

# 华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金

## 2017 年年度报告

### 2017 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：二〇一八年三月二十七日

## §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 2018 年 3 月 22 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 2017 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	5
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	10
<b>§4 管理人报告</b>	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
<b>§5 托管人报告</b>	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	19
<b>§6 审计报告</b>	19
6.1 审计意见	19
6.2 形成审计意见的基础	19
6.3 其他信息	19
6.4 管理层对财务报表的责任	19
6.5 注册会计师的责任	20
<b>§7 年度财务报表</b>	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	25
<b>§8 投资组合报告</b>	48
9.1 期末基金资产组合情况	48
9.2 债券回购融资情况	49
<b>9.3 基金投资组合平均剩余期限</b>	49
9.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	50

9.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	50
9.6 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 .....	50
9.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	50
9.8 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 .....	50
9.9 投资组合报告附注 .....	50
<b>§10 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
10.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
10.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
10.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	52
<b>§11 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§12 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
12.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
12.2 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 .....	52
12.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
12.4 基金投资策略的改变 .....	53
12.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
12.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	53
12.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
12.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	56
12.9 其他重大事件 .....	56
<b>13 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>64</b>
<b>§14 备查文件目录 .....</b>	<b>64</b>
14.1 备查文件目录 .....	64
14.2 存放地点 .....	65
14.3 查阅方式 .....	65

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金	
基金简称	华安月月鑫短期理财债券	
基金主代码	040028	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 5 月 9 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	1,928,192,765.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安月月鑫短期理财债券 A	华安月月鑫短期理财债券 B
下属分级基金的交易代码	040028	040029
报告期末下属分级基金的份额总额	30,194,139.93 份	1,897,998,625.15 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在力求本金安全的基础上，追求稳健的当期收益。
投资策略	本基金采用“运作期滚动”的方式运作，在每个运作期内，本基金将在坚持组合久期与运作期基本匹配的原则下，采用持有到期策略构建投资组合，基本保持大类品种配置的比例恒定。
业绩比较基准	无
风险收益特征	本基金为采用固定组合策略的短期理财债券型基金，属于证券投资基金中较低风险、预期收益较为稳定的品种，其预期的风险水平低于股票基金、混合基金和普通债券基金。

### 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 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		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —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	田国立

## 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	2017 年		2016 年		2015 年	
	华安月月鑫短期理财债券 A	华安月月鑫短期理财债券 B	华安月月鑫短期理财债券 A	华安月月鑫短期理财债券 B	华安月月鑫短期理财债券 A	华安月月鑫短期理财债券 B
本期已实现收益	6,083,368.97	5,535,638.95	3,038,391.43	286,003.93	9,513,198.91	5,455,493.56
本期利润	6,083,368.97	5,535,638.95	3,038,391.43	286,003.93	9,513,198.91	5,455,493.56
本期净值收益率	3.8046%	4.0533%	2.3165%	2.5617%	3.1478%	3.3956%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
	华安月月鑫短期理财债券 A	华安月月鑫短期理财债券 B	华安月月鑫短期理财债券 A	华安月月鑫短期理财债券 B	华安月月鑫短期理财债券 A	华安月月鑫短期理财债券 B
期末基金资产净值	30,194,139.93	1,897,998.625.15	266,905,845.17	27,000,200.00	157,325,382.58	11,000,200.00
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
	华安月月鑫短期理财债券 A	华安月月鑫短期理财债券 B	华安月月鑫短期理财债券 A	华安月月鑫短期理财债券 B	华安月月鑫短期理财债券 A	华安月月鑫短期理财债券 B
累计净值收益率	23.0267%	24.7066%	18.5177%	19.8490%	15.8344%	16.8556%

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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. 华安月月鑫短期理财债券 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	0.9705%	0.0025%	-	-	-	-
过去六个月	1.8284%	0.0022%	-	-	-	-
过去一年	3.8046%	0.0040%	-	-	-	-
过去三年	9.5524%	0.0080%	-	-	-	-
过去五年	20.1538%	0.0093%	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	23.0267%	0.0090%	-	-	-	-

##### 2. 华安月月鑫短期理财债券 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	1.0332%	0.0026%	-	-	-	-
过去六个月	1.9524%	0.0022%	-	-	-	-
过去一年	4.0533%	0.0040%	-	-	-	-
过去三年	10.3424%	0.0080%	-	-	-	-
过去五年	21.6036%	0.0093%	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	24.7066%	0.0091%	-	-	-	-

