持有人在单个基金交易账户保留的 B 类基金份额低于 500 万份时, 本基金的注册登记机构自动将其在该基金交易账户保留的 B 类基金份额全部降级为 A 类基金份额。H 类基金份额不进行基金份额升降级。

据基金管理人华安基金管理有限公司于 2016 年 8 月 30 日更新的《华安日日鑫货币市场基金基金合同》, 本基金的投资范围进行如下变更。变更前, 本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具, 包括: 现金, 通知存款, 短期融资券, 一年以内 (含一年) 的银行定期存款、大额存单, 期限在一年以内 (含一年) 的债券回购, 期限在一年以内 (含一年) 的中央银行票据, 剩余期限 (或回售期限) 在 397 天以内 (含 397 天) 的债券、资产支持证券、中期票据, 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金融工具。变更后, 本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具, 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 (含 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金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准: 同期七天通知存款利率 (税后)。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金的金融资产分类为交易类金融资产及贷款和应收款项，在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债，以公允价值计量，并以摊余成本进行后

续计量。

#### 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

##### (1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资；

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，应作为债券投资成本；

卖出银行间同业市场交易的债券，于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

##### (2) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金金融工具的估值方法具体如下：

##### 1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

##### 2) 债券投资

基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

##### 3) 回购协议

(1) 基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

(2) 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

#### 4) 其他

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(1) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，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资产价值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、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。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第 120 号《货币市场基金监督管理办法》的规定，自 2016 年 2 月 1 日起，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不

足的，应当使用固有资金予以弥补；

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

(1) 基金管理费原按前一日基金资产净值的 0.33% 的年费率逐日计提；自 2016 年 8 月 30 日起，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率逐日计提；

(3) 本基金 A 类基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提；B 类基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.01% 的年费率逐日计提；H 类基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

根据基金管理人华安基金管理有限公司于 2016 年 8 月 30 日更新的《华安日日鑫货币市场基金基金合同》，本基金的收益分配政策进行如下变更。

变更前，本基金的收益分配政策为：

(1) 本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3) “每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每月集中支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

(4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5) 本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；

(6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

变更后，本基金的收益分配政策为：

#### 1、本基金场外基金份额的收益分配原则

(1) 本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3) “每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每日分配所得收益参与下一日的收益分配，每月集中支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

(4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5) 本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人全部赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；在 A 类基金份额和 B 类基金份额持有人部分赎回基金份额时，不结算基金收益，但剩余的基金份额必须足以弥补其当前累计收益为负时的损益；

(6) 基金管理人有权在基金注册登记机构条件允许、并与基金托管人协商一致的情形下，将全部或部分基金份额的收益分配由“每日分配，按月支付”提升为“每日分配，按日支付”并予以公告；

(7) 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自

下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

## 2、本基金场内基金份额的收益分配原则

(1) 每份基金份额享有同等分配权；

(2) 收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3) 本基金每日将 H 类基金份额的基金已实现收益分配给相应的基金份额持有人，记入 H 类份额持有人的收益账户，当日收益参与下一日的收益分配。若 H 类基金份额持有人收益账户内的累计收益不低于人民币 100 元时，则人民币 100 元整数倍的累计收益将兑付为相应 H 类基金份额。投资者当日收益的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

(4) 基金份额持有人赎回基金份额时，其对应比例的累计收益将立即结清，以现金支付给投资人，如累计的基金收益为负，则扣减赎回金额；基金份额持有人部分卖出基金份额时，不支付对应的收益，全部卖出基金份额时，以现金方式将全部累计收益与基金份额持有人结清；

(5) 当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的收益分配权益，当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的收益分配权益；当日买入的基金份额自买入当日起享有基金的收益分配权益，当日卖出的基金份额自卖出当日起不享有基金的收益分配权益；

## 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

本基金本报告期无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

### 7.4.6.1 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用

基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。

#### 7.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人

所得税。

#### 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<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 80,265,795.32           | 2,511,774.65             |
| 定期存款           | 4,900,000,000.00        | 220,000,000.00           |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | 290,000,000.00          | 160,000,000.00           |
| 存款期限 1 个月以内    | 3,240,000,000.00        | -                        |
| 存款期限 3 个月以上    | 1,370,000,000.00        | 60,000,000.00            |
| 其他存款           | -                       | -                        |
| 合计             | 4,980,265,795.32        | 222,511,774.65           |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 |       | 本期末<br>2016 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 | 1,320,256,605.84         | 1,319,376,000.00 | -880,605.84  | -0.0098 |
|    | 合计    | 1,320,256,605.84         | 1,319,376,000.00 | -880,605.84  | -0.0098 |
| 项目 |       | 上年度末<br>2015 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 | 838,884,888.10           | 840,852,000.00   | 1,967,111.90 | 0.1467  |
|    | 合计    | 838,884,888.10           | 840,852,000.00   | 1,967,111.90 | 0.1467  |

##### 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均无衍生金融资产/负债余额。

#### 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<br>2016 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 | 2,670,517,965.77         | -         |
| 合计    | 2,670,517,965.77         | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2015 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 | 453,478,720.22           | -         |
| 合计    | 453,478,720.22           | -         |

