

**华安现金富利投资基金**  
**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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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	12
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	13
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	14
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	14
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	14
6.1 资产负债表	14
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>	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 债券回购融资情况	36
<b>7.3 基金投资组合平均剩余期限</b>	36
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
7.6 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	37
7.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	38
7.8 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	38
7.9 投资组合报告附注	38
<b>8 基金份额持有人信息</b>	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	40

<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	40
<b>10 重大事件揭示</b> .....	41
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	41
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 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4 基金投资策略的改变 .....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	41
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 .....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	41
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 .....	42
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	42
10.9 其他重大事件 .....	42
<b>11 备查文件目录</b> .....	46
11.1 备查文件目录 .....	46
11.2 存放地点 .....	46
11.3 查阅方式 .....	46

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安现金富利投资基金	
基金简称	华安现金富利货币	
基金主代码	040003	
交易代码	040003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003 年 12 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	
报告期末基金份额总额	11,835,961,995.64 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B
下属分级基金的交易代码	040003	041003
报告期末下属分级基金的份额总额	709,800,282.11 份	11,126,161,713.53 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是在资本保全的情况下，确保基金资产的高流动性，追求稳健的当期收益，并为投资者提供暂时的流动性储备。
投资策略	<p>基金管理人将充分发挥自身的研究力量，利用公司研究开发的各种数量模型工具，采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，发现和捕捉短期资金市场的机会，实现基金的投资目标。</p> <p>1、资产配置策略： 本基金在实际操作中主要依据各短期金融工具细分市场的规模、流动性和当时的利率环境，建立动态规划模型，通过求解确定不同资产配置比例和同类资产的基于不同利率期限结构的配置比例。</p> <p>2、其它操作策略： 套利操作：根据各细分短期金融工具的流动性和收益特征，动态调整基金资产在各个细分市场之间的配置比例。比如，当交易所市场回购利率高于银行间市场回购利率时，可通过增加交易所市场回购的配置比例，或在银行间市场融资、交易所市场融券而实现跨市场套利。 期差操作：根据各细分市场中不同品种的风险收益特征，动态调整不同利率期限结构品种的配置比例。比如，短期回购利率低于长期回购利率时，在既定的变现率水平下，可通过增长长期回购的配置比例，或短期融资、长期融券而实现跨品种套利。 滚动配置：根据具体投资品种的市场特性，采用持续投资的方法，以提高基金资产的整体变现能力。例如，对 N 天期回购协议可每天进行等量配置，而提高配置在回购协议上的基金资产的流动性。 利率预期：在深入分析财政、货币政策以及短期资金市场、资本市场资金</p>

	面的情况和流动性的基础上，对利率走势形成合理预期，并据此调整基金资产配置策略。
业绩比较基准	以当期银行个人活期储蓄利率（税前）作为衡量本基金操作水平的比较基准。
风险收益特征	本基金面临与其他开放式基金相同的风险(例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等)，但由于本基金是以短期金融工具投资为主的低风险开放式基金，上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为：利率风险，信用风险，流动性风险等。

### 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 负责人	姓名	钱鲲	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105798
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105799
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	北京市西城区复兴门内大街55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	北京市西城区复兴门内大街55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 数据和指标	报告期（2018 年 1 月 1 日-2018 年 6 月 30 日）	
	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B
本期已实现收益	14,630,166.36	378,034,167.80
本期利润	14,630,166.36	378,034,167.80
本期净值收益率	1.8599%	1.9809%
3.1.2 期末 数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B
期末基金资产净值	709,800,282.11	11,126,161,713.53
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计 期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B
累计净值收益率	54.6876%	35.9584%

注：1、本基金收益分配按月结转份额。

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

3、自 2009 年 12 月 23 日起，本基金实行销售服务费分级收费方式，分设两级基金份额：A 级基金份额和 B 级基金份额。详情请参阅相关公告。

#### 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. 华安现金富利货币 A:

阶段	份额净值收 益率①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2713%	0.0011%	0.0288%	0.0000%	0.2425%	0.0011%
过去三个月	0.8669%	0.0010%	0.0873%	0.0000%	0.7796%	0.0010%
过去六个月	1.8599%	0.0014%	0.1736%	0.0000%	1.6863%	0.0014%
过去一年	3.8328%	0.0012%	0.3500%	0.0000%	3.4828%	0.0012%
过去三年	9.6402%	0.0026%	1.0510%	0.0000%	8.5892%	0.0026%
自基金合同生效	54.6876%	0.0056%	7.1455%	0.0005%	47.5421%	0.0051%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