#### 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

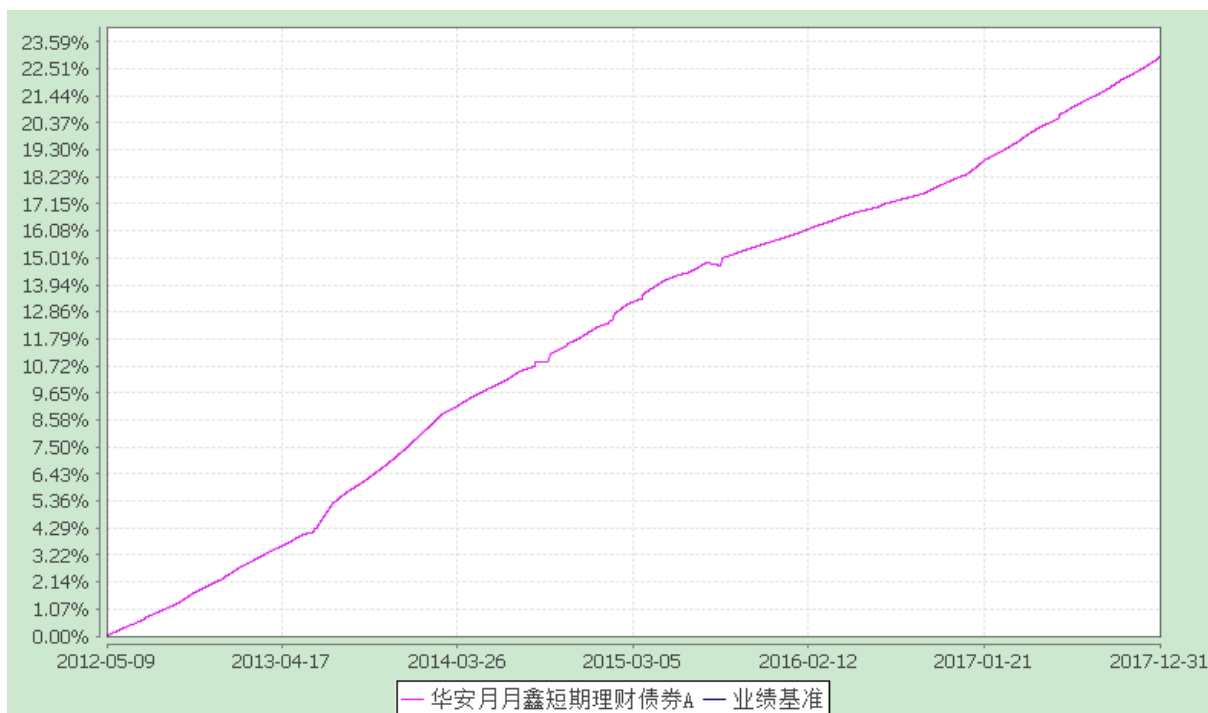
华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金

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

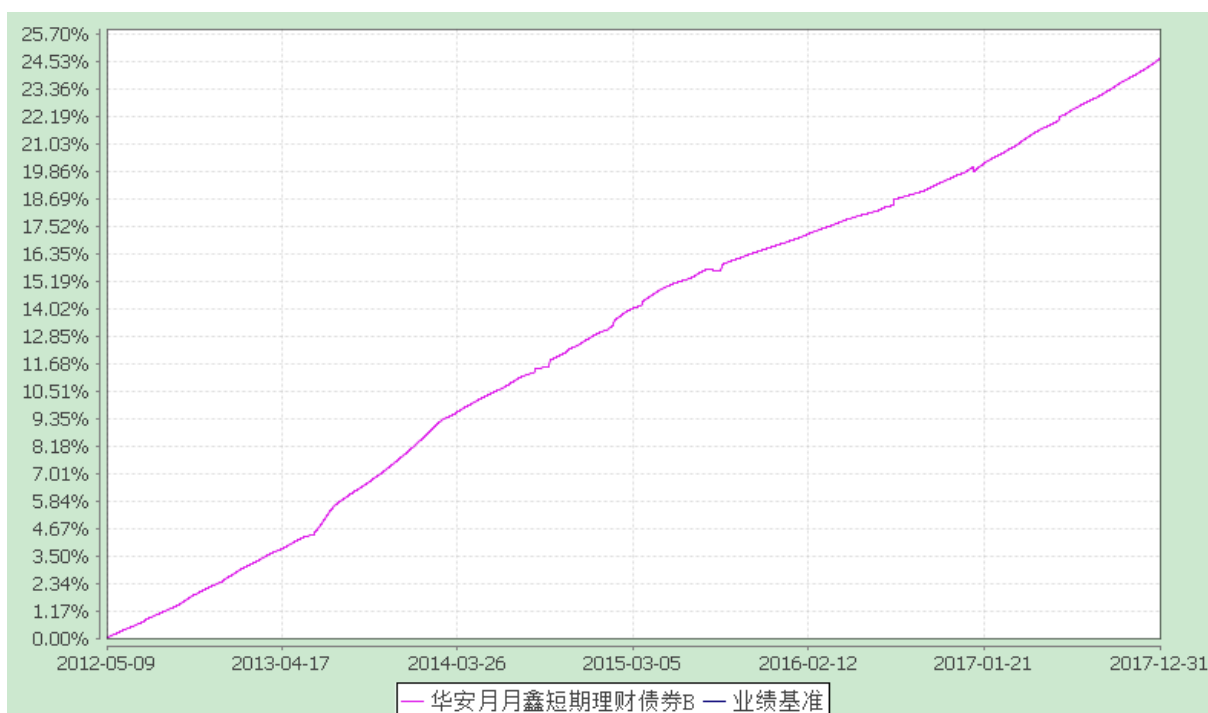
(2012年5月9日至2017年12月31日)

