

# 华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金

## 2018 年半年度报告

### 2018 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

## 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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现</b>                  | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| <b>4 管理人报告</b>                          | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明              | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10 |
| 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             | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13 |
| 4.8 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       | 13 |
| <b>5 托管人报告</b>                          | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 13 |
| 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 | 13 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见      | 13 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>                | 13 |
| 6.1 资产负债表                               | 13 |
| 6.2 利润表                                 | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 16 |
| 6.4 报表附注                                | 17 |
| <b>7 投资组合报告</b>                         | 34 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 34 |
| 7.2 债券回购融资情况                            | 34 |
| <b>7.3 基金投资组合平均剩余期限</b>                 | 35 |
| 7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 35 |
| 7.5 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      | 35 |
| 7.6“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离           | 36 |
| 7.7 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   | 36 |
| 7.8 投资组合报告附注                            | 36 |
| <b>8 基金份额持有人信息</b>                      | 37 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 37 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 37 |
| 8.3 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       | 37 |
| <b>9 开放式基金份额变动</b>                      | 38 |
| <b>10 重大事件揭示</b>                        | 38 |

|           |                                   |           |
|-----------|-----------------------------------|-----------|
| 10.1      | 基金份额持有人大会决议 .....                 | 38        |
| 10.2      | 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 ..... | 38        |
| 10.3      | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....      | 38        |
| 10.4      | 基金投资策略的改变 .....                   | 38        |
| 10.5      | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....            | 38        |
| 10.6      | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....    | 38        |
| 10.7      | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....           | 38        |
| 10.7.2    | 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况 .....     | 40        |
| 10.8      | 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....           | 41        |
| 10.9      | 其他重大事件 .....                      | 41        |
| <b>11</b> | <b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>       | <b>43</b> |
| <b>12</b> | <b>备查文件目录 .....</b>               | <b>44</b> |
| 12.1      | 备查文件目录 .....                      | 44        |
| 12.2      | 存放地点 .....                        | 44        |
| 12.3      | 查阅方式 .....                        | 45        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称            | 华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金 |                    |
| 基金简称            | 华安季季鑫短期理财债券        |                    |
| 基金主代码           | 040030             |                    |
| 交易代码            | 040030             |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                    |
| 基金合同生效日         | 2012 年 5 月 23 日    |                    |
| 基金管理人           | 华安基金管理有限公司         |                    |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司       |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 4,541,338,663.32 份 |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 华安季季鑫短期理财债券<br>A   | 华安季季鑫短期理财债券<br>B   |
| 下属分级基金的交易代码     | 040030             | 040031             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 15,943,340.99 份    | 4,525,395,322.33 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。集中申购期内，本基金将采用流动性管理与组合调整相结合的策略。 |
| 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           | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 钱鲲                   | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-38969999         | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | qiankun@huaan.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 4008850099           | 95588               |
| 传真          |      | 021-68863414         | 010-66105798        |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区        | 北京市西城区复兴门内大街55      |

|       |   |                     |
|-------|---|---------------------|
|       | 世纪大道8号国金中心二期31<br>-32层                  | 号                   |
| 办公地址  | 中国（上海）自由贸易试验区<br>世纪大道8号国金中心二期31<br>-32层 | 北京市西城区复兴门内大街55<br>号 |
| 邮政编码  | 200120                                  | 100140              |
| 法定代表人 | 朱学华                                     | 易会满                 |

## 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              |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.huaan.com.cn              |
| 基金半年度报告备置地点          | 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                          |
| 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 主要财务指标和基金净值表现

### 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<br>数据和指标 | 报告期（2018 年 1 月 1 日-2018 年 6 月 30 日） |                  |
|-------------------|-------------------------------------|------------------|
|                   | 华安季季鑫短期理财债券 A                       | 华安季季鑫短期理财债券 B    |
| 本期已实现收益           | 472,471.63                          | 121,961,115.77   |
| 本期利润              | 472,471.63                          | 121,961,115.77   |
| 本期净值收益率           | 2.1472%                             | 2.2833%          |
| 3.1.2 期末<br>数据和指标 | 报告期末(2018 年 6 月 30 日)               |                  |
|                   | 华安季季鑫短期理财债券 A                       | 华安季季鑫短期理财债券 B    |
| 期末基金资产净值          | 15,943,340.99                       | 4,525,395,322.33 |
| 期末基金份额净值          | 1.000                               | 1.000            |
| 3.1.3 累计<br>期末指标  | 报告期末(2018 年 6 月 30 日)               |                  |
|                   | 华安季季鑫短期理财债券 A                       | 华安季季鑫短期理财债券 B    |
| 累计净值收益率           | 21.9930%                            | 22.2926%         |

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. 华安季季鑫短期理财债券 A:

| 阶段             | 份额净值收<br>益率① | 净值收益率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
| 过去一个月          | 0.2912%      | 0.0013%       | -              | -                     | -   | -   |
| 过去三个月          | 0.9120%      | 0.0009%       | -              | -                     | -   | -   |
| 过去六个月          | 2.1472%      | 0.0023%       | -              | -                     | -   | -   |
| 过去一年           | 4.2591%      | 0.0027%       | -              | -                     | -   | -   |
| 过去三年           | 7.7736%      | 0.0042%       | -              | -                     | -   | -   |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 21.9930%     | 0.0077%       | -              | -                     | -   | -   |