**2. 华安现金富利货币 B:**

阶段	份额净值收 益率①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2911%	0.0011%	0.0288%	0.0000%	0.2623%	0.0011%
过去三个月	0.9271%	0.0010%	0.0873%	0.0000%	0.8398%	0.0010%
过去六个月	1.9809%	0.0014%	0.1736%	0.0000%	1.8073%	0.0014%
过去一年	4.0817%	0.0012%	0.3500%	0.0000%	3.7317%	0.0012%
过去三年	10.4311%	0.0027%	1.0510%	0.0000%	9.3801%	0.0027%
自基金合同生效 起至今	35.9584%	0.0042%	3.1832%	0.0001%	32.7752%	0.0041%

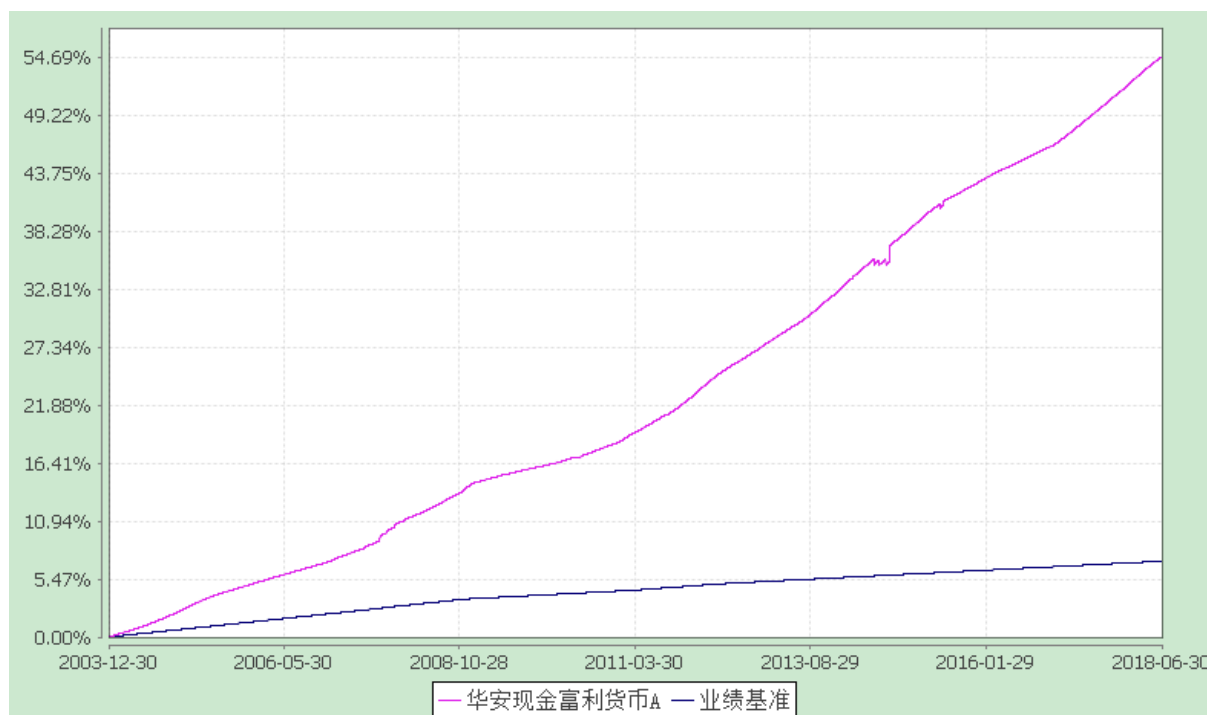
注：自 2009 年 12 月 23 日起，本基金实行销售服务费分级收费方式，分设两级基金份额：A 级基金份额和 B 级基金份额。详情请参阅相关公告。