##### 1、华安月月鑫短期理财债券 A





## 2、华安月月鑫短期理财债券 B



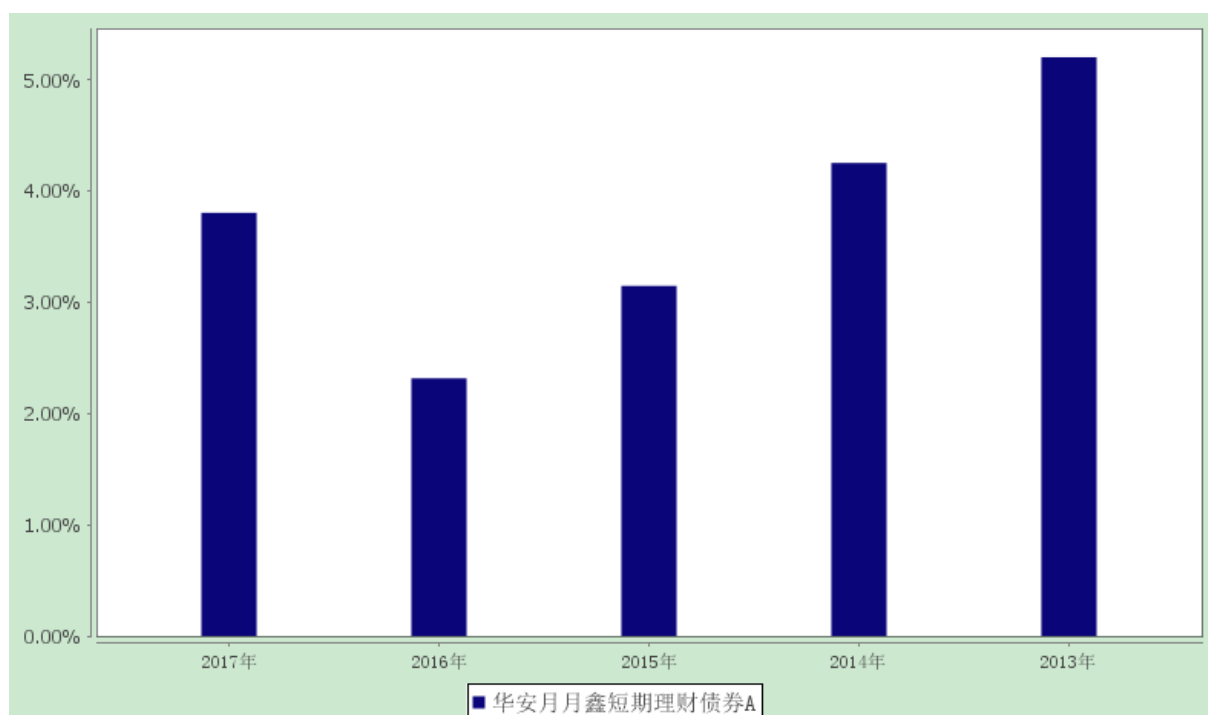
注：根据《华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》规定，本基金已自基金合同生效之日起每个运作期的 5 个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二部分投资范围的有关规定。

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

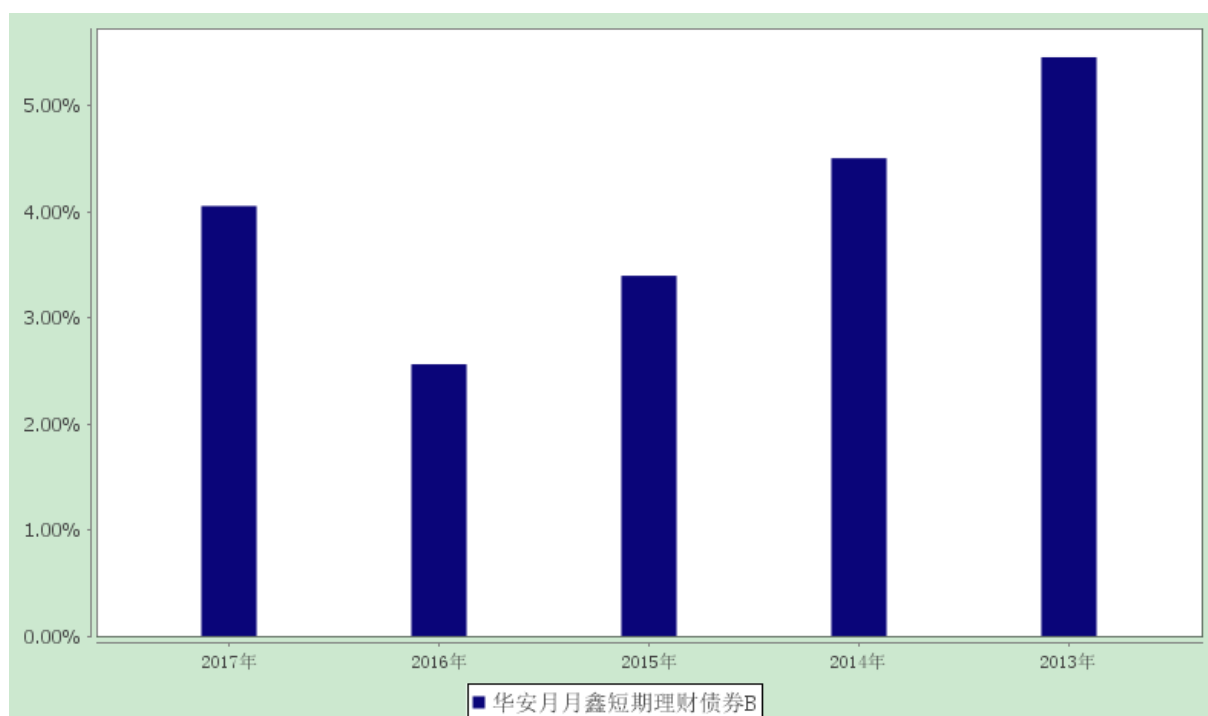
华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金

过去五年基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

1、华安月月鑫短期理财债券 A



2、华安月月鑫短期理财债券 B



注：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

华安月月鑫短期理财债券 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
2017 年	472,949.26	5,680,624.68	-70,204.97	6,083,368.97	-
2016 年	290,350.99	2,647,743.04	100,297.40	3,038,391.43	-
2015 年	909,268.04	8,655,684.53	-51,753.66	9,513,198.91	-
合计	1,672,568.29	16,984,052.25	-21,661.23	18,634,959.31	-

华安月月鑫短期理财债券 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
2017 年	-	2,242,291.43	3,293,347.52	5,535,638.95	-
2016 年	-	274,951.08	11,052.85	286,003.93	-
2015 年	167,056.55	5,362,708.69	-74,271.68	5,455,493.56	-
合计	167,056.55	7,879,951.20	3,230,128.69	11,277,136.44	-