##### 2. 华安季季鑫短期理财债券 B:

| 阶段             | 份额净值收<br>益率① | 净值收益率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
| 过去一个月          | 0.3135%      | 0.0013%       | -              | -                     | -   | -   |
| 过去三个月          | 0.9795%      | 0.0009%       | -              | -                     | -   | -   |
| 过去六个月          | 2.2833%      | 0.0023%       | -              | -                     | -   | -   |
| 过去一年           | 4.4646%      | 0.0020%       | -              | -                     | -   | -   |
| 过去三年           | 7.1460%      | 0.0049%       | -              | -                     | -   | -   |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 22.2926%     | 0.0081%       | -              | -                     | -   | -   |

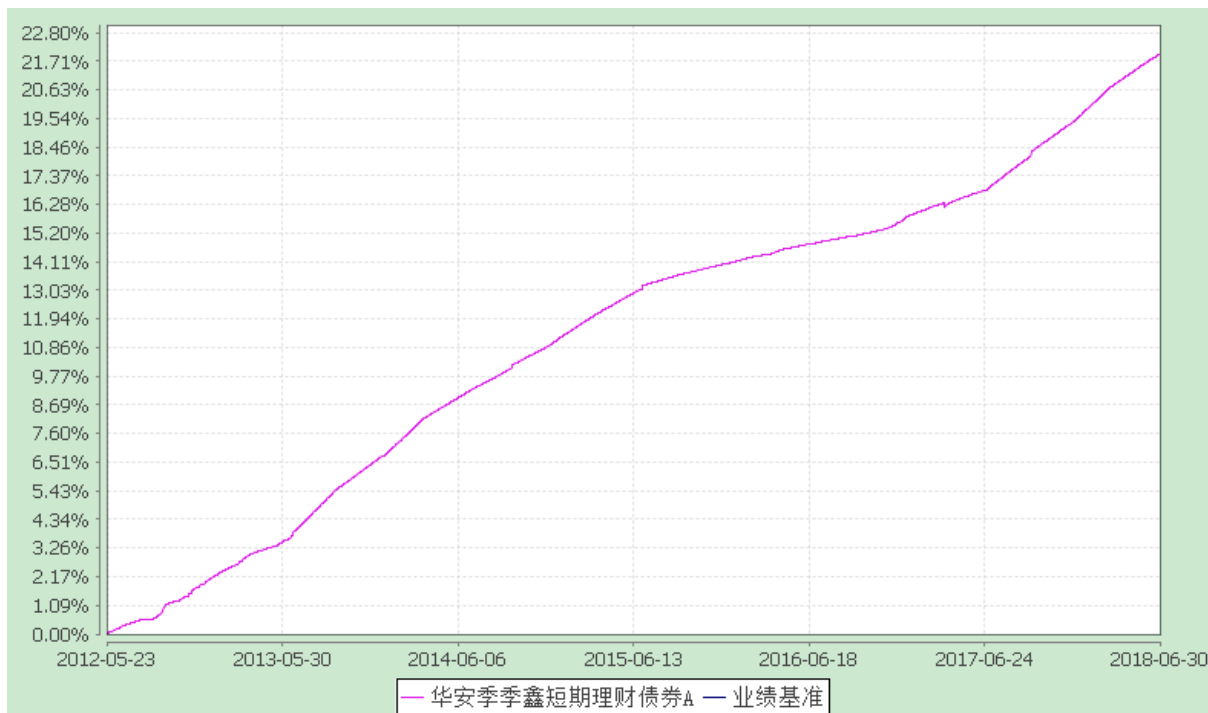
#### 3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金

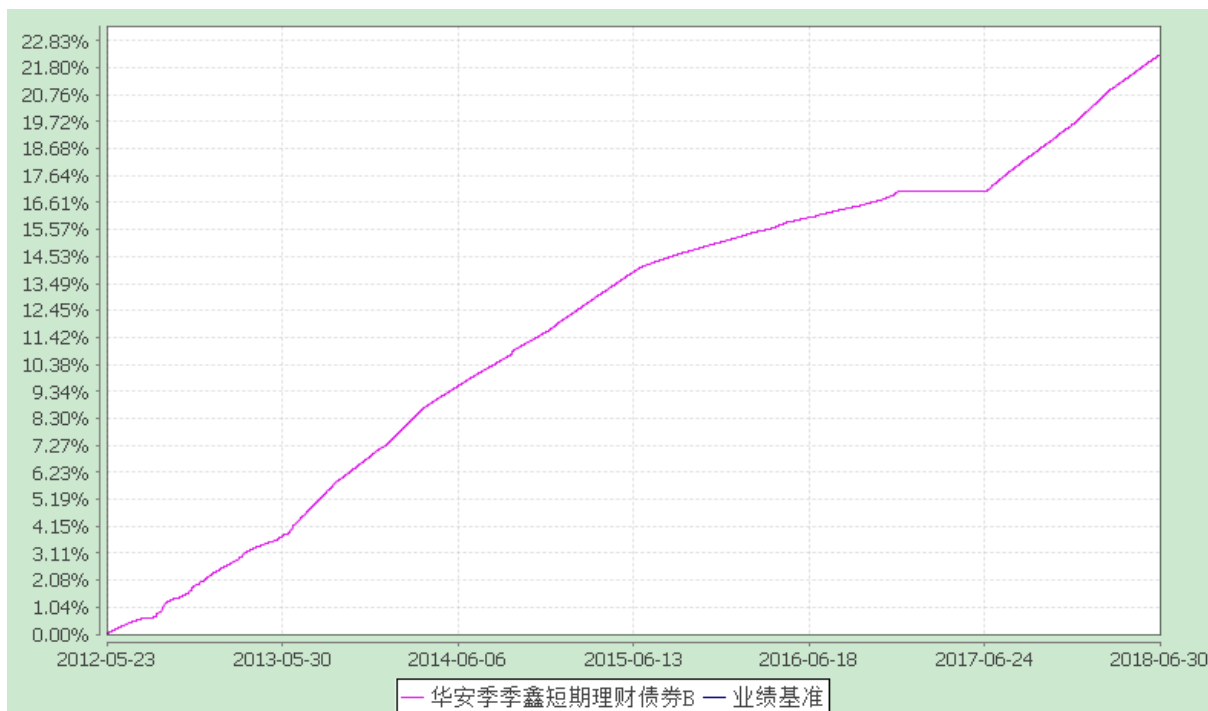
自基金合同生效以来累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012 年 5 月 23 日至 2018 年 6 月 30 日)