**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**

华安现金富利投资基金

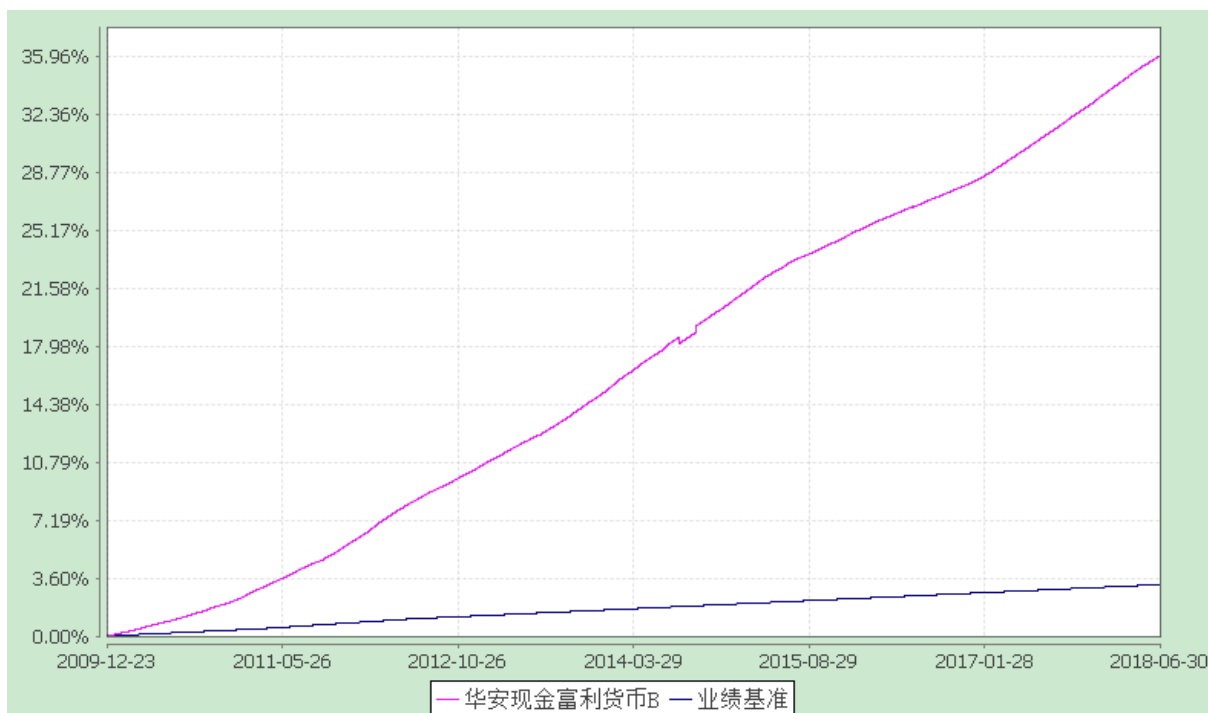
自基金合同生效以来累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2003 年 12 月 30 日至 2018 年 6 月 30 日)

华安现金富利货币 A



华安现金富利货币 B





注：自 2009 年 12 月 23 日起，本基金实行销售服务费分级收费方式，分设两级基金份额：A 级基金份额和 B 级基金份额。详情请参阅相关公告。

## 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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙丽娜	本基金的	2014-10-30	-	7 年	硕士研究生，7 年债券、基金行业

	基金经理			<p>从业经验。曾任上海国际货币经纪公司债券经纪人。2010 年 8 月加入华安基金管理有限公司，先后担任债券交易员、基金经理助理。2014 年 8 月至 2017 年 7 月，担任华安日日鑫货币市场基金及华安汇财通货币市场基金的基金经理，2014 年 8 月至 2015 年 1 月，同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 10 月起同时担任本基金的基金经理。2015 年 2 月起担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安添颐养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016 年 10 月至 2018 年 1 月，同时担任华安安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起，同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起，同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。2018 年 5 月起，同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。</p>
--	------	--	--	--

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。

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，海外主要经济体复苏进程有所分化。美国经济延续强劲，非农就业大超预期；欧洲经济复苏放缓，但通胀水平有明显改善。国内宏观经济大体平稳，通胀温和回落。受去杠杆和资管新规影响，社融萎缩明显，但出口和房地产投资仍支撑经济韧性。货币政策逐步趋向宽松，央行三次降准支持实体经济降低融资成本，并增量投放 MLF 鼓励商业银行向中小企业增加信贷投放。债市在国际金融市场动荡加剧、国内流动性显著改善、中美贸易战发酵等因素影响下，收益率震荡回落。信用债市场，“紧信用”影响渐增，一级市场净融资额大幅下滑，信用利差显著走阔。

本基金将流动性和安全性置于首位，在此基础上灵活调整仓位和追求收益。上半年资产配置以逆回购和同业存单为主，积极把握流动性紧张时点锁定资产，合理分布资产到期，积极进行波段操作，努力为持有人赚取收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