## §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。目前的股东为国泰君安投资管理股份有限公司、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创新投资有限公司。公司在北京、上海、沈阳、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司—华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2017 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 98 只开放式基金，管理资产规模达到 1851.32 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 (助理) 期限	证券从业 年限	说明

		任职日期	离任日期		
贺涛	本基金的基金经理、固定收益部总监	2013-10-08	2017-07-31	20 年	金融学硕士（金融工程方向），20 年证券、基金从业经历。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。2008 年 4 月起担任华安稳定收益债券型证券投资基金的基金经理。2011 年 6 月起同时担任华安可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 12 月至 2017 年 6 月担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 6 月起同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部助理总监。2013 年 8 月起担任固定收益部副总监。2013 年 10 月至 2017 年 7 月同时担任本基金、华安现金富利投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 7 月至 2017 年 7 月同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理。2015 年 2 月至 2017 年 6 月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 5 月起担任固定收益部总监。2015 年 5 月至 2017 年 7 月担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 9 月起担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 7 月，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，同时担任华安安华保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 7 月起同时担任华安安进保本混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月起，同时担任华安睿享定期开放混合型发起式证券投资基金、华安新希望灵活配置混

					<p>合型证券投资基金的基金经理。 2017 年 2 月起，同时担任华安新活力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
朱才敏	本基金的基金经理	2014-11-20	2017-07-31	10 年	<p>金融工程硕士，具有基金从业资格证书，10 年基金行业从业经历。2007 年 7 月应届生毕业进入华安基金，历任金融工程部风险管理员、产品经理、固定收益部研究员、基金经理助理等职务。2014 年 11 月至 2017 年 7 月，同时担任本基金、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的基金经理。2014 年 11 月起，同时担任华安双债添利债券型证券投资基金、华安汇财通货币市场基金的基金经理。2015 年 5 月起同时担任华安新回报灵活配置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 9 月起，同时担任华安新财富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月起，同时担任华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 12 月起，同时担任华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起，同时担任华安睿安定期开放混合型证券投资基金的基金经理。</p>
李邦长	本基金的基金经理	2016-03-02	-	7 年	<p>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 月起担任本基金、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</p>

					券型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------

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 1 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

2017 年，全球经济周期延续回升态势，贸易形势出现改善，主要发达国家货币政策边际收紧。美国经济维持复苏态势，居民消费稳健增长，通胀形势低于预期，失业率进一步下滑。全年美联储议息会议三次上调联邦基金利率；欧元区经济基本面好转，PMI 数据继续回升，信贷环境改善，欧央行上调未来实际 GDP 和通胀预测值，并考虑货币政策正常化的同时关注汇率对经济增长的影响；日本通胀超预期，制造业 PMI 上行，经济复苏动力增强。国内经济方面，下半年工业生产和工业企业利润增速有所回落，制造业、房地产和基建投资放缓，仍表现出较强韧性，消费总体平稳，通胀表现温和；央行继续实施量价分离货币政策，在价格方面，全年三次上调逆回购和 MLF 等利率；在流动性管理方面，继续通过公开市场操作和 MLF 续作等方式来维稳资金面波动，在春节和季末等时

点，资金利率波动有所加大。由于经济基本面表现出较强韧性、金融去杠杆进一步推进以及流动性波动加大，债市调整幅度较大，收益率大幅上行，全年十年期国债收益率上行幅度超过 80bp，3Y-5Y 期 AAA 级中短期票据上行幅度超过 130bp，信用利差明显扩大。

本报告期内，合理安排组合久期，主要滚动投资于利率较高的同业存款和银行间逆回购，同时把握机会，配置优质中高等级同业存单以获得可观的持有收益。组合整体在有效控制流动性风险的前提下，保证了适中的整体收益率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

华安月月鑫短期理财债券收益率及规模变化:

##### 1、华安月月鑫短期理财 A

投资回报：3.8046%

期初规模：2.67 亿 期末规模：0.30 亿

##### 2、华安月月鑫短期理财 B

投资回报：4.0533%

期初规模：0.27 亿 期末规模：18.98 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 2018 年，监管政策控风险和金融去杠杆基调预计将维持不变，工业生产受供给侧改革与环保督查等影响难有显著改善，房地产调控政策延续，销售增速的下行和融资成本的抬升带来投资增速的下行压力，基建因财政支出空间有限，投资增速也将小幅回落，而贸易复苏呈现全球性和结构性，对经济增长有一定支撑，经济整体失速风险较小。全年来看，通胀预计小幅回升，不会对货币政策构成较大压力，预计央行货币政策仍将定调稳健中性。债市影响因素多空交错，未来若社会融资需求增速回落速度向广义货币增速收敛，债市可能迎来下行机会。

操作方面，我们将继续把握基金的流动性和收益性的平衡，优化组合资产配置计划，把握结构性机会，主要通过锁定高收益同业存款和甄选优质同业存单博取较高的持有收益，提高组合整体收益，为投资者创造更多价值。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) 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。

(2) 强化内控建设，持续进行投资管理人员合规培训，坚守“三条底线”；

(3) 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。

(4) 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。

(5) 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。

(6) 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

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

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，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；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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，每月集中支付收益。本报告期华安月月鑫短期理财 A 累计收益分配金额 6,083,368.97 元，华安月月鑫短期理财 B 累计收益分配金额 5,535,638.95 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：华安月月鑫短期理财 A 为 6,083,368.97 元，华安月月鑫短期理财 B 为 5,535,638.95 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(2018)审字第 60971571\_B01 号