华安季季鑫短期理财债券 A



华安季季鑫短期理财债券 B



注：根据《华安季季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 10 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。



## 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 2018 年 6 月 30 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 103 只开放式基金，管理资产规模达到 2,460.80 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 |      | 证券从业<br>年限 | 说明   |
|-----|--------------|----------------------|------|------------|--|
|     |              | 任职日期                 | 离任日期 |            |  |
| 李邦长 | 本基金的<br>基金经理 | 2016-03-02           | -    | 8 年        | 硕士研究生，具有基金从业资格<br>证书。曾任安永华明会计师事务所<br>审计师，2010 年 3 月加入华安基<br>金管理有限公司，先后从事基金<br>运营、债券交易和债券研究等工<br>作，2014 年 9 月起担任基金经理<br>助理，2016 年 3 月起担任华安月<br>月鑫短期理财债券型证券投资基<br>金、本基金、华安月安鑫短期理<br>财债券型证券投资基金、华安日<br>日鑫货币市场基金的基金经<br>理。2016 年 11 月起，同时担任华<br>安鼎丰债券型发起式证券投资基<br>金的基金经理。2017 年 12 月起，<br>同时担任华安鼎瑞定期开放债券<br>型发起式证券投资基金的基金经<br>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 公平交易制度的执行情况

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。

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。

#### 4.3.2 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 3 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

上半年，全球经济反弹出现分化，主要国家货币政策松紧不一。美国经济维持复苏态势，居民消费稳健增长，劳动力市场持续改善，失业率再创新低，通胀压力有所抬升，美联储议息会议两次上调联邦基金利率。欧元区经济基本面转弱，PMI 数据下滑，投资者信心指数从高点回落，通胀也有所走弱。国内经济方面，工业企业利润增速延续增长态势，工业增加值增速有所放缓，工业生产总体平稳；投资受融资环境收紧等因素影响回落较大，消费增长也受到冲击，叠加贸易争端影响，短期经济出现疲弱态势；由于经济面临的不确定性加大，央行货币政策在维持稳健中性的基调上适时微调以进行对冲，上半年通过 CRA 和三次定向降准维稳流动性和支持实体经济发展，除季末等个别时点有所波动外，资金面总体较为宽松。降准利好、机构融资需求放缓以及中美贸易摩擦反复变化推升避险情绪，上半年债券市场迎来做多行情，十年期国债收益率下行幅度超 40bp，3Y-5Y 期 AAA 级中短期票据收益率下行幅度超 70bp，信用利差收窄。

本报告期内，合理安排组合久期，主要投资于利率较高的同业存款和同业存单，同时把握机会，配置银行间逆回购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

华安季季鑫短期理财债券 A:

投资回报: 2.1472%

华安季季鑫短期理财债券 B:

投资回报: 2.2833%

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年, 贸易争端可能对进出口带来一定扰动, 但宏观经济基本面将总体维持平稳, 去杠杆将向稳杠杆过渡, 机构融资需求放缓以及降准带来的流动性宽松具有可持续性, 表内外资金将更加趋于平衡, 预计下半年资金面总体平稳。债券市场面临的大环境总体较为有利, 但受供给释放、财政发力等因素影响, 收益率可能波动加大。

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。

#### 4.7 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，每季集中支付收益。本报告期华安季季鑫短期理财 A 累计收益分配金额 472,471.63 元，华安季季鑫短期理财 B 累计收益分配金额 121,961,115.77 元。