华安现金富利货币 A:

投资回报：1.8599% 比较基准：0.1736%

华安现金富利货币 B

投资回报：1.9809% 比较基准：0.1736%

#### 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，美国或将迎来本轮经济增长峰值，欧元区经济有望企稳，主要经济体货币政策仍走在回归正常化道路上。对中国而言，外有贸易战和全球需求的不确定性，内有融资环境恶化带来的经济潜在风险，宏观经济具有一定的下行压力。但目前中国正处于新旧动能切换从量变到质变的关键期，新动能规模和部分旧动能已经等量齐观。货币政策有望继续中性偏宽松，流动性整体较为宽裕，随着表外融资的压缩，表内信贷将有所放松。利率债和高等级信用债有望进一步走牛，但仍需警惕信用风险，尤其是对于信用资质较差的民企。

我们将继续严控组合流动性和安全性，合理调整仓位和久期。积极把握资金价格阶段性走高的机会，锁定高收益资产。我们将持续跟踪存单和债券的信用风险，严格甄选个券，信用债投资保持高等级。

#### 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，每月集中支付收益。本报告期华安现金富利货币 A 累计收益分配金额 14,630,166.36 元，华安现金富利货币 B 累计收益分配金额 378,034,167.80 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现金富利投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，华安现金富利投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安现金富利投资基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

## 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现金富利投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、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：华安现金富利投资基金

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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	2,896,929,277.10	5,286,670,790.65
结算备付金		42,386,818.18	5,681,818.18
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	7,330,415,612.57	8,939,356,186.54
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,330,415,612.57	8,939,356,186.54
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	2,800,062,725.20	12,329,082,580.33
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	28,749,502.46	97,076,948.90
应收股利		-	-
应收申购款		1,101,679.94	565,961,081.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		13,099,645,615.45	27,223,829,405.99
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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		1,232,137,806.39	209,699,445.45
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,435,585.19	1,706,967.12
应付管理人报酬		4,757,662.15	4,998,774.40
应付托管费		1,441,715.76	1,514,780.13
应付销售服务费		290,117.04	322,515.67
应付交易费用	6.4.7.7	249,758.02	285,869.07
应交税费		3,463.79	-
应付利息		255,530.29	157,561.45
应付利润		22,888,407.04	42,844,550.49
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	223,574.14	422,000.00
负债合计		1,263,683,619.81	261,952,463.78
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	11,835,961,995.64	26,961,876,942.21
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		11,835,961,995.64	26,961,876,942.21
负债和所有者权益总计		13,099,645,615.45	27,223,829,405.99

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 11,835,961,995.64 份，其中 A 级基金基金份额总额 709,800,282.11 份，B 级基金基金份额总额 11,126,161,713.53 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安现金富利投资基金

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	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
<b>一、收入</b>		<b>444,629,874.24</b>	<b>422,823,716.80</b>
1.利息收入		440,148,033.95	424,608,352.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	153,697,468.50	171,368,249.47
债券利息收入		137,520,235.24	97,860,977.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		148,930,330.21	155,379,125.77
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,436,824.88	-1,784,635.63
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	4,436,824.88	-1,784,635.63
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	45,015.41	-
<b>减：二、费用</b>		<b>51,965,540.08</b>	<b>60,101,773.07</b>
1. 管理人报酬		32,876,662.22	31,463,630.73
2. 托管费		9,962,624.91	9,534,433.50
3. 销售服务费		1,938,733.37	2,055,498.91
4. 交易费用	6.4.7.18	211.07	2,586.53
5. 利息支出		6,914,469.55	16,767,865.18
其中：卖出回购金融资产支出		6,914,469.55	16,767,865.18
6.税金及附加		1,430.29	-
7. 其他费用	6.4.7.19	271,408.67	277,758.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>392,664,334.16</b>	<b>362,721,943.73</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>392,664,334.16</b>	<b>362,721,943.73</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安现金富利投资基金

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 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）	26,961,876,942.21	-	26,961,876,942.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	392,664,334.16	392,664,334.16
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）	-15,125,914,946.57	-	-15,125,914,946.57
其中：1.基金申购款	49,667,599,909.38	-	49,667,599,909.38
2.基金赎回款	-64,793,514,855.95	-	-64,793,514,855.95
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）	-	-392,664,334.16	-392,664,334.16