##### 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均未持有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<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 19,374.60               | 1,200.16                 |
| 应收定期存款利息   | 4,382,916.57            | 378,222.18               |
| 应收其他存款利息   | -                       | -                        |
| 应收结算备付金利息  | 108,416.36              | -                        |
| 应收债券利息     | 22,346,181.07           | 7,813,207.07             |
| 应收买入返售证券利息 | 6,257,213.01            | 763,420.04               |
| 应收申购款利息    | -                       | -                        |

|    |               |              |
|----|---------------|--------------|
| 其他 | -             | -            |
| 合计 | 33,114,101.61 | 8,956,049.45 |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 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 | 92,077.40               | 38,621.14                |
| 合计          | 92,077.40               | 38,621.14                |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | -                       | -                        |
| 预提账户维护费     | 9,000.00                | 9,000.00                 |
| 预提信息披露费     | 240,000.00              | 240,000.00               |
| 预提审计费用      | 60,000.00               | 60,000.00                |
| 合计          | 309,000.00              | 309,000.00               |

#### 7.4.7.9 实收基金

华安日日鑫货币 A

金额单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                |
|------|-----------------------------|----------------|
|      | 基金份额（份）                     | 账面金额           |
| 上年度末 | 373,339,854.99              | 373,339,854.99 |

|               |                   |                   |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 本期申购          | 1,240,997,407.06  | 1,240,997,407.06  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,390,567,836.13 | -1,390,567,836.13 |
| 本期末           | 223,769,425.92    | 223,769,425.92    |

华安日日鑫货币 B

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                   |
|---------------|-----------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额              |
| 上年度末          | 967,536,923.32              | 967,536,923.32    |
| 本期申购          | 11,556,191,998.03           | 11,556,191,998.03 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -8,118,704,008.44           | -8,118,704,008.44 |
| 本期末           | 4,405,024,912.91            | 4,405,024,912.91  |

货币 ETF

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                   |
|---------------|-----------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额              |
| 上年度末          | -                           | -                 |
| 本期申购          | 9,862,592,016.66            | 9,862,592,016.66  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -5,471,425,952.16           | -5,471,425,952.16 |
| 本期末           | 4,391,166,064.50            | 4,391,166,064.50  |

注：（1）申购含红利再投、转换入和 A 类基金份额与 B 类基金份额之间自动升降级而增加的基金份额，赎回含转换出和 A 类基金份额与 B 类基金份额之间自动升降级而减少的基金份额。

（2）H 类基金份额净值为 100.00 元，本表所列 H 类基金份额数据面值已折算为 1.00 元。

#### 7.4.7.10 未分配利润

华安日日鑫货币 A

单位：人民币元

| 项目   | 已实现部分        | 未实现部分 | 未分配利润合计      |
|------|--------------|-------|--------------|
| 本期利润 | 8,444,929.69 | -     | 8,444,929.69 |

|                |               |   |               |
|----------------|---------------|---|---------------|
| 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        | -8,444,929.69 | - | -8,444,929.69 |
| 本期末            | -             | - | -             |

#### 华安日日鑫货币 B

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分 | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 本期利润           | 47,321,677.38  | -     | 47,321,677.38  |
| 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        | -47,321,677.38 | -     | -47,321,677.38 |
| 本期末            | -              | -     | -              |

#### 货币 ETF

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分 | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 本期利润           | 18,538,260.71  | -     | 18,538,260.71  |
| 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        | -18,538,260.71 | -     | -18,538,260.71 |
| 本期末            | -              | -     | -              |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12<br>月 31 日 |
|----------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 75,942.17                                 | 74,477.59                                      |

|           |               |               |
|-----------|---------------|---------------|
| 定期存款利息收入  | 24,018,748.47 | 17,679,055.01 |
| 其他存款利息收入  | -             | -             |
| 结算备付金利息收入 | 623,374.35    | 12,391.70     |
| 其他        | -             | 22,875.61     |
| 合计        | 24,718,064.99 | 17,788,799.91 |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2016年1月1日至2016年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年<br>12月31日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 6,604,465,380.71                | 2,916,073,010.68                     |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 6,563,624,758.22                | 2,879,818,345.42                     |
| 减：应收利息总额               | 42,841,475.54                   | 33,264,995.72                        |
| 买卖债券差价收入               | -2,000,853.05                   | 2,989,669.54                         |

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                           | -                                |
| 基金转换费收入 | -                           | -                                |
| 其他      | -                           | 3,541.92                         |
| 合计      | -                           | 3,541.92                         |

#### 7.4.7.19 交易费用

本基金本报告期及上年度可比期间均无交易费用。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |
|---------|---------------------------------|----------------------------------|
| 审计费用    | 60,000.00                       | 60,000.00                        |
| 信息披露费   | 240,000.00                      | 240,000.00                       |
| 银行汇划费用  | 58,719.14                       | 51,346.27                        |
| 上市年费    | 45,000.00                       | -                                |
| 账户维护费   | 36,000.00                       | 36,000.00                        |
| 持有人大会费用 | 58,000.00                       | -                                |
| 其他      | 1,400.00                        | 400.00                           |
| 合计      | 499,119.14                      | 387,746.27                       |