华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金管理层（以下简称管理层）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.4 管理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护

必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

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 蔡玉芝

上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

2018 年 3 月 22 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	8,408,068.55	3,917,392.66
结算备付金		-	77,272.73
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	-	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	1,920,003,024.25	290,251,155.38
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	3,548,010.25	166,508.54
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

资产总计		1,931,959,103.05	294,412,329.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬	7.4.10.2	161,657.72	34,705.83
应付托管费	7.4.10.2	43,108.82	9,254.91
应付销售服务费		21,671.57	26,475.90
应付交易费用	7.4.7.7	4,830.79	3,920.98
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		3,356,069.07	132,926.52
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	179,000.00	299,000.00
<b>负债合计</b>		<b>3,766,337.97</b>	<b>506,284.14</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	1,928,192,765.08	293,906,045.17
未分配利润	7.4.7.10	-	-
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,928,192,765.08</b>	<b>293,906,045.17</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,931,959,103.05</b>	<b>294,412,329.31</b>

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 1,928,192,765.08 份，其中 A 类基金份额总额 30,194,139.93 份；B 类基金份额总额 1,897,998,625.15 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>13,224,888.56</b>	<b>4,529,751.87</b>
1.利息收入		13,224,888.56	4,529,654.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	519,828.26	941,379.13
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,705,060.30	3,588,275.72
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-	-
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	-	-
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	-	97.02
<b>减：二、费用</b>		<b>1,605,880.64</b>	<b>1,205,356.51</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2	777,398.87	427,626.38
2. 托管费	7.4.10.2	207,306.38	114,033.61
3. 销售服务费		407,405.93	329,747.50
4. 交易费用	7.4.7.19	222.17	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	213,547.29	333,949.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>11,619,007.92</b>	<b>3,324,395.36</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>11,619,007.92</b>	<b>3,324,395.36</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	293,906,045.17	-	293,906,045.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,619,007.92	11,619,007.92
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）	1,634,286,719.91	-	1,634,286,719.91
其中：1.基金申购款	5,996,797,851.68	-	5,996,797,851.68
2.基金赎回款	-4,362,511,131.77	-	-4,362,511,131.77
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）	-	-11,619,007.92	-11,619,007.92
五、期末所有者权益（基金净值）	1,928,192,765.08	-	1,928,192,765.08
项目	上年度可比期间 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）	168,325,582.58	-	168,325,582.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,324,395.36	3,324,395.36
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）	125,580,462.59	-	125,580,462.59
其中：1.基金申购款	381,900,664.21	-	381,900,664.21
2.基金赎回款	-256,320,201.62	-	-256,320,201.62
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）	-	-3,324,395.36	-3,324,395.36
五、期末所有者权益（基金净值）	293,906,045.17	-	293,906,045.17

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：赵敏，会计机构负责人：陈林

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金(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]541号《关于核准华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2012年5月9日正式生效，首次设立募集规模为18,222,083,409.04份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金以“运作期滚动”方式运作。自基金合同生效日起，本基金在运作期内不开放当期的日常申购与赎回，仅在运作期倒数第2个工作日开放当期赎回并在每个运作期临近到期日前开放下一运作期的集中申购。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金根据基金份额持有人持有本基金份额的数量，对基金份额持有人持有的基金份额按照不

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。

本基金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、银行定期存款、大额存单、债券回购、短期融资券、国债、中央银行票据、金融债、中期票据、企业债及中国证监会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，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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，即每年自 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

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

本基金的金融资产于初始确认时分类为交易性金融资产及贷款和应收款项。

本基金的金融负债于初始确认时分类为其他金融负债。

#### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产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以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (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，该等利息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。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

##### (2) 回购协议

本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，也可以使用合同利率）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；

本基金持有的金融工具的估值方法具体如下：

##### (1) 银行存款

本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

本基金持有的付息债券、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) 回购协议

1) 本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) 本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

1) 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方法估值；

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所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(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/损失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

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) 本基金各类别基金份额对应的可分配收益将有所不同，同类每份基金份额享有同等分配权；

(2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于

一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按人民币 1.00 元的基金份额净值自动转为基金份额；

(3) 本基金根据每个运作期的基金收益情况，在每个运作期末将当期收益全部分配；

(4) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按人民币 1.00 元的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(5) 投资人在每个运作期末收益支付时，若期末收益为正值，则根据投资人选择的收益分配方式进行现金分红或为投资人增加相应的基金份额；若其期末收益为负值，则缩减投资人相应的基金份额或赎回金额；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### **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 增值税**

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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	8,408,068.55	3,917,392.66
定期存款	-	-
存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
其他存款	-	-
合计	8,408,068.55	3,917,392.66

7.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有交易性金融资产。

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 2017 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	1,920,003,024.25	-
合计	1,920,003,024.25	-
项目	上年度末	
	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	290,251,155.38	-
合计	290,251,155.38	-

#### 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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,801.20	768.24
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	38.28
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	3,523,408.00	162,300.14
应收申购款利息	22,801.05	3,401.88
其他	-	-
合计	3,548,010.25	166,508.54

#### 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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 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	4,830.79	3,920.98
合计	4,830.79	3,920.98

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 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
预提审计费	30,000.00	50,000.00
预提信息披露费	140,000.00	240,000.00
合计	179,000.00	299,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

华安月月鑫短期理财债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	266,905,845.17	266,905,845.17
本期申购	3,498,160,426.53	3,498,160,426.53
本期赎回（以“-”号填列）	-3,734,872,131.77	-3,734,872,131.77
本期末	30,194,139.93	30,194,139.93