五、期末所有者权益（基金净值）	11,835,961,995.64	-	11,835,961,995.64
项目	上年度可比期间 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）	20,862,843,353.35	-	20,862,843,353.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	362,721,943.73	362,721,943.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-7,022,957,292.75	-	-7,022,957,292.75
其中：1.基金申购款	64,147,451,680.19	-	64,147,451,680.19
2.基金赎回款	-71,170,408,972.94	-	-71,170,408,972.94
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）	-	-362,721,943.73	-362,721,943.73
五、期末所有者权益（基金净值）	13,839,886,060.60	-	13,839,886,060.60

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

华安现金富利投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第 135 号《关于同意华安现金富利投资基金设立的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安现金富利投资基金基金契约》(后更名为《华安现金富利投资基金基金合同》)发起，并于 2003 年 12 月 30 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,253,247,721.00 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 190 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人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。

根据《关于华安现金富利货币基金实施基金份额分级的公告》，自 2009 年 12 月 23 日起，本基金将基金份额分为 A 级和 B 级，不同级别的基金份额适用不同费率的销售服务费；并根据投资者基

金交易账户所持有份额数量是否不低于 500 万份进行不同级别基金份额的判断和处理。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《华安现金富利投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为价格波动幅度和信用风险低并具有高度流动性的短期金融工具，如银行定期存款、协议存款或大额存单、剩余期限不超过 397 天的短期债券、中央银行票据、期限在一年以内的债券回购、银行承兑汇票、经银行背书的商业承兑汇票或中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。本基金目前投资工具主要包括银行存款、短期债券(含央行票据)、回购协议等。本基金的业绩比较基准为银行个人活期储蓄税前利率。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2018 年 8 月 23 日批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安现金富利投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2018 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 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基金净值变动情况等有关信息。

#### **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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

### 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	76,929,277.10
定期存款	2,820,000,000.00
存款期限 1-3 个月	920,000,000.00
存款期限 1 个月以内	-

存款期限 3 个月以上	1,900,000,000.00
其他存款	-
合计	2,896,929,277.10

注：1. 定期存款的存款期限为定期存款的票面存期。

2. 本基金本期发生定期存款提前支取的情况，适用利率不变。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 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	7,330,415,61 2.57	7,337,675,000. 00	7,259,387.43	0.0613
	合计	7,330,415,61 2.57	7,337,675,000. 00	7,259,387.43	0.0613
资产支持证券		-	-	-	-
合计		7,330,415,61 2.57	7,337,675,000. 00	7,259,387.43	0.0613

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 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 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	-	-
银行间买入返售证券	2,800,062,725.20	-
合计	2,800,062,725.20	-

##### 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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	26,553.12
应收定期存款利息	15,008,666.22
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	19,074.10
应收债券利息	11,962,306.86
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,732,902.16
应收申购款利息	-
其他	-
合计	28,749,502.46

**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 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	249,758.02
合计	249,758.02

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 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	75,871.58
预提信息披露费	138,848.72
合计	223,574.14

**6.4.7.9 实收基金**

华安现金富利货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 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	828,869,829.66	828,869,829.66
本期申购	1,510,570,587.23	1,510,570,587.23
本期赎回（以“-”号填列）	-1,629,640,134.78	-1,629,640,134.78
本期末	709,800,282.11	709,800,282.11

**华安现金富利货币 B**

金额单位：人民币元

项目	本期 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	26,133,007,112.55	26,133,007,112.55
本期申购	48,157,029,322.15	48,157,029,322.15
本期赎回（以“-”号填列）	-63,163,874,721.17	-63,163,874,721.17
本期末	11,126,161,713.53	11,126,161,713.53

注：申购含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调减份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

**华安现金富利货币 A**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	14,630,166.36	-	14,630,166.36
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	-14,630,166.36	-	-14,630,166.36
本期末	-	-	-

**华安现金富利货币 B**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	378,034,167.80	-	378,034,167.80
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	-378,034,167.80	-	-378,034,167.80
本期末	-	-	-

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	677,677.01
定期存款利息收入	152,473,679.48
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	546,112.01
其他	-
合计	153,697,468.50

#### 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	26,121,719,987.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,030,294,382.77
减：应收利息总额	86,988,779.45
买卖债券差价收入	4,436,824.88

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	-
其他收入	45,015.41

合计	45,015.41
----	-----------

注：无。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	211.07
合计	211.07

#### 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	75,871.58
信息披露费	138,848.72
银行汇划费用	38,234.53
账户维护费	17,853.84
其他	600.00
合计	271,408.67