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资

产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                | 与本基金的关系               |
|----------------------|-----------------------|
| 华安基金管理有限公司           | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（“建设银行”） | 基金托管人、基金代销机构          |
| 上海国际信托有限公司           | 基金管理人的股东              |
| 上海电气(集团)总公司          | 基金管理人的股东              |
| 上海工业投资(集团)有限公司       | 基金管理人的股东              |
| 上海锦江国际投资管理有限公司       | 基金管理人的股东              |
| 国泰君安投资管理股份有限公司       | 基金管理人的股东              |
| 上海电气集团财务有限责任公司       | 基金管理人的股东的控股子公司        |

注：以下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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无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<br>2016年1月1日至2016年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月<br>31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 8,272,849.59                    | 3,994,257.10                         |

|                 |            |            |
|-----------------|------------|------------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 454,318.00 | 636,284.61 |
|-----------------|------------|------------|

注：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 8 月 29 日，基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

2016 年 8 月 30 日至 2016 年 12 月 31 日，基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                    | 上年度可比期间               |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
|                | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,877,465.08          | 1,210,380.80          |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |
|----------------|-----------------------------|

|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费      |            |            |              |
|----------------|-----------------------|------------|------------|--------------|
|                | 华安日日鑫货币 A             | 华安日日鑫货币 B  | 货币 ETF     | 合计           |
| 华安基金管理有限公司     | 291,259.48            | 152,926.32 | 797,961.24 | 1,242,147.04 |
| 建设银行           | 195,958.77            | 4,211.17   | -          | 200,169.94   |
| 合计             | 487,218.25            | 157,137.49 | 797,961.24 | 1,442,316.98 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间               |            |            |              |
|                | 2015年1月1日至2015年12月31日 |            |            |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费      |            |            |              |
|                | 华安日日鑫货币A              | 华安日日鑫货币B   | 货币ETF      | 合计           |
| 华安基金管理有限公司     | 366,352.45            | 39,850.20  | -          | 406,202.65   |
| 建设银行           | 369,585.67            | 1,972.50   | -          | 371,558.17   |
| 合计             | 735,938.12            | 41,822.70  | -          | 777,760.82   |

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。H 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H = E \times \text{销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费 E 为前一日该类基金份额的基金资产净值  
基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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

单位：人民币元

| 本期                     |               |               |       |      |       |      |
|------------------------|---------------|---------------|-------|------|-------|------|
| 2016年1月1日至2016年12月31日  |               |               |       |      |       |      |
| 银行间市场<br>交易的各关<br>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 |
| 建设银行                   | 71,238,627.05 | 50,314,228.77 | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间                |               |               |       |      |       |      |
| 2015年1月1日至2015年12月31日  |               |               |       |      |       |      |

| 银行间市场<br>交易的各关<br>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     |
| 建设银行                   | -      | 20,056,792.60 | -     | -    | 50,000,000.00 | 7,808.22 |

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目                | 本期                    |                  |       | 上年度可比期间               |                  |       |
|-------------------|-----------------------|------------------|-------|-----------------------|------------------|-------|
|                   | 2016年1月1日至2016年12月31日 |                  |       | 2015年1月1日至2015年12月31日 |                  |       |
|                   | 华安日日鑫货币A              | 华安日日鑫货币B         | 货币ETF | 华安日日鑫货币A              | 华安日日鑫货币B         | 货币ETF |
| 期初持有的基金份额         | -                     | 717,001,680.31   | -     | -                     | -                | -     |
| 期间申购/买入总份额        | -                     | 581,756,054.86   | -     | -                     | 1,473,504,982.18 | -     |
| 期间因拆分变动份额         | -                     | -                | -     | -                     | -                | -     |
| 减：期间赎回/卖出总份额      | -                     | 1,019,177,382.09 | -     | -                     | 756,503,301.87   | -     |
| 期末持有的基金份额         | -                     | 279,580,353.08   | -     | -                     | 717,001,680.31   | -     |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | -                     | 6.35%            | -     | -                     | 74.11%           | -     |

注：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。

##### 7.4.10.4.2 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

华安日日鑫货币 A

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资 A 类基金。

华安日日鑫货币 B

份额单位：份

| 关联方名称 | 华安日日鑫货币B本期末 |                  | 华安日日鑫货币B上年度末 |                  |
|-------|-------------|------------------|--------------|------------------|
|       | 2016年12月31日 |                  | 2015年12月31日  |                  |
|       | 持有的基金份额     | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额      | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |

|                    |              |       |              |       |
|--------------------|--------------|-------|--------------|-------|
| 上海电气集团财务<br>有限责任公司 | 7,120,883.50 | 0.16% | 5,163,155.32 | 0.53% |
|--------------------|--------------|-------|--------------|-------|

#### 货币 ETF

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资货币 ETF（H 类基金）。

#### 7.4.10.5 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>2016年1月1日至2016年12月31日 |           | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015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    |
| 建设银行  | 80,265,795.32               | 75,942.17 | 2,511,774.65                     | 74,477.59 |

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

因本基金本报告期持有的东特钢短期融资券发生违约事件,将发行人的主体长期信用等级由 AA 下调为 C,为维护基金持有人利益,基金管理人华安基金管理有限公司决定以自有资金购买基金所涉及的风险资产,以该债券到期应付本息金额,即不低于账面价值的价格进行交易,本次交易金额为人民币 21,181,509.67 元,本次交易未对本基金的损益产生重大影响。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 1、华安日日鑫货币 A

