

# 华安汇财通货币市场基金

## 2020 年中期报告

### 2020 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：二〇二〇年八月二十八日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期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 2020 年 8 月 25 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 2020 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	6
<b>4 管理人报告</b>	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	11
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	12
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	12
<b>5 托管人报告</b>	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期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	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>7 投资组合报告</b>	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 债券回购融资情况	33
<b>7.3 基金投资组合平均剩余期限</b>	33
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	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	34
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	35
7.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	35
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	35
7.9 投资组合报告附注	35
<b>8 基金份额持有人信息</b>	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	38
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
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	39

<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	39
<b>10 重大事件揭示</b> .....	39
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	39
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 .....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	39
10.4 基金投资策略的改变 .....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	40
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 .....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	40
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 .....	43
10.9 其他重大事件 .....	43
<b>11 备查文件目录</b> .....	44
11.1 备查文件目录 .....	44
11.2 存放地点 .....	44
11.3 查阅方式 .....	44

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安汇财通货币市场基金
基金简称	华安汇财通货币
基金主代码	000709
交易代码	000709
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 7 月 17 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	11,779,148,942.42 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在力求本金安全、确保资产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将根据市场情况和可投资品种的容量，在严谨深入的研究分析基础上，综合考量宏观经济形势、市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等，确定各类货币市场工具的配置比例并进行积极的投资组合管理，在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。
业绩比较基准	人民币七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛珍	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	service@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 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	北京市西城区复兴门内大街55 号

	-32层	
邮政编码	200120	100140
法定代表人	朱学华	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、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、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（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	111,556,966.39
本期利润	111,556,966.39
本期净值收益率	1.0350%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	11,779,148,942.42
期末基金份额净值	1.00
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	21.4204%

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

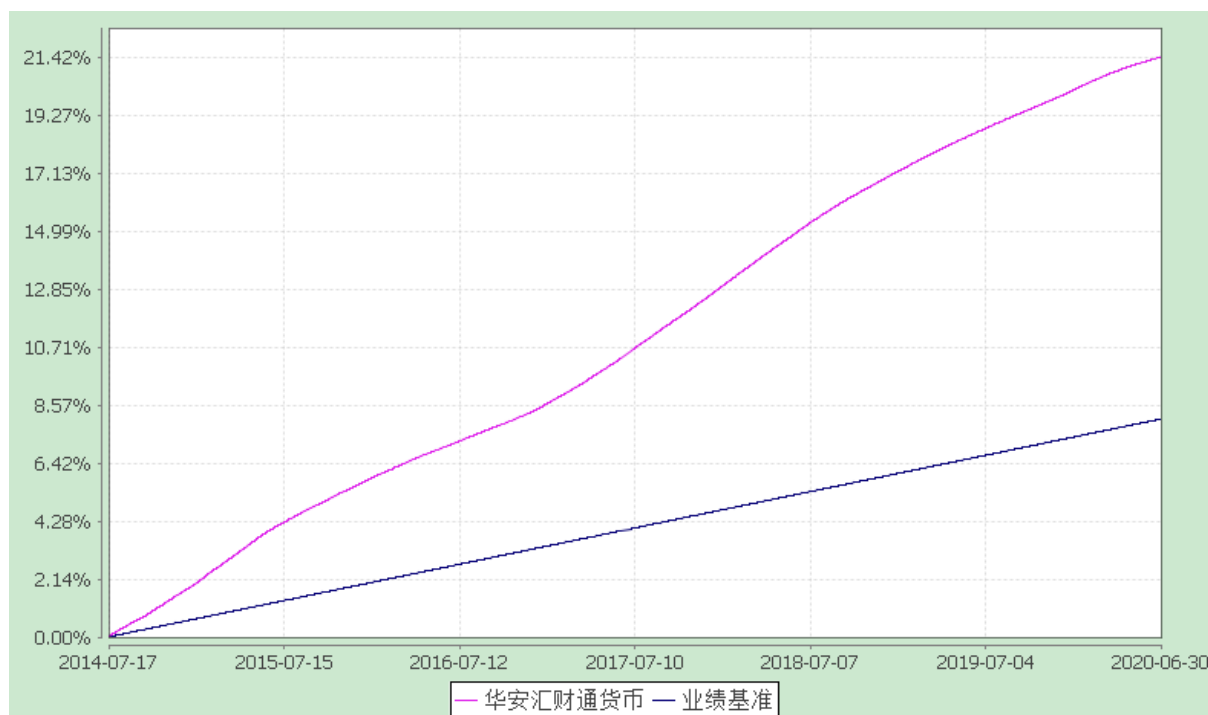
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去一个月	0.1361%	0.0001%	0.1110%	0.0000%	0.0251%	0.0001%
过去三个月	0.4349%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.0983%	0.0007%
过去六个月	1.0350%	0.0012%	0.6732%	0.0000%	0.3618%	0.0012%
过去一年	2.2531%	0.0010%	1.3537%	0.0000%	0.8994%	0.0010%
过去三年	9.8331%	0.0024%	4.0537%	0.0000%	5.7794%	0.0024%
自基金合同生效起至今	21.4204%	0.0028%	8.0482%	0.0000%	13.3722%	0.0028%