华安月月鑫短期理财债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	27,000,200.00	27,000,200.00
本期申购	2,498,637,425.15	2,498,637,425.15
本期赎回（以“-”号填列）	-627,639,000.00	-627,639,000.00
本期末	1,897,998,625.15	1,897,998,625.15

注：申购含红利再投和 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 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。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 华安月月鑫短期理财债券 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	6,083,368.97	-	6,083,368.97
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-6,083,368.97	-	-6,083,368.97
本期末	-	-	0.00

##### 华安月月鑫短期理财债券 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	5,535,638.95	-	5,535,638.95
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	-5,535,638.95	-	-5,535,638.95
本期末	-	-	0.00

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	42,301.91	29,684.98
定期存款利息收入	438,319.45	905,436.11
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	370.82	2,740.25
其他	38,836.08	3,517.79
合计	519,828.26	941,379.13

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

#### 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。

#### 7.4.7.15 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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他收入	-	97.02
合计	-	97.02

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	222.17	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	222.17	-

7.4.7.20 他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	30,000.00	50,000.00
信息披露费	140,000.00	240,000.00
银行汇划费用	6,347.29	6,749.02
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	213,547.29	333,949.02

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

本基金于资产负债表日之后、年度报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配的情况如下：

宣告日 分配收益所属期间

2018 年第 1 期收益支付公告 2018-01-24 2017-12-22~2018-01-22

2018 年第 2 期收益支付公告 2018-02-24 2018-01-23~2018-02-22

截至财务报表批准日，除上述利润分配事项及在 7.4.6.1 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（“华安基金公司”）	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（“中国建设银行”）	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
国泰君安创新投资有限公司	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
华安资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 经华安基金管理有限公司股东会第四十一次会议审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2017】1809 号文核准，华安基金管理有限公司的原股东上海电气（集团）总公司已变更为国泰君安创新投资有限公司。华安基金管理有限公司已于 2017 年 10 月 17 日就上述股东变更事项进行公告。

#### 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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	777,398.87	427,626.38
其中：支付销售机构的客户维护费	313,621.08	173,416.63

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个运作期结束月末。

#### 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
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	207,306.38	114,033.61

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个运作期结束月末。

#### 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		
	2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安月月鑫短期理财债券 A	华安月月鑫短期理财债券 B	合计
华安基金	28,056.31	96.08	28,152.39
建设银行	120,004.14	1,430.61	121,434.75
合计	148,060.45	1,526.69	149,587.14
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	华安月月鑫短期理财债券 A	华安月月鑫短期理财债券 B	合计
华安基金	33,219.09	3.68	33,222.77
建设银行	126,644.79	497.76	127,142.55
合计	159,863.88	501.44	160,365.32

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率。B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年基金销售服



务费率应自其升级后的下一个工作日起适用 B 类基金份额持有人的费率。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{各类基金份额的销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日各类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日的各类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每个运作期结束月末。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 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

无。

##### 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

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本基金。

#### 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016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	8,408,068.55	42,301.91	3,917,392.66	29,684.98

#### 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 1、华安月月鑫短期理财债券 A

单位：人民币元

已按再投资形式转	直接通过应付	应付利润	本期利润分	备注
实收基金	赎回款转出金额	本年变动	配合计	

472,949.26	5,680,624.68	-70,204.97	6,083,368.97	-
------------	--------------	------------	--------------	---

## 2、华安月月鑫短期理财债券 B

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
-	2,242,291.43	3,293,347.52	5,535,638.95	-

### 7.4.12 期末（2017 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 2017 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 2017 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

本基金为采用固定组合策略的短期理财债券型基金，属于证券投资基金中较低风险、预期收益较为稳定的品种，其预期的风险水平低于股票基金、混合基金和普通债券基金。本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。

#### 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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### **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。

本公司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，并根据本公司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。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日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。

##### **7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》于约定开放日《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内,本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外,本基金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,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内,本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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在运作期内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。

本基金的定期存款由于事先协定利率，对市场利率波动不敏感，但存在定期存款存期超过运作期的情况，如提前支取会存在一定利息损失，但由于比例控制均在基金可控范围之内，故相关风险较小。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	8,408,068.55	-	-	-	8,408,068.55
买入返售金融资产	1,920,003,024.25	-	-	-	1,920,003,024.25
应收利息	-	-	-	3,548,010.25	3,548,010.25
资产总计	1,928,411,092.80	-	-	3,548,010.25	1,931,959,103.05
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	161,657.72	161,657.72
应付托管费	-	-	-	43,108.82	43,108.82
应付销售服务费	-	-	-	21,671.57	21,671.57
应付交易费用	-	-	-	4,830.79	4,830.79

应付利润	-	-	-	3,356,069.07	3,356,069.07
其他负债	-	-	-	179,000.00	179,000.00
负债总计	-	-	-	3,766,337.97	3,766,337.97
利率敏感度缺口	1,928,411,092.80	-	-	-218,327.72	1,928,192,765.08
上年度末 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	3,917,392.66	-	-	-	3,917,392.66
结算备付金	77,272.73	-	-	-	77,272.73
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	290,251,155.38	-	-	-	290,251,155.38
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	166,508.54	166,508.54
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	294,245,820.77	-	-	166,508.54	294,412,329.31
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	34,705.83	34,705.83
应付托管费	-	-	-	9,254.91	9,254.91
应付销售服	-	-	-	26,475.90	26,475.90

务费					
应付交易费用				3,920.98	3,920.98
应付税费				-	-
应付利息				-	-
应付利润				132,926.52	132,926.52
其他负债				299,000.00	299,000.00
负债总计				506,284.14	506,284.14
利率敏感 度缺口	294,245,820.77			-339,775.60	293,906,045.17