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>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 | 本期利润分<br>配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 8,857,390.43     | 512,544.44        | -925,005.18  | 8,444,929.69 | -  |

##### 2、华安日日鑫货币 B

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>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 | 本期利润分配<br>合计  | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 45,510,067.87    | 1,860,345.04      | -48,735.53   | 47,321,677.38 | -  |

### 3、货币 ETF

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>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 | 本期利润分配<br>合计  | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 17,761,916.66    | -                 | 776,344.05   | 18,538,260.71 | -  |

#### 7.4.12 期末（2016 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

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因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

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和

控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在此可承受的范围内。

#### 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。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些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，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。

##### 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<br>2016年12月31日 | 上年末<br>2015年12月31日 |
|--------|--------------------|--------------------|
| A-1    | 60,039,000.00      | -                  |
| A-1 以下 | -                  | -                  |
| 未评级    | 928,624,000.00     | -                  |
| 合计     | 988,663,000.00     | -                  |

注：未评级债券为超短期融资券、国债和政策性金融债。

##### 7.4.13.2.2 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>2016年12月31日 | 上年末<br>2015年12月31日 |
|--------|--------------------|--------------------|
| AAA    | -                  | -                  |
| AAA 以下 | -                  | -                  |
| 未评级    | 330,713,000.00     | -                  |
| 合计     | 330,713,000.00     | -                  |

注：未评级债券为国债及政策性金融债。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难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。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 180 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。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%。本基金投资于一家公司发行的短期企业债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%。

本基金所持有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。

### 7.4.13.4 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<br>2016 年 12 月 31 日  | 6 个月以内           | 6 个月-1 年       | 1-5 年 | 不计息           | 合计               |
|--------------------------|------------------|----------------|-------|---------------|------------------|
| 资产                       |                  |                |       |               |                  |
| 银行存款                     | 4,980,265,795.32 | -              | -     | -             | 4,980,265,795.32 |
| 结算备付金                    | 20,000,000.00    | -              | -     | -             | 20,000,000.00    |
| 交易性金融资产                  | 1,250,298,651.49 | 69,957,954.35  | -     | -             | 1,320,256,605.84 |
| 买入返售金融资产                 | 2,670,517,965.77 | -              | -     | -             | 2,670,517,965.77 |
| 应收利息                     | -                | -              | -     | 33,114,101.61 | 33,114,101.61    |
| 应收申购款                    | -                | -              | -     | 926,093.11    | 926,093.11       |
| 资产总计                     | 8,921,082,412.58 | 69,957,954.35  | -     | 34,040,194.72 | 9,025,080,561.65 |
| 负债                       |                  |                |       |               |                  |
| 应付赎回款                    | -                | -              | -     | 780,650.11    | 780,650.11       |
| 应付管理人报酬                  | -                | -              | -     | 1,150,416.79  | 1,150,416.79     |
| 应付托管费                    | -                | -              | -     | 460,166.68    | 460,166.68       |
| 应付销售服务费                  | -                | -              | -     | 673,584.01    | 673,584.01       |
| 应付交易费用                   | -                | -              | -     | 92,077.40     | 92,077.40        |
| 应付利润                     | -                | -              | -     | 1,654,263.33  | 1,654,263.33     |
| 其他负债                     | -                | -              | -     | 309,000.00    | 309,000.00       |
| 负债总计                     | -                | -              | -     | 5,120,158.32  | 5,120,158.32     |
| 利率敏感度缺口                  | 8,921,082,412.58 | 69,957,954.35  | -     | 28,920,036.40 | 9,019,960,403.33 |
| 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 | 6 个月以内           | 6 个月-1 年       | 1-5 年 | 不计息           | 合计               |
| 资产                       |                  |                |       |               |                  |
| 银行存款                     | 222,511,774.65   | -              | -     | -             | 222,511,774.65   |
| 交易性金融资产                  | 678,955,519.92   | 159,929,368.18 | -     | -             | 838,884,888.10   |
| 买入返售金融资产                 | 453,478,720.22   | -              | -     | -             | 453,478,720.22   |
| 应收利息                     | -                | -              | -     | 8,956,049.45  | 8,956,049.45     |
| 应收申购款                    | -                | -              | -     | 7,627,763.84  | 7,627,763.84     |
| 资产总计                     | 1,354,946,014.79 | 159,929,368.18 | -     | 16,583,813.29 | 1,531,459,196.26 |
| 负债                       |                  |                |       |               |                  |
| 卖出回购金融资产款                | 186,999,706.50   | -              | -     | -             | 186,999,706.50   |

|         |                  |                |   |               |                  |
|---------|------------------|----------------|---|---------------|------------------|
| 应付赎回款   | -                | -              | - | 793,363.58    | 793,363.58       |
| 应付管理人报酬 | -                | -              | - | 381,627.88    | 381,627.88       |
| 应付托管费   | -                | -              | - | 115,644.78    | 115,644.78       |
| 应付销售服务费 | -                | -              | - | 82,217.96     | 82,217.96        |
| 应付交易费用  | -                | -              | - | 38,621.14     | 38,621.14        |
| 应付利息    | -                | -              | - | 10,576.12     | 10,576.12        |
| 应付利润    | -                | -              | - | 1,851,659.99  | 1,851,659.99     |
| 其他负债    | -                | -              | - | 309,000.00    | 309,000.00       |
| 负债总计    | 186,999,706.50   | -              | - | 3,582,711.45  | 190,582,417.95   |
| 利率敏感度缺口 | 1,167,946,308.29 | 159,929,368.18 | - | 13,001,101.84 | 1,340,876,778.31 |