#### 4.8 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

本报告期内，本基金托管人在对华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金的投资运作、每万份基金净收益和基金利润分配、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 | 上年度末 |
|----|-----|-----|------|
|----|-----|-----|------|

|                 |            | 2018 年 6 月 30 日                | 2017 年 12 月 31 日                 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            | -                              | -                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 15,944,940.47                  | 262,807,430.37                   |
| 结算备付金           |            | -                              | -                                |
| 存出保证金           |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 4,141,874,493.49               | 3,244,117,378.94                 |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 4,141,874,493.49               | 3,244,117,378.94                 |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 1,132,185,138.28               | 1,497,707,086.56                 |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 1,205,774.50                   | 2,361,521.01                     |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 5,291,210,346.74               | 5,006,993,416.88                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            | -                              | -                                |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 737,098,414.35                 | 1,150,197,514.70                 |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 4,969,252.18                   | 4,832,988.24                     |
| 应付托管费           |            | 1,472,371.31                   | 1,431,996.57                     |
| 应付销售服务费         |            | 195,285.00                     | 246,569.70                       |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 56,035.78                      | 121,199.25                       |
| 应交税费            |            | -                              | -                                |
| 应付利息            |            | 530,511.73                     | 1,680,968.59                     |
| 应付利润            |            | 5,476,494.27                   | 5,186,470.61                     |
| 递延所得税负债         |            | -                              | -                                |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 73,318.80                      | 114,000.00                       |
| 负债合计            |            | 749,871,683.42                 | 1,163,811,707.66                 |
| <b>所有者权益：</b>   |            | -                              | -                                |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 4,541,338,663.32               | 3,843,181,709.22                 |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | -                              | -                                |
| 所有者权益合计         |            | 4,541,338,663.32               | 3,843,181,709.22                 |
| 负债和所有者权益总计      |            | 5,291,210,346.74               | 5,006,993,416.88                 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 4,541,338,663.32 份，其中 A 类基金份额总额 15,943,340.99 份；B 类基金份额总额 4,525,395,322.33 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号      | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>                |          | <b>143,962,297.28</b>                    | <b>1,172,142.22</b>                           |
| 1.利息收入                     |          | 142,842,344.09                           | 1,172,142.22                                  |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.11 | 5,735,504.78                             | 310,773.97                                    |
| 债券利息收入                     |          | 112,879,803.10                           | 490,541.00                                    |
| 资产支持证券利息收入                 |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入                 |          | 24,227,036.21                            | 370,827.25                                    |
| 其他利息收入                     |          | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | 1,119,953.19                             | -   |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12 | -  | -   |
| 基金投资收益                     |          | -  | -   |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13 | 1,119,953.19                             | -   |
| 资产支持证券投资收益                 |          | -  | -   |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14 | -  | -   |
| 股利收益                       | 6.4.7.15 | -  | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.16 | -  | -   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.17 | -  | -   |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>21,528,709.88</b>                     | <b>403,100.75</b>                             |
| 1. 管理人报酬                   |          | 7,558,144.40                             | 25,196.49                                     |
| 2. 托管费                     |          | 2,239,450.23                             | 7,466.26                                      |
| 3. 销售服务费                   |          | 308,478.45                               | 26,130.40                                     |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18 | -  | -   |
| 5. 利息支出                    |          | 11,331,006.33                            | 243,155.26                                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 11,331,006.33                            | 243,155.26                                    |
| 6.税金及附加                    |          | -  | -   |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 91,630.47                                | 101,152.34                                    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>122,433,587.40</b>                    | <b>769,041.47</b>                             |
| 减：所得税费用                    |          | -  | -   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>122,433,587.40</b>                    | <b>769,041.47</b>                             |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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）                        | 3,843,181,709.22                           | -               | 3,843,181,709.22  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 122,433,587.40  | 122,433,587.40    |
| 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）      | 698,156,954.10                             | -               | 698,156,954.10    |
| 其中：1.基金申购款                             | 5,410,424,204.20                           | -               | 5,410,424,204.20  |
| 2.基金赎回款                                | -4,712,267,250.10                          | -               | -4,712,267,250.10 |
| 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） | -  | -122,433,587.40 | -122,433,587.40   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 4,541,338,663.32                           | 0.00            | 4,541,338,663.32  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）                        | 19,355,782.34                              | -               | 19,355,782.34     |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 769,041.47      | 769,041.47        |
| 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）      | 4,699,523,153.77                           | -               | 4,699,523,153.77  |
| 其中：1.基金申购款                             | 4,702,358,563.57                           | -               | 4,702,358,563.57  |
| 2.基金赎回款                                | -2,835,409.80                              | -               | -2,835,409.80     |
| 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） | -  | -769,041.47     | -769,041.47       |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 4,718,878,936.11                           | -               | 4,718,878,936.11  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安季季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】539号《关于核准华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金募集的批复》的核准, 由华安基金管理有限公司作为管理人于2012年5月14日到2012年5月21日向社会公开募集, 募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2012)验字第60971571\_B02号验资报告后, 向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2012年5月23日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币5,525,797,098.38元, 在募集期间产生的活期存款利息为人民币754,196.73元, 以上实收基金(本息)合计为人民币5,526,551,295.11元, 折合5,526,551,295.11份基金份额。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日常申购与赎回, 仅在运作期最后1日开放当期赎回。每个运作期结束后, 本基金将安排一个集中申购期, 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, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

### 6.4.2 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 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本会计期间不存在会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本会计期间不存在会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本会计期间不存在差错更正。

#### **6.4.6 税项**

##### **6.4.6.1 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, 质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

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, 买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

#### 6.4.6.2 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。

#### 6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定, 对基金取得的股票的股息、红利收入, 债券的利息收入、储蓄存款利息收入, 由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税;