注：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

本基金 2017 年 12 月 31 日末及 2016 年 12 月 31 日末均未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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

#### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

本基金于 2017 年 12 月 31 日及 2016 年 12 月 31 日末均未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

#### 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 2018 年 3 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

9.1 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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	1,920,003,024.25	99.38
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,408,068.55	0.44
8	其他各项资产	3,548,010.25	0.18



9	合计	1,931,959,103.05	100.00
---	----	------------------	--------

## 9.2 债券回购融资情况

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40%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 40%。

## 9.3 基金投资组合平均剩余期限

### 9.3.1 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	22
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	32
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

不适用。

### 9.3.2 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	100.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

合计	100.01	-
----	--------	---

#### 9.4 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。

#### 9.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 9.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 9.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	-
报告期内偏离度的最低值	-
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	-

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

无。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

无。

#### 9.8 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。

#### 9.9 投资组合报告附注

##### 9.9.1 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。

本基金通过每日计算收益的方式，使基金份额净值保持在 1.00 元。

9.9.2 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。

##### 9.9.3 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	3,548,010.25
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,548,010.25

### §10 基金份额持有人信息

#### 10.1 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
华安月月鑫短期理财债券 A	3,137	9,625.16	441.39	0.00%	30,193,698.54	100.00%
华安月月鑫短期理财债券 B	1,832	1,036,025.45	985,442,698.00	51.92%	912,555,927.15	48.08%
合计	4,969	388,044.43	985,443,139.39	51.11%	942,749,625.69	48.89%

注：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）。

### 10.2 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	华安月月鑫短期理财债券 A	63,137.69	0.21%
	华安月月鑫短期理财债券 B	3,701,484.19	0.20%
	合计	3,764,621.88	0.20%

### 10.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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。

## §11 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安月月鑫短期理财债券 A	华安月月鑫短期理财债券 B
基金合同生效日（2012 年 5 月 9 日）基金份额总额	16,063,071,016.76	2,159,012,392.28
本报告期期初基金份额总额	266,905,845.17	27,000,200.00
本报告期基金总申购份额	3,498,160,426.53	2,498,637,425.15
减：本报告期基金总赎回份额	3,734,872,131.77	627,639,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	30,194,139.93	1,897,998,625.15

注：申购含红利再投及分级份额调增份额；赎回含分级份额调减份额。

## §12 重大事件揭示

### 12.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 12.2 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：

(1) 2017 年 8 月 9 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，

章国富先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(2)2018 年 2 月 13 日,基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》,翁启森先生、姚国平先生、谷媛媛女士新任本基金管理人的副总经理。

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:

2017 年 9 月 1 日,中国建设银行发布公告,聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

### 12.3 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。

### 12.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 12.5 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 30,000.00 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。

### 12.6 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证券监管部门稽查或处罚等情况。

### 12.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 12.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券退租	1	-	-	-	-	-

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	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
长城证券	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	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

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领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《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：

2017 年 11 月完成租用托管在建行的长江证券深圳 000510 交易单元。

12.7.2 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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券退租	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	4,000,000.00	10.64%	-	-
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	-	-	33,600,000.00	89.36%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
长城证券退租	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

### 12.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

### 12.9 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	关于旗下部分基金增加济安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	2017-01-11
2	关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金投资组合构建情况说明的公告(2017年第1期)	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-12
3	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金2017年第1期赎回开放日及2017年第2期集中申购开放期相关安排的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-16
4	关于华安旗下部分基金增加广发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	2017-01-19
5	华安基金管理有限公司关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金2017年第1期收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-26
6	关于旗下部分基金增加北京肯特瑞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	2017-02-08



		司网站	
7	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	2017-02-13
8	关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金投资组合构建情况说明的公告(2017年第2期)	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-14
9	关于旗下部分基金增加海峡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	2017-02-15
10	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金2017年第2期赎回开放日及2017年第3期集中申购开放期相关安排的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-15
11	关于旗下部分基金增加朝阳永续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	2017-02-22
12	华安基金管理有限公司关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金2017年第2期收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-27
13	关于旗下部分基金增加华阳众惠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	2017-03-02
14	关于华龙证券开通华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金“约定赎回”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-03
15	关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金投资组合构建情况说明的公告(2017年第3期)	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-09
16	关于旗下部分基金增加河北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	2017-03-16
17	关于海峡银行开通华安月月鑫、月安鑫短期理财债券型证券投资基金“约定赎回”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-18
18	关于旗下部分基金增加华夏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	2017-03-21
19	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金2017年第3期赎回开放日及2017年第4期集中申购开放期相关安排的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-21
20	关于中原证券开通华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金“约定赎回”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-22
21	关于恒天明泽开通华安月月鑫、月安鑫短期理	《上海证券报》、《证券时	2017-03-23

	财债券型证券投资基金“约定赎回”业务的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
22	关于河北银行开通华安月月鑫、月安鑫短期理财债券型证券投资基金“约定赎回”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-24
23	关于浙商银行开通华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金“约定赎回”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-24
24	关于宁波银行开通华安月月鑫、月安鑫短期理财债券型证券投资基金“约定赎回”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-25
25	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	2017-03-28
26	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加广发证券申购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	2017-03-30
27	华安基金管理有限公司关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 3 期收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-31
28	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加通华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	2017-04-06
29	华安基金关于参加华宝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	2017-04-12
30	关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金投资组合构建情况说明的公告(2017 年第 4 期)	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-14
31	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 4 期赎回开放日及 2017 年第 5 期集中申购开放期相关安排的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-18
32	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	2017-04-19
33	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	2017-04-22
34	关于“微钱宝”快速取现服务升级的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-25
35	华安基金管理有限公司关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 4 期收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-28