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了归类。

#### 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<br>影响金额（单位：人民币万元） |                          |
|    |                    | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日          | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | 减少约 66                           | 减少约 64                   |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 增加约 67                           | 增加约 64                   |

#### 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

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期

限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 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人民币 1,320,256,605.84 元，无属于第一层次及第三层次余额。

于 2015 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人民币 838,884,888.10 元，无属于第一层次及第三层次余额。

##### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。

##### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

## §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   | 1,320,256,605.84 | 14.63        |
|    | 其中：债券    | 1,320,256,605.84 | 14.63        |
|    | 资产支持证券   | -                | -            |
| 2  | 买入返售金融资产 | 2,670,517,965.77 | 29.59        |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 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      | 5,000,265,795.32 | 55.40  |
| 4 | 其他各项资产            | 34,040,194.72    | 0.38   |
| 5 | 合计                | 9,025,080,561.65 | 100.00 |

## 8.2 债券回购融资情况

| 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 | 10.46        |               |
|    | 其中：买断式回购融资   | -            |               |
| 序号 | 项目           | 金额           | 占基金资产净值的比例（%） |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | -            | -             |
|    | 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

| 序号 | 发生日期       | 融资余额占基金资产净值的比例（%） | 原因        | 调整期          |
|----|------------|-------------------|-----------|--------------|
| 1  | 2016-10-12 | 29.65             | 因出现巨额赎回导致 | 在 5 个工作日调整合规 |
| 2  | 2016-10-13 | 26.20             | 因出现巨额赎回导致 | 在 5 个工作日调整合规 |

## 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    | 31  |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 100 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 31  |

### 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 | 80.94              | -                  |

|    |                            |       |   |
|----|----------------------------|-------|---|
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -     | - |
| 2  | 30 天（含）—60 天               | 1.33  | - |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -     | - |
| 3  | 60 天（含）—90 天               | 4.88  | - |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -     | - |
| 4  | 90 天（含）—120 天              | 6.76  | - |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -     | - |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）          | 5.76  | - |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -     | - |
| 合计 |                            | 99.68 | - |

#### 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

报告期内投资组合无平均剩余存续期超过 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                 | 380,714,694.93   | 4.22         |
|    | 其中：政策性金融债            | 380,714,694.93   | 4.22         |
| 4  | 企业债券                 | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券              | 739,734,101.07   | 8.20         |
| 6  | 中期票据                 | -                | -            |
| 7  | 同业存单                 | 199,807,809.84   | 2.22         |
| 8  | 其他                   | -                | -            |
| 9  | 合计                   | 1,320,256,605.84 | 14.64        |
| 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  | 111609395 | 16 浦发 CD395    | 2,000,000 | 199,807,809.84 | 2.22         |
| 2  | 100201    | 10 国开 01       | 1,000,000 | 100,080,007.09 | 1.11         |
| 3  | 011698463 | 16 华电江苏 SCP002 | 600,000   | 59,990,051.22  | 0.67         |
| 4  | 140407    | 14 农发 07       | 500,000   | 50,194,959.34  | 0.56         |
| 5  | 140421    | 14 农发 21       | 500,000   | 50,194,502.02  | 0.56         |
| 6  | 140310    | 14 进出 10       | 500,000   | 50,137,996.47  | 0.56         |
| 7  | 140401    | 14 农发 01       | 500,000   | 50,071,934.19  | 0.56         |
| 8  | 160204    | 16 国开 04       | 500,000   | 50,000,268.07  | 0.55         |
| 9  | 071621008 | 16 渤海证券 CP008  | 500,000   | 49,996,937.41  | 0.55         |
| 10 | 011698738 | 16 广新控股 SCP009 | 500,000   | 49,970,585.86  | 0.55         |

## 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 | 4        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.2218%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.3348% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0889%  |

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

3月25日起的4个交易日内，因本基金持有的东特钢短期融资券估值下调造成本基金的偏离度超过-0.25%，3月30日公司以自有资金购买基金所涉的风险资产，本基金的偏离度回归正常。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

无。

## 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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

本基金计价采用摊余成本法，即计价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，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。

### 8.9.2 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告

编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 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    | 33,114,101.61 |
| 4  | 应收申购款   | 926,093.11    |
| 5  | 其他应收款   | -             |
| 6  | 待摊费用    | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 34,040,194.72 |

## §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            |        |
|           |          |                | 持有份额             | 占总份额比例 | 持有份额             | 占总份额比例 |
| 华安日日鑫货币 A | 10,131   | 22,087.60      | 8,400,929.04     | 3.75%  | 215,368,496.88   | 96.25% |
| 华安日日鑫货币 B | 31       | 142,097,577.84 | 4,267,866,203.90 | 96.89% | 137,158,709.01   | 3.11%  |
| 货币 ETF    | 1,527    | 2,875,681.77   | 3,433,564,488.76 | 78.19% | 957,601,575.74   | 21.81% |
| 合计        | 11,689   | 771,662.28     | 7,709,831,621.70 | 85.48% | 1,310,128,781.63 | 14.52% |