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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 活期存款        | 15,944,940.47          |
| 定期存款        | -                      |
| 存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 3 个月以上 | -                      |
| 其他存款        | -                      |
| 合计          | 15,944,940.47          |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2018 年 6 月 30 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 | 4,141,874.49<br>3.49   | 4,147,804,000.<br>00 | 5,929,506.51 | 0.1306  |
|        | 合计    | 4,141,874.49<br>3.49   | 4,147,804,000.<br>00 | 5,929,506.51 | 0.1306  |
| 资产支持证券 |       | -                      | -                    | -            | -       |
| 合计     |       | 4,141,874.49<br>3.49   | 4,147,804,000.<br>00 | 5,929,506.51 | 0.1306  |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 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>2018 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                      | -         |
| 银行间市场 | 1,132,185,138.28       | -         |
| 合计    | 1,132,185,138.28       | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------|
| 应收活期存款利息  | 7,485.16               |
| 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 | -                      |
| 应收债券利息    | -                      |

|            |              |
|------------|--------------|
| 应收资产支持证券利息 | -            |
| 应收买入返售证券利息 | 1,198,289.34 |
| 应收申购款利息    | -            |
| 其他         | -            |
| 合计         | 1,205,774.50 |

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                 |
| 银行间市场应付交易费用 | 56,035.78         |
| 合计          | 56,035.78         |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 预提账户维护费     | 8,853.84          |
| 预提审计费       | 14,876.39         |
| 预提信息披露费     | 49,588.57         |
| 合计          | 73,318.80         |

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 华安季季鑫短期理财债券 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 27,181,709.22              | 27,181,709.22  |
| 本期申购          | 1,028,881.87               | 1,028,881.87   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -12,267,250.10             | -12,267,250.10 |
| 本期末           | 15,943,340.99              | 15,943,340.99  |

##### 华安季季鑫短期理财债券 B

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                   |
|---------------|----------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额              |
| 上年度末          | 3,816,000,000.00           | 3,816,000,000.00  |
| 本期申购          | 5,409,395,322.33           | 5,409,395,322.33  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -4,700,000,000.00          | -4,700,000,000.00 |
| 本期末           | 4,525,395,322.33           | 4,525,395,322.33  |

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。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 华安季季鑫短期理财债券 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           | 472,471.63  | -     | 472,471.63  |
| 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        | -472,471.63 | -     | -472,471.63 |
| 本期末            | -           | -     | -           |

##### 华安季季鑫短期理财债券 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           | 121,961,115.77  | -     | 121,961,115.77  |
| 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        | -121,961,115.77 | -     | -121,961,115.77 |
| 本期末            | -               | -     | -               |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
|           | 活期存款利息收入                   |
| 定期存款利息收入  | 5,627,500.00               |
| 其他存款利息收入  | -                          |
| 结算备付金利息收入 | -                          |

|    |              |
|----|--------------|
| 其他 | -            |
| 合计 | 5,735,504.78 |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

无。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 2,750,110,929.77     |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,748,990,976.58     |
| 减：应收利息总额               | -                    |
| 买卖债券差价收入               | 1,119,953.19         |

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

无。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

无。

#### 6.4.7.17 其他收入

无。

#### 6.4.7.18 交易费用

无。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期                   |
|-------|----------------------|
|       | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
| 审计费用  | 14,876.39            |
| 信息披露费 | 49,588.57            |

|        |           |
|--------|-----------|
| 银行汇划费用 | 8,608.77  |
| 账户维护费  | 17,853.84 |
| 其他费用   | 702.90    |
| 合计     | 91,630.47 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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 |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 基金托管人、基金代销机构          |

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 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。

###### 6.4.10.1.4 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。

##### 6.4.10.2 关联方报酬



### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                   | 上年度可比期间              |
|-----------------|----------------------|----------------------|
|                 | 2018年1月1日至2018年6月30日 | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 7,558,144.40         | 25,196.49            |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 13,135.90            | 11,834.95            |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.27% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% / \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于每个运作期结束后次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2018年1月1日至2018年6月30日 | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,239,450.23         | 7,466.26             |

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于每个运作期结束后次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.3 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                   |
|----------------|----------------------|
|                | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费     |

|                | 华安季季鑫短期理财债券 A                   | 华安季季鑫短期理财债券 B | 合计         |
|----------------|---------------------------------|---------------|------------|
| 工商银行           | 22,497.63                       | -             | 22,497.63  |
| 华安基金管理有限公司     | 1,409.08                        | 278,873.76    | 280,282.84 |
| 合计             | 23,906.71                       | 278,873.76    | 302,780.47 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |               |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |               |            |
|                | 华安季季鑫短期理财债券 A                   | 华安季季鑫短期理财债券 B | 合计         |
| 华安基金管理有限公司     | 416.56                          | -             | 416.56     |
| 工商银行           | 18,995.62                       | -             | 18,995.62  |
| 合计             | 19,412.18                       | -             | 19,412.18  |

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.28%，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，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于每个运作期结束后次月前 2 个工作日内从基金财产中划出，经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.10.4.2 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

#### 华安季季鑫短期理财债券 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本基金。

#### 华安季季鑫短期理财债券 B

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。

#### 6.4.10.5 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>2018年1月1日至2018年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |          |
|-------|----------------------------|------------|---------------------------------|----------|
|       | 期末余额                       | 当期利息收入     | 期末余额                            | 当期利息收入   |
| 工商银行  | 15,944,940.47              | 108,004.78 | 17,673,736.09                   | 6,068.00 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业或协议利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 1、华安季季鑫短期理财债券 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 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 146,487.74       | 342,424.45        | -16,440.56   | 472,471.63   | -  |