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

宣告日

分配收益所属期间

2018 年度

— 第 7 号收益支付公告 2018/07/12

2018/06/12-2018/07/11

— 第 8 号收益支付公告 2018/08/14

2018/07/12-2018/08/13

#### 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(“华安基金公司”)	基金管理人、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：下述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

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

##### 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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 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	32,876,662.22	31,463,630.73
其中：支付销售机构的客户维护费	786,738.52	463,698.23

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 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	9,962,624.91	9,534,433.50

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

### 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		
	华安现金富利货币A	华安现金富利货币B	合计
工商银行	408,323.99	16.32	408,340.31
华安基金管理有限公司	206,559.83	916,575.22	1,123,135.05
合计	614,883.82	916,591.54	1,531,475.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	华安现金富利货币A	华安现金富利货币B	合计
华安基金公司	234,888.06	893,244.63	1,128,132.69
工商银行	469,466.27	53.04	469,519.31
合计	704,354.33	893,297.67	1,597,652.00

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华安基金公司，再由华安基金公司计算并支付给各基金销售机构。A 级基金份额和 B 级基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。销售服务费的计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

### 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

单位：人民币元

银行间市场 交易的各关 联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	1,502,700,000.00	500,226.98
上年度可比期间						

2017年1月1日至2017年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	2,215,620,000.00	254,756.69

#### 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

#### 华安现金富利货币 B

份额单位：份

关联方名称	华安现金富利货币B本期末 2018年6月30日		华安现金富利货币B上年度末 2017年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
国泰君安创新投资有限公司	400,720,324.89	3.60%	-	-
华安资产管理（香港）有限公司	8,839,665.93	0.08%	-	-

#### 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 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
中国工商银行	76,929,277.10	677,677.01	37,305,762.21	416,231.00

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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

### 6.4.11 利润分配情况

#### 1、华安现金富利货币 A

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
17,334,859.00	-1,882,221.36	-822,471.28	14,630,166.3 6	-

#### 2、华安现金富利货币 B

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
329,707,174.59	67,460,665.38	-19,133,672.17	378,034,167. 80	-

### 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

截至本报告期末 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 1,232,137,806.39 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 单价	数量（张）	期末估值总额
170207	17 国开 07	2018-07-02	100.02	1,000,000.00	100,018,345.43
189918	18 贴现国债 18	2018-07-02	99.84	2,100,000.00	209,664,055.79
111819212	18 恒丰银行 CD212	2018-07-02	99.34	2,000,000.00	198,678,523.83
111819220	18 恒丰银行 CD220	2018-07-02	99.29	1,000,000.00	99,290,758.41

111819256	18 恒丰银行 CD256	2018-07-02	99.02	1,150,000.00	113,875,004.52
170410	17 农发 10	2018-07-06	100.03	300,000.00	30,010,126.82
180301	18 进出 01	2018-07-06	100.31	100,000.00	10,031,039.20
189903	18 贴现国债 03	2018-07-06	99.89	800,000.00	79,911,592.99
189918	18 贴现国债 18	2018-07-06	99.84	1,700,000.00	169,728,045.17
189919	18 贴现国债 19	2018-07-06	99.78	500,000.00	49,888,045.37
189921	18 贴现国债 21	2018-07-06	99.67	200,000.00	19,933,266.27
111809182	18 浦发银行 CD182	2018-07-06	99.17	820,000.00	81,319,274.44
150418	15 农发 18	2018-07-06	100.00	1,000,000.00	100,003,585.54
合计				12,670,000.00	1,262,351,663.78

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

##### 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行 中国工商银行，其他定期存款存放在具有托管资格的中信银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、深圳发展银行股份有限公司、浦东发展银行股份有限公司、天津银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、民生银行股份有限公司及恒丰银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 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 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
A-1	-	89,986,730.53
A-1 以下	-	-
未评级	6,990,347,847.97	7,560,706,727.81
合计	6,990,347,847.97	7,650,693,458.34

注：未评级债券为超短期融资券，国债，同业存单。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	340,067,764.60	1,288,662,728.20
合计	340,067,764.60	1,288,662,728.20

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 180 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。本基金投资于一家公司发行的短期企业债券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

#### 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》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(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,通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券),并结合份额持有人集中度变化予以实现。一般情况下,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天,平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天,且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天,平均剩余存续期不得超过 180 天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过

60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

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每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元