注：1) 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的

分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2) 本基金场内基金份额（H类基金份额）简称为“货币ETF”，基金份额净值为100.00元，本表所列场内份额数据面值已折算为1.00元。

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

### 货币 ETF

| 序号 | 持有人名称                      | 持有份额（份）        | 占上市总份额比例 |
|----|----------------------------|----------------|----------|
| 1  | 中信证券股份有限公司                 | 300,045,300.00 | 6.83%    |
| 2  | 东方证券股份有限公司                 | 300,015,900.00 | 6.83%    |
| 3  | 方正证券股份有限公司                 | 246,465,100.00 | 5.61%    |
| 4  | 宁波珑曜投资管理中心（有限合伙）           | 200,253,600.00 | 4.56%    |
| 5  | 张志林                        | 200,241,500.00 | 4.56%    |
| 6  | 华润深国投信托有限公司－千合紫荆1号集合资金信托计划 | 200,021,100.00 | 4.56%    |
| 7  | 华安基金－中国银行－中银国际证券有限责任公司     | 174,915,100.00 | 3.98%    |
| 8  | 招商证券股份有限公司                 | 101,694,100.00 | 2.32%    |
| 9  | 上海阜盈投资管理有限公司－阜盈产业成长投资基金    | 100,057,800.00 | 2.28%    |
| 10 | 东兴证券股份有限公司                 | 100,015,300.00 | 2.28%    |

注：本基金场内基金份额（H类基金份额）简称为“货币ETF”，基金份额净值为100.00元，本表所列场内份额数据面值已折算为1.00元。

## 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 | 华安日日鑫货币 A | 1,703,990.71 | 0.76%    |
|                  | 华安日日鑫货币 B | -            | -        |
|                  | 货币 ETF    | -            | -        |
|                  | 合计        | 1,703,990.71 | 0.02%    |

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0；  
本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                  | 华安日日鑫货币 A        | 华安日日鑫货币 B         | 货币 ETF           |
|-------------------------------------|------------------|-------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2012 年 11 月 26 日）<br>基金份额总额 | 575,145,376.19   | 351,632,487.62    | -                |
| 本报告期期初基金份额总额                        | 373,339,854.99   | 967,536,923.32    | -                |
| 本报告期基金总申购份额                         | 1,240,997,407.06 | 11,556,191,998.03 | 9,862,592,016.66 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                       | 1,390,567,836.13 | 8,118,704,008.44  | 5,471,425,952.16 |
| 本报告期基金拆分变动份额                        | -                | -                 | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                        | 223,769,425.92   | 4,405,024,912.91  | 4,391,166,064.50 |

注：自 2016 年 9 月 12 日起，本基金新增场内基金份额（H 类基金份额）简称为“货币 ETF”，基金份额净值为 100.00 元，本表所列场内份额数据面值已折算为 1.00 元；场外基金份额（A 类基金份额）简称为“华安日日鑫货币 A”，基金份额净值为 1.00 元；场外基金份额（B 类基金份额）简称为“华安日日鑫货币 B”，基金份额净值为 1.00 元。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2016 年 8 月 4 日至 2016 年 8 月 25 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议期间审议并通过了《关于华安日日鑫货币市场基金增设场内份额、调整投资组合平均剩余期限限制、降低基金管理费率等有关事项的议案》，决议自 2016 年 8 月 29 日起生效，并已按规定向中国证券监督管理委员会备案。本基金修改后的《华安日日鑫货币市场基金基金合同》自 2016 年 8 月 30 日起生效，并自 2016 年 8 月 30 日起执行调整后的管理费率。本次持有人大会详情请见本基金管理人于 2016 年 8 月 30 日发布的《关于华安日日鑫货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

### 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

1、本基金管理人重大人事变动如下：

2016 年 3 月 2 日，基金管理人发布了华安日日鑫货币市场基金基金经理变更公告，新增李邦长先生为本基金的基金经理，与郑可成先生、孙丽娜女士共同管理本基金。

2016 年 12 月 17 日，基金管理人发布了华安日日鑫货币市场基金基金经理变更公告，新增苏卿

云先生为本基金的基金经理，与郑可成先生、孙丽娜女士、李邦长先生共同管理本基金。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 60,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

### 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

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 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<br>单元<br>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 |    |
| 申万宏源  | 2              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中泰证券  | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 湘财证券  | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 海通证券  | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 财富证券  | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券  | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 新时代证券 | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 广州证券  | 2              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中金公司  | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 瑞银证券  | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安  | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券  | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 上海证券  | 2              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国盛证券  | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中山证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- （1）内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- （2）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- （3）具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；
- （4）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果