##### 2、华安季季鑫短期理财债券 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<br>配合计       | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------------|----|
| 9,395,322.33     | 112,259,329.22    | 306,464.22   | 121,961,115.<br>77 | -  |

#### 6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金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 737,098,414.35 元，是以如下债券作为抵押

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称             | 回购到期日      | 期末估值<br>单价 | 数量（张）        | 期末估值总额         |
|-----------|------------------|------------|------------|--------------|----------------|
| 111810296 | 18 兴业银行<br>CD296 | 2018-07-02 | 99.04      | 3,400,000.00 | 336,725,958.64 |
| 111899095 | 18 南京银行<br>CD083 | 2018-07-03 | 99.12      | 1,340,000.00 | 132,820,195.81 |
| 111815270 | 18 民生银行<br>CD270 | 2018-07-04 | 99.12      | 3,450,000.00 | 341,962,444.45 |
| 合计        |                  |            |            | 8,190,000.00 | 811,508,598.90 |

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 6.4.13 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。

### 6.4.13.1 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督察长负责。

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，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 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。

##### 6.4.13.2.1 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>2018年6月30日 | 上年末<br>2017年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1    | -                 | -                  |
| A-1 以下 | -                 | -                  |
| 未评级    | 4,147,804,000.00  | 3,242,788,000.00   |
| 合计     | 4,147,804,000.00  | 3,242,788,000.00   |

注：未评级债券为同业存单。

#### 6.4.13.3 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。

由于本基金运作期内封闭，在每个运作期结束前公布下一运作期的具体时间安排，滚动运作，针对定期开放时兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人会在运作期内保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

在运作期内，本基金投资各类金融工具的到期日不得晚于该运作期的最后一日；本基金债券

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 40%；本基金存放在具有基金托管资格的同一家商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一家商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

#### 6.4.13.3.1 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间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。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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2018年6月<br>30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                  | 15,944,940.47    | -      | -    | -            | 15,944,940.47    |
| 交易性金融资产               | 4,141,874,493.49 | -      | -    | -            | 4,141,874,493.49 |
| 买入返售金融资产              | 1,132,185,138.28 | -      | -    | -            | 1,132,185,138.28 |
| 应收利息                  | -                | -      | -    | 1,205,774.50 | 1,205,774.50     |
| 资产总计                  | 5,290,004,572.24 | -      | -    | 1,205,774.50 | 5,291,210,346.74 |
| 负债                    |                  |        |      |              |                  |
| 卖出回购金                 | 737,098,414.35   | -      | -    | -            | 737,098,414.35   |

|                                      |                  |                 |              |                |                  |
|--------------------------------------|------------------|-----------------|--------------|----------------|------------------|
| 融资产款                                 |                  |                 |              |                | 4.35             |
| 应付管理人<br>报酬                          | -                | -               | -            | 4,969,252.18   | 4,969,252.18     |
| 应付托管费                                | -                | -               | -            | 1,472,371.31   | 1,472,371.31     |
| 应付销售服<br>务费                          | -                | -               | -            | 195,285.00     | 195,285.00       |
| 应付交易费<br>用                           | -                | -               | -            | 56,035.78      | 56,035.78        |
| 应付利息                                 | -                | -               | -            | 530,511.73     | 530,511.73       |
| 应付利润                                 | -                | -               | -            | 5,476,494.27   | 5,476,494.27     |
| 其他负债                                 | -                | -               | -            | 73,318.80      | 73,318.80        |
| 负债总计                                 | 737,098,414.35   | -               | -            | 12,773,269.07  | 749,871,683.42   |
| 利率敏感度<br>缺口                          | 4,552,906,157.89 | -               | -            | -11,567,494.57 | 4,541,338,663.32 |
| <b>上年度末<br/>2017 年 12 月<br/>31 日</b> | <b>6 个月以内</b>    | <b>6 个月-1 年</b> | <b>1-5 年</b> | <b>不计息</b>     | <b>合计</b>        |
| 资产                                   |                  |                 |              |                |                  |
| 银行存款                                 | 262,807,430.37   | -               | -            | -              | 262,807,430.37   |
| 交易性金融<br>资产                          | 3,244,117,378.94 | -               | -            | -              | 3,244,117,378.94 |
| 买入返售金<br>融资产                         | 1,497,707,086.56 | -               | -            | -              | 1,497,707,086.56 |
| 应收利息                                 | -                | -               | -            | 2,361,521.01   | 2,361,521.01     |
| 资产总计                                 | 5,004,631,895.87 | -               | -            | 2,361,521.01   | 5,006,993,416.88 |
| 负债                                   |                  |                 |              |                |                  |
| 卖出回购金<br>融资产款                        | 1,150,197,514.70 | -               | -            | -              | 1,150,197,514.70 |
| 应付管理人<br>报酬                          | -                | -               | -            | 4,832,988.24   | 4,832,988.24     |
| 应付托管费                                | -                | -               | -            | 1,431,996.57   | 1,431,996.57     |
| 应付销售服<br>务费                          | -                | -               | -            | 246,569.70     | 246,569.70       |
| 应付交易费<br>用                           | -                | -               | -            | 121,199.25     | 121,199.25       |
| 应付利息                                 | -                | -               | -            | 1,680,968.59   | 1,680,968.59     |



|         |                  |   |   |                |                  |
|---------|------------------|---|---|----------------|------------------|
| 应付利润    | -                | - | - | 5,186,470.61   | 5,186,470.61     |
| 其他负债    | -                | - | - | 114,000.00     | 114,000.00       |
| 负债总计    | 1,150,197,514.70 | - | - | 13,614,192.96  | 1,163,811,707.66 |
| 利率敏感度缺口 | 3,854,434,381.17 | - | - | -11,252,671.95 | 3,843,181,709.22 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 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>2018 年 6 月 30 日           | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | 减少约 218                          | 减少约 173                  |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 增加约 219                          | 增加约 173                  |