本期末 2018 年 6 月 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	2,896,929,277.10	-	-	-	2,896,929,277.10
结算备付金	42,386,818.18	-	-	-	42,386,818.18
交易性金融资产	7,320,384,573.37	10,031,039.20	-	-	7,330,415,612.57
买入返售金融资产	2,800,062,725.20	-	-	-	2,800,062,725.20
应收利息	-	-	-	28,749,502.46	28,749,502.46
应收申购款	-	-	-	1,101,679.94	1,101,679.94
资产总计	13,059,763,393.85	10,031,039.20	-	29,851,182.40	13,099,645,615.45
负债					
卖出回购金融资产款	1,232,137,806.39	-	-	-	1,232,137,806.39
应付赎回款	-	-	-	1,435,585.19	1,435,585.19
应付管理人报酬	-	-	-	4,757,662.15	4,757,662.15
应付托管费	-	-	-	1,441,715.76	1,441,715.76
应付销售服务费	-	-	-	290,117.04	290,117.04
应付交易费用	-	-	-	249,758.02	249,758.02
应付税费	-	-	-	3,463.79	3,463.79
应付利息	-	-	-	255,530.29	255,530.29
应付利润	-	-	-	22,888,407.04	22,888,407.04
其他负债	-	-	-	223,574.14	223,574.14
负债总计	1,232,137,806.39	-	-	31,545,813.42	1,263,683,619.81
利率敏感度缺口	11,827,625,587.46	10,031,039.20	-	-1,694,631.02	11,835,961,995.64
上年度末 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	5,286,670,790.65	-	-	-	5,286,670,790.65
结算备付金	5,681,818.18	-	-	-	5,681,818.18
交易性金融资产	8,939,356,186.54	-	-	-	8,939,356,186.54
买入返售金融资产	-	-	-	12,329,082,580.33	12,329,082,580.33
应收利息	-	-	-	97,076,948.90	97,076,948.90
应收申购款	-	-	-	565,961,081.39	565,961,081.39
资产总计	14,231,708,795.37	-	-	12,992,120,610.62	27,223,829,405.99
负债					
卖出回购金融资产款	209,699,445.45	-	-	-	209,699,445.45
应付赎回款	-	-	-	1,706,967.12	1,706,967.12
应付管理人报酬	-	-	-	4,998,774.40	4,998,774.40
应付托管费	-	-	-	1,514,780.13	1,514,780.13
应付销售服务费	-	-	-	322,515.67	322,515.67
应付交易费用	-	-	-	285,869.07	285,869.07
应付利息	-	-	-	157,561.45	157,561.45
应付利润	-	-	-	42,844,550.49	42,844,550.49
其他负债	-	-	-	422,000.00	422,000.00
负债总计	209,699,445.45	-	-	52,253,018.33	261,952,463.78
利率敏感度缺口	14,022,009,349.92	-	-	12,939,867,592.29	26,961,876,942.21

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影响金额（单位：人民币万元）

	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
市场利率上升 25 个基点	减少约 357	减少约 435
市场利率下降 25 个基点	增加约 357	增加约 435

#### 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

无。

## 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	7,330,415,612.57	55.96
	其中：债券	7,330,415,612.57	55.96
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,800,062,725.20	21.38
	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	2,939,316,095.28	22.44

4	其他各项资产	29,851,182.40	0.23
5	合计	13,099,645,615.45	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	2.62	
	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	1,232,137,806.39	10.41
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 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

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	48
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	55
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	12

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 7.3.2 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	39.94	10.41
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	23.65	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	38.95	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.45	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	3.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		110.42	10.41

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期无超过 240 天的情况。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	529,125,005.59	4.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	340,067,764.60	2.87
	其中：政策性金融债	340,067,764.60	2.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,000,917.62	0.34
6	中期票据	-	-
7	同业存单	6,421,221,924.76	54.25
8	其他	-	-
9	合计	7,330,415,612.57	61.93
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111810047	18 兴业银行 CD047	5,000,000	498,200,919.43	4.21

2	111819256	18 恒丰银行 CD256	5,000,000	495,108,715.29	4.18
3	111819264	18 恒丰银行 CD264	5,000,000	495,092,095.07	4.18
4	189918	18 贴现国债 18	3,800,000	379,392,100.96	3.21
5	111782091	17 南京银行 CD150	3,000,000	298,913,323.94	2.53
6	111808138	18 中信银行 CD138	3,000,000	298,518,440.93	2.52
7	111809172	18 浦发银行 CD172	3,000,000	297,592,819.08	2.51
8	111818145	18 华夏银行 CD145	3,000,000	297,592,606.42	2.51
9	111820121	18 广发银行 CD121	3,000,000	297,592,606.42	2.51
10	111815262	18 民生银行 CD262	3,000,000	297,509,540.64	2.51