进行审核，并签署审批意见。

(4)协议签署及通知托管人

基金管理人人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

2016 年 2 月完成退租托管在建设银行的德邦证券上海 33187 交易单元

2016 年 3 月完成退租托管在建设银行的长城证券上海 27450 交易单元

2016 年 5 月完成租用托管在建设银行的申万宏源证券深圳 000793 交易单元

2016 年 9 月完成租用托管在建设银行的天津证券深圳 001624 交易单元

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

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 债券交易 |              | 回购交易 |              | 权证交易 |              |
|-------|------|--------------|------|--------------|------|--------------|
|       | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期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 |
| 申万宏源  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中泰证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 湘财证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 海通证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 财富证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国信证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 新时代证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 广州证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中金公司  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 瑞银证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国泰君安  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 上海证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国盛证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 华安证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 东北证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 联讯证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 西南证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 长江证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 银河证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 兴业证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 广发证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 财达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中山证券 | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - |

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

### 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  | 华安基金关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-04 |
| 2  | 华安基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告               | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-06 |
| 3  | 华安基金管理有限公司关于参加京东淘宝费率优惠活动的公告                           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-19 |
| 4  | 关于旗下部分基金增加泰信财富为销售机构的公告                                | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-25 |
| 5  | 关于旗下部分基金增加金牛网为销售机构并参加费率优惠活动的公告                        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-14 |
| 6  | 华安基金管理有限公司关于华安日日鑫货币市场基金“春节”假期前暂停大额申购及大额转换转入及大额定期定额的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-02-01 |
| 7  | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告               | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-02-03 |
| 8  | 关于旗下部分基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告                      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-02-23 |
| 9  | 关于旗下部分基金增加中正为销售机构并参加费率优惠活动的公告                         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-02-25 |
| 10 | 华安基金管理有限公司华安日日鑫货币市场基金基金经理变更公告                         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-03-02 |
| 11 | 华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告               | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-03-28 |

|    |                                         |                             |            |
|----|-----------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 12 | 关于旗下部分基金增加苏州银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-03-23 |
| 13 | 关于旗下部分基金增加扬州国信嘉利为销售机构的公告                | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-03-23 |
| 14 | 华安基金管理有限公司关于参加深圳新兰德费率优惠的公告              | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-03-24 |
| 15 | 华安基金管理有限公司关于以固有资金购买基金所涉风险资产的公告          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-03-30 |
| 16 | 华安基金管理有限公司关于参加好买基金网费率优惠的公告              | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-04-11 |
| 17 | 关于旗下部分基金增加钱景财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-04-19 |
| 18 | 关于旗下部分基金增加格上理财为销售机构并参加费率优惠活动的公告         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-04-26 |
| 19 | 关于旗下部分基金增加中经北证为销售机构并参加费率优惠活动的公告         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-04-29 |
| 20 | 华安基金管理有限公司关于华安基金公司淘宝店关闭申购服务的公告          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-05 |
| 21 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台支付宝渠道关闭基金支付服务的公告    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-05 |
| 22 | 华安基金管理有限公司关于参加金牛网费率优惠的公告                | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-06 |
| 23 | 关于旗下部分基金增加金观诚为销售机构并参加费率优惠活动的公告          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-10 |
| 24 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-10 |
| 25 | 关于华安基金管理有限公司旗下部分基金增加平安证券为销售机构的公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-13 |
| 26 | 华安基金管理有限公司关于参加中正费率优惠的公告                 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-18 |
| 27 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加泉州银行优惠活动的公告           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-25 |
| 28 | 关于旗下部分基金增加大连银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-28 |
| 29 | 关于旗下部分基金增加东莞农商行为销售机构并参加费率优惠活动的公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-02 |
| 30 | 关于旗下部分基金增加晟视天下为销售机构并参加费率优惠活动的公告         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-03 |
| 31 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金参加诺亚费率优惠的公告             | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-03 |
| 32 | 华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-08 |

|    |                                                  |                             |            |
|----|--------------------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 33 | 关于旗下部分基金增加奕丰金融为销售机构并参加费率优惠活动的公告                  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-14 |
| 34 | 华安基金管理有限公司关于华安日日鑫货币市场基金调整大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-20 |
| 35 | 关于旗下部分基金增加广源达信为销售机构并参加费率优惠活动的公告                  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-21 |
| 36 | 关于旗下部分基金增加中信期货为销售机构的公告                           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-28 |
| 37 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加京东费率优惠活动的公告                  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-28 |
| 38 | 华安基金关于旗下部分基金增加金斧子为销售机构并参加费率优惠活动的公告               | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-07-05 |
| 39 | 关于旗下部分基金增加广发银行为销售机构的公告                           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-07-08 |
| 40 | 关于旗下部分基金增加凯恩斯为销售机构并参加费率优惠活动的公告                   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-07-12 |
| 41 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金参加和讯费率优惠的公告                      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-07-15 |
| 42 | 关于旗下部分基金增加常熟农商行为销售机构并参加费率优惠活动的公告                 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-07-20 |
| 43 | 华安基金新增蛋卷基金代销并参加费率优惠的公告                           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-07-22 |
| 44 | 华安日日鑫货币市场基金基金份额持有人大会的公告                          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-07-25 |
| 45 | 关于以通讯方式召开华安日日鑫货币市场基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-07-26 |
| 46 | 关于以通讯方式召开华安日日鑫货币市场基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-07-27 |
| 47 | 关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-04 |
| 48 | 华安基金关于旗下部分基金增加大智慧为销售机构并参加费率优惠活动的公告               | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-06 |
| 49 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中信证券优惠活动的公告                    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-09 |
| 50 | 关于旗下部分基金增加创金启富为销售机构并参加费率优惠活动的公告                  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-13 |
| 51 | 关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告                    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-15 |
| 52 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加联泰优惠活动的公告                      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-19 |