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 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。

#### 6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 8 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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            | 4,141,874,493.49 | 78.28         |
|    | 其中：债券             | 4,141,874,493.49 | 78.28         |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 1,132,185,138.28 | 21.40         |
|    | 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      | 15,944,940.47    | 0.30          |
| 4  | 其他各项资产            | 1,205,774.50     | 0.02          |
| 5  | 合计                | 5,291,210,346.74 | 100.00        |

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例 (%) |                |
|----|--------------|----------------|----------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 |                | 13.89          |
|    | 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 | 737,098,414.35 | 16.23          |
|    | 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 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%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

不适用。

#### 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。

#### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

不适用。

### 7.4 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                 | -                | -            |
|    | 其中：政策性金融债            | -                | -            |
| 4  | 企业债券                 | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券              | -                | -            |
| 6  | 中期票据                 | -                | -            |
| 7  | 同业存单                 | 4,141,874,493.49 | 91.20        |
| 8  | 其他                   | -                | -            |
| 9  | 合计                   | 4,141,874,493.49 | 91.20        |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                | -            |

### 7.5 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  | 111815270 | 18 民生银行 CD270 | 6,000,000 | 594,717,294.70 | 13.10        |
| 2  | 111810296 | 18 兴业银行 CD296 | 6,000,000 | 594,222,279.96 | 13.08        |
| 3  | 111816185 | 18 上海银行 CD185 | 3,000,000 | 297,358,647.33 | 6.55         |

|    |           |               |           |                |      |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|------|
| 4  | 111899095 | 18 南京银行 CD083 | 3,000,000 | 297,358,647.33 | 6.55 |
| 5  | 111899065 | 18 宁波银行 CD112 | 3,000,000 | 297,358,647.33 | 6.55 |
| 6  | 111818165 | 18 华夏银行 CD165 | 3,000,000 | 297,358,647.33 | 6.55 |
| 7  | 111808166 | 18 中信银行 CD166 | 3,000,000 | 297,304,384.56 | 6.55 |
| 8  | 111808169 | 18 中信银行 CD169 | 3,000,000 | 297,124,630.40 | 6.54 |
| 9  | 111815285 | 18 民生银行 CD285 | 3,000,000 | 297,111,426.06 | 6.54 |
| 10 | 111816189 | 18 上海银行 CD189 | 2,000,000 | 198,190,885.44 | 4.36 |

#### 7.6“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况     |
|-------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.1702%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0143% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0668%  |

#### 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。

#### 7.7 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。

#### 7.8 投资组合报告附注

##### 7.8.1 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。

7.8.2 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。

##### 7.8.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额 |
|----|-------|----|
| 1  | 存出保证金 | -  |

|   |         |              |
|---|---------|--------------|
| 2 | 应收证券清算款 | -            |
| 3 | 应收利息    | 1,205,774.50 |
| 4 | 应收申购款   | -            |
| 5 | 其他应收款   | -            |
| 6 | 待摊费用    | -            |
| 7 | 其他      | -            |
| 8 | 合计      | 1,205,774.50 |

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 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 |
| 华安季季鑫短期理财债券 A | 492      | 32,405.16      | 994.39           | 0.01%   | 15,942,346.60 | 99.99% |
| 华安季季鑫短期理财债券 B | 7        | 646,485,046.05 | 4,525,395,322.33 | 100.00% | 0.00          | 0.00%  |
| 合计            | 499      | 9,100,879.08   | 4,525,396,316.72 | 99.65%  | 15,942,346.60 | 0.35%  |

#### 8.2 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 | 华安季季鑫短期理财债券 A | 100,221.18 | 0.63%    |
|                  | 华安季季鑫短期理财债券 B | -          | -        |
|                  | 合计            | 100,221.18 | 0.00%    |

#### 8.3 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、基金投资和研发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。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 华安季季鑫短期理财债券 A    | 华安季季鑫短期理财债券 B    |
|--------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2012 年 5 月 23 日）基金份额总额 | 4,689,974,322.86 | 836,576,972.25   |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 27,181,709.22    | 3,816,000,000.00 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 1,028,881.87     | 5,409,395,322.33 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 12,267,250.10    | 4,700,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 15,943,340.99    | 4,525,395,322.33 |

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。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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：