36	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	2017-05-10
37	关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金投资组合构建情况说明的公告(2017年第5期)	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-11
38	关于旗下部分基金增加武汉伯嘉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	2017-05-17
39	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 5 期赎回开放日及 2017 年第 6 期集中申购开放期相关安排的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-17
40	关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金变更运作期确定方式的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-27
41	关于旗下部分基金增加江西正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	2017-05-24
42	华安基金管理有限公司关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 5 期收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-31
43	关于陆金所开通华安月月鑫、月安鑫短期理财债券型证券投资基金“约定赎回”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-01
44	华安基金关于参加上海农商行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-07
45	关于旗下部分基金增加晋商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	2017-06-08
46	关于旗下部分基金增加基煜基金为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-10
47	关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-10
48	关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金投资组合构建情况说明的公告(2017年第6期)	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-12
49	关于旗下部分基金增加科地瑞富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	2017-06-12
50	关于增加旗下部分基金增加凤凰金信为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公	2017-06-15

		司网站	
51	关于旗下部分基金增加挖财为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-20
52	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 6 期赎回开放日及 2017 年第 7 期集中申购开放期相关安排的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-20
53	关于旗下部分基金增加中原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	2017-06-22
54	关于云湾开通华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金“约定赎回”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-22
55	关于增加旗下部分基金增加中泰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	2017-06-23
56	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的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-27
57	华安基金管理有限公司关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 6 期收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-30
58	关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金投资组合构建情况说明的公告(2017 年第 7 期)	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-07-12
59	华安关于旗下部分基金增加锦安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	2017-07-19
60	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 7 期赎回开放日及 2017 年第 8 期集中申购开放期相关安排的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-07-19
61	华安基金关于旗下部分基金增加财路基金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	2017-07-25
62	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同(更新)	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-07-27
63	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金托管协议(更新)	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-07-27
64	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金修改基金合同的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-07-27
65	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金基	《上海证券报》、《证券时	2017-07-29

	金经理变更公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
66	华安基金管理有限公司关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 7 期收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-07-31
67	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华信证券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	2017-08-07
68	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-09
69	华安基金管理有限公司关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金投资组合构建情况说明的公告（2017 年第 8 期）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-10
70	华安基金管理有限公司关于华安旗下部分基金增加蚂蚁基金为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-16
71	华安基金管理有限公司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	2017-08-17
72	华安基金关于参加东莞农商行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-18
73	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江南农商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	2017-08-19
74	关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金变更运作期确定方式的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-22
75	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 8 期赎回开放日及 2017 年第 9 期集中申购开放期相关安排的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-22
76	华安基金管理有限公司关于开通通华财富华安月月鑫、月安鑫短期理财债券型证券投资基金“约定赎回”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-23
77	华安基金关于参加江南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	2017-08-30
78	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万家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	2017-09-05
79	关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金投资组合构建情况说明的公告（2017 年第 9 期）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-12

80	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	2017-09-13
81	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 9 期赎回开放日及 2017 年第 10 期集中申购开放期相关安排的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-14
82	华安基金管理有限公司关于开通好买基金华安月月鑫、月安鑫短期理财债券型证券投资基金“约定赎回”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-15
83	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宜信普泽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	2017-09-15
84	华安基金关于参加长江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	2017-09-19
85	华安基金管理有限公司关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 9 期收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-23
86	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-27
87	关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金投资组合构建情况说明的公告（2017 年第 10 期）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-10-12
88	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金牛网为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-10-12
89	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 10 期赎回开放日及 2017 年第 11 期集中申购开放期相关安排的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-10-16
90	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-10-17
91	华安基金管理有限公司关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 10 期收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-10-25
92	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华羿恒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	2017-11-01
93	关于华安基金电子直销平台开通协助投资者购买合作商户实物黄金业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-11-02
94	关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金投资组合构建情况说明的公告（2017 年第	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公	2017-11-06

	11 期)	司网站	
95	华安基金关于参加中信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	2017-11-08
96	华安基金关于参加汇成基金优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-11-10
97	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 11 期赎回开放日及 2017 年第 12 期集中申购开放期相关安排的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-11-15
98	华安基金管理有限公司关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 11 期收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-11-24
99	关于旗下部分基金增加民族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	2017-11-25
100	关于旗下部分基金增加包商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	2017-11-28
101	关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金投资组合构建情况说明的公告（2017 年第 12 期）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-12-06
102	新增销售机构开通华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金“约定赎回”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-12-06
103	关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 B 类基金份额调整申购最低金额限制及账户最低余额限制的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-12-09
104	关于新增中信山东证券开通华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金“约定赎回”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-12-09
105	华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 12 期赎回开放日及 2018 年第 1 期集中申购开放期相关安排的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-12-14
106	华安基金关于参加中金公司优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-12-16
107	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	2017-12-19
108	更新华安基金管理有限公司关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年第 12 期收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-12-23
109	华安基金关于参加东莞农商行优惠活动的公	《上海证券报》、《证券时	2017-12-29

	告	报》、《中国证券报》和公司网站	
110	关于华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金 2018 年第一季度运作期安排的预告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-12-30

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 上披露。

### 13 影响投资者决策的其他重要信息

#### 13.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170930	28,000,000.00	100,000,000.00	128,000,000.00	0.00	0.00%
	2	20170401-20170630	56,000,000.00	144,000,000.00	0.00	200,000,000.00	10.37%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

#### 13.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### §14 备查文件目录

#### 14.1 备查文件目录

- 1、《华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金设立的文件；
- 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；

#### **14.2 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>。

#### **14.3 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

二〇一八年三月二十七日