|    |                                                       |                             |            |
|----|-------------------------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 53 | 关于华安日日鑫货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告                    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-30 |
| 54 | 关于华安日日鑫货币市场基金降低管理费率、增设场内份额等并相应修改基金合同部分条款的公告           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-30 |
| 55 | 华安日日鑫货币市场基金基金合同（更新）                                   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-30 |
| 56 | 华安日日鑫货币市场基金托管协议（更新）                                   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-30 |
| 57 | 关于旗下部分基金增加昆山农商行为销售机构并参加费率优惠活动的公告                      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-06 |
| 58 | 关于华安日日鑫货币市场基金 H 类基金份额增加申购赎回代办券商的公告                    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-08 |
| 59 | 关于华安日日鑫货币市场基金 H 类基金份额增加申购赎回代办券商的公告                    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-09 |
| 60 | 关于华安日日鑫货币市场基金 H 类基金份额开放申购业务的提示性公告                     | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-10 |
| 61 | 关于旗下部分基金增加新浪仓石为销售机构并参加费率优惠活动的公告                       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-12 |
| 62 | 华安基金管理有限公司关于华安日日鑫货币市场基金“中秋”假期前暂停大额申购及大额转换转入及大额定期定额的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-12 |
| 63 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告                       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-20 |
| 64 | 关于旗下部分基金增加嘉兴银行为销售机构的公告                                | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-21 |
| 65 | 关于旗下部分基金增加宁波银行为销售机构的公告                                | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-21 |
| 66 | 华安日日鑫货币市场基金 H 类份额上市交易公告书                              | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-22 |
| 67 | 关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告                         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-23 |
| 68 | 华安基金管理有限公司关于华安日日鑫货币市场基金“国庆”假期前暂停大额申购及大额转换转入及大额定期定额的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-27 |
| 69 | 关于旗下部分基金增加苏宁为销售机构并参加费率优惠活动的公告                         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-29 |
| 70 | 关于旗下部分基金增加万得为销售机构并参加费率优惠活动的公告                         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-10-11 |
| 71 | 华安基金管理有限公司关于华安日日鑫货币市场基金调整大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-10-11 |
| 72 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金参加钱景财富费率优惠的公告                         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-10-13 |

|    |                                      |                             |            |
|----|--------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 73 | 关于华安日日鑫货币市场基金 H 类基金份额增加申购赎回代办券商的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-10-15 |
| 74 | 关于旗下部分基金增加国美为销售机构并参加费率优惠活动的公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-10-18 |
| 75 | 关于旗下部分基金增加途牛为销售机构并参加费率优惠活动的公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-10-27 |
| 76 | 关于旗下部分基金增加和耕为销售机构并参加费率优惠活动的公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-11-01 |
| 77 | 关于华安日日鑫货币市场基金 H 类基金份额增加申购赎回代办券商的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-11-03 |
| 78 | 关于旗下部分基金增加云湾投资为销售机构并参加费率优惠活动的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-11-10 |
| 79 | 关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-11-10 |
| 80 | 关于华安日日鑫货币市场基金 H 类基金份额增加申购赎回代办券商的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-11-12 |
| 81 | 关于旗下部分基金增加乾道金融为销售机构并参加费率优惠活动的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-11-16 |
| 82 | 华安基金管理有限公司关于统一客户服务热线号的公告             | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-11-16 |
| 83 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-11-29 |
| 84 | 关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-11-29 |
| 85 | 关于旗下部分基金增加懒猫为销售机构并参加费率优惠活动的公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-11-30 |
| 86 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金参加凯石费率优惠的公告          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-11-30 |
| 87 | 关于旗下部分基金增加华鑫证券为销售机构并参加费率优惠活动的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-06 |
| 88 | 关于旗下部分基金增加汇付金融为销售机构并参加费率优惠的公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-13 |
| 89 | 华安基金管理有限公司华安日日鑫货币市场基金基金经理变更公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-17 |
| 90 | 关于旗下部分基金增加东海期货为销售机构并参加费率优惠活动的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-20 |
| 91 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-22 |
| 92 | 关于华安日日鑫货币市场基金 H 类基金份额增加申购赎回代办券商的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-23 |
| 93 | 关于旗下部分基金增加河北银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-27 |
| 94 | 华安基金管理有限公司关于华安日日鑫货币市场基金元旦假期前暂停大额申购、大 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-27 |

|    |                                   |                             |            |
|----|-----------------------------------|-----------------------------|------------|
|    | 额转换转入及大额定期定额投资的公告                 |                             |            |
| 95 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中国农业银行费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-28 |
| 96 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金参加苏州银行费率优惠的公告     | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-28 |

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn) 上披露。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华安日日鑫货币市场基金基金合同》
- 2、《华安日日鑫货币市场基金招募说明书》
- 3、《华安日日鑫货币市场基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安日日鑫货币市场基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇一七年三月二十八日