无。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 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。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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 | 股票交易 |      | 应支付该券商的佣金 |      | 备注 |
|------|------|------|------|-----------|------|----|
|      |      | 成交金额 | 占当期股 | 佣金        | 占当期佣 |    |

|        | 数量 |   | 票成交总<br>额的比例 |   | 金总量的<br>比例 |   |
|--------|----|---|--------------|---|------------|---|
| 国金证券   | 2  | - | -            | - | -          | - |
| 安信证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 中投证券   | 2  | - | -            | - | -          | - |
| 宏信证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 中泰证券   | 2  | - | -            | - | -          | - |
| 宏源证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 国信证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 华融证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 中金公司   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 瑞银证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 华泰证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 国泰君安   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 上海证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 东北证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 高华证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 西藏东方财富 | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 银河证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 东兴证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 兴业证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 广发证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 世纪证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 华创证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 中银国际   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 天风证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 中天证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 中信证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 国都证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 广发华福   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 长城证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 财富里昂   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 民族证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 招商证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 信达证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 民生证券   | 1  | - | -            | - | -          | - |
| 恒泰证券   | 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，最大限度地调调整体资源，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：

2018 年 4 月完成租用托管在工行的上交所红塔证券 22250 交易单元

**10.7.2 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 |
| 国金证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 安信证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中投证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 宏信证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中泰证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 宏源证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国信证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 华融证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |



|        |   |   |   |   |   |   |
|--------|---|---|---|---|---|---|
| 中金公司   | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券   | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券   | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安   | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券   | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券   | - | - | - | - | - | - |
| 高华证券   | - | - | - | - | - | - |
| 西藏东方财富 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券   | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券   | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券   | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券   | - | - | - | - | - | - |
| 世纪证券   | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券   | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际   | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券   | - | - | - | - | - | - |
| 中天证券   | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券   | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券   | - | - | - | - | - | - |
| 广发华福   | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券   | - | - | - | - | - | - |
| 财富里昂   | - | - | - | - | - | - |
| 民族证券   | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券   | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券   | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券   | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券   | - | - | - | - | - | - |

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

### 10.9 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  | 华安基金管理有限公司关于旗下产品实施增值税政策的公告                     | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-01-03 |
| 2  | 关于华安季季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(2018 年第 1 期) | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-01-12 |
| 3  | 关于旗下部分基金增加国金证券为销售机构                            | 《上海证券报》、《证券时                | 2018-01-20 |

|    |  |                             |            |
|----|--|-----------------------------|------------|
|    | 并参加费率优惠活动的公告   | 报》、《中国证券报》和公司网站             |            |
| 4  | 华安基金关于参加北京展恒优惠活动的公告  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-01-27 |
| 5  | 关于旗下部分基金参加华信证券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 | 2018-02-08 |
| 6  | 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 | 2018-02-13 |
| 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 | 2018-03-14 |
| 8  | 华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金 2018 年第 1 期赎回开放日及 2018 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 | 2018-03-17 |
| 9  | 新增基煜基金开通华安季季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 | 2018-03-20 |
| 10 | 关于电子直销平台开展“微钱宝”账户交易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 | 2018-03-21 |
| 11 | 华安基金管理有限公司关于华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金 2018 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 | 2018-03-22 |
| 12 | 关于旗下公开募集证券投资基金根据流动性风险管理规定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 | 2018-03-24 |
| 13 | 华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同修改前后对照表                                  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-03-24 |
| 14 | 关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司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 | 2018-03-29 |
| 15 | 华安基金关于参加中国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 | 2018-04-11 |
| 16 | 华安基金关于参加华安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 | 2018-04-12 |
| 17 | 华安基金管理有限公司关于暂停上海华信证券有限责任公司销售旗下基金业务公告                           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-04-13 |

|    |  |                             |            |
|----|--|-----------------------------|------------|
| 18 | 关于旗下部分基金增加鑫鼎盛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 | 2018-04-14 |
| 19 | 关于华安季季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(2018 年第 2 期)                 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-04-19 |
| 20 | 关于旗下部分基金增加唐鼎耀华为销售机构的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-04-20 |
| 21 | 关于华安旗下部分基金增加奕丰金融为销售机构的公告                                       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-04-28 |
| 22 | 关于旗下部分基金增加钜派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 | 2018-05-18 |
| 23 | 关于基金电子交易平台汇付天天盈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 | 2018-06-11 |
| 24 | 华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金 2018 年第 2 期赎回开放日及 2018 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 | 2018-06-11 |
| 25 | 关于华安暂停与苏州财路开展基金销售合作业务的公告                                       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-06-13 |
| 26 | 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 | 2018-06-15 |
| 27 | 华安基金管理有限公司关于华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金 2018 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 | 2018-06-21 |
| 28 | 关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易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 | 2018-06-27 |
| 29 | 关于基金电子交易平台调整微钱宝快速取现服务限额的公告                                     | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-06-27 |

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。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|-----|----------------|------------|
|-----|----------------|------------|

| 类别  | 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  | 20180327-20180619      | 0.00         | 2,000,000,000.00 | 2,000,000,000.00 | 0.00             | 0.00%  |
|   | 2  | 20180320-20180320      | 500,000.00   | 0.00             | 0.00             | 500,000,000.00   | 11.01% |
|   | 3  | 20180101-20180320      | 900,000.00   | 0.00             | 900,000,000.00   | 0.00             | 0.00%  |
|   | 4  | 20180327-20180630      | 0.00         | 2,000,000,000.00 | 0.00             | 2,000,000,000.00 | 44.04% |
|   | 5  | 20180101-20180630      | 1,000,000.00 | 0.00             | 0.00             | 1,000,000,000.00 | 22.02% |
| 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。 |    |                        |              |                  |                  |                  |        |

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安季季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季季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；

### 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

二〇一八年八月二十四日