### 7.7“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	0.0682%
报告期内偏离度的最低值	-0.0013%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0210%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值无达到0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值无达到0.5%的情况。

### 7.8 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。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。

7.9.2 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。

#### 7.9.3 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	28,749,502.46
4	应收申购款	1,101,679.94
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	29,851,182.40

### 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
华安现金富利货币 A	85,754	8,277.17	44,715,107.19	6.30%	665,085,174.92	93.70%
华安现金富利货币 B	45	247,248,038.08	11,112,207,606.27	99.87%	13,954,107.26	0.13%
合计	85,799	137,949.88	11,156,922,713.46	94.26%	679,039,282.18	5.74%

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）。

#### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	其他机构	1,065,262,889.67	9.00%
2	银行类机构	1,040,087,541.73	8.79%

3	其他机构	1,028,975,095.95	8.69%
4	银行类机构	1,021,998,054.07	8.63%
5	银行类机构	1,008,745,518.80	8.52%
6	银行类机构	1,002,566,955.14	8.47%
7	基金类机构	532,081,019.02	4.50%
8	基金类机构	503,464,111.88	4.25%
9	银行类机构	501,283,479.13	4.24%
10	保险类机构	500,995,247.37	4.23%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华安现金富利货币 A	2,239,391.19	0.32%
	华安现金富利货币 B	-	-
	合计	2,239,391.19	0.02%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华安现金富利货币 A	>100
	华安现金富利货币 B	-
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	华安现金富利货币 A	-
	华安现金富利货币 B	-
	合计	-

注：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	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B
本报告期期初基金份额总额	828,869,829.66	26,133,007,112.55
本报告期基金总申购份额	1,510,570,587.23	48,157,029,322.15
减：本报告期基金总赎回份额	1,629,640,134.78	63,163,874,721.17
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	709,800,282.11	11,126,161,713.53

注：申购含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调减份额。



## 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	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中银国际	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：

无

**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
国泰君安	-	-	99,942,600,000.00	100.00%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

**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	关于旗下部分基金增加大河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	2018-01-09
3	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-12
4	关于旗下部分基金增加电盈基金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	2018-01-16
5	华安基金关于参加大泰金石优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-18
6	华安现金富利投资基金 2017 年第 4 季度报告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-22
7	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
8	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金“春节”假期前暂停大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-02-09
9	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
10	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-02-13
11	华安现金富利投资基金更新的招募说明书（2018 年第 1 号）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-02-13
12	华安现金富利投资基金更新的招募说明书摘要（2018 年第 1 号）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-02-13
13	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-13
14	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
15	华安基金管理有限公司关于旗下华安现金富利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	2018-03-17

		司网站	
16	华安现金富利投资基金基金合同（更新）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-17
17	华安现金富利投资基金托管协议（更新）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-17
18	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
19	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
20	华安现金富利投资基金基金合同（更新）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-24
21	华安现金富利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
22	华安现金富利投资基金托管协议（更新）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-24
23	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加东海证券费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-27
24	华安现金富利投资基金 2017 年年度报告（摘要）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-27
25	华安现金富利投资基金 2017 年年度报告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-27
26	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
27	关于旗下部分基金增加唐鼎耀华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	2018-04-09
28	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
29	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
30	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投	《上海证券报》、《证券时	2018-04-12

	资基金收益支付公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
31	华安基金关于参加浙商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	2018-04-13
32	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
33	华安现金富利投资基金 2018 年第 1 季度报告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-21
34	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金“劳动节”假期前暂停大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-24
35	华安基金关于参加中经北正优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-26
36	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-05-14
37	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
38	关于华安暂停与浙江金观诚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	2018-06-12
39	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金“端午节”假期前暂停大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-12
40	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-12
41	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
42	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
43	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
44	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 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准华安现金富利投资基金设立的文件；
- 2、《华安现金富利投资基金基金合同》；
- 3、《华安现金富利投资基金招募说明书》；
- 4、《华安现金富利投资基金托管协议》；
- 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；

### 11.2 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>。

### 11.3 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