### 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

#### 华安汇财通货币市场基金

自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2014 年 7 月 17 日至 2020 年 6 月 30 日)



## 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

股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在北京、西安、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 2020 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 138 只开放式基金，管理资产规模达到 4,157.70 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		
朱才敏	本基金的基金经理	2014-11-20	-	12 年	金融工程硕士，具有基金从业资格证书，12 年基金行业从业经历。2007 年 7 月应届生毕业进入华安基金，历任金融工程部风险管理员、产品经理、固定收益部研究员、基金经理助理等职务。2014 年 11 月至 2017 年 7 月，同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 11 月起，同时担任华安汇财通货币市场基金、华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起同时担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月至 2018 年 10 月，同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起，同时担任华安安禧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月至 2018 年 1 月，同时担任华安新财富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月至 2017 年 12 月，同时担任华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 12 月起，同时担任华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起，同时担任华安睿安定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 5 月起，同时担任华安鼎信 3 个月定期开放债券型发起式证券



					投资基金的基金经理。2019 年 7 月起，同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2019 年 8 月起，同时担任华安年年丰一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
李邦长	本基金的基金经理	2019-07-01	-	10 年	硕士研究生，具有基金从业资格证书。曾任安永华明会计师事务所审计师，2010 年 3 月加入华安基金管理有限公司，先后从事基金运营、债券交易和债券研究等工作，2014 年 9 月起担任基金经理助理，2016 年 3 月至 2019 年 12 月，同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 3 月起，同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2016 年 11 月起，同时担任华安鼎丰债券型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任华安鼎瑞定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起，同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

#### 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》，将各投资组合在研究分析、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》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、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。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的

交易所公开竞价交易中, 同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 次, 未出现异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年, 全球经济受新冠疫情影响, 1-2 月国内疫情严峻, 3 月之后疫情得到有效控制, 但海外疫情超预期爆发并持续蔓延, 各经济体均陆续经历“关停”。一季度国内经济大幅下行, 实际 GDP 增速-6.8%, 固定资产投资、消费、工业增加值均大幅负增长; 随着疫情的有效控制, 复产复工稳步推进, 经济开始逐步恢复, 二季度实际 GDP 增速回到 3.2%, 出口表现好于预期, 投资、消费、工业增加值均明显改善。政策方面, 着眼于稳就业保民生, 而非强刺激, “两会”定调更加积极有为的财政政策和更加灵活适度的货币政策, 央行推出“创新直达实体经济的货币政策工具”。上半年货币市场经历了持续宽松到逐步回归平衡的过程, 货币市场利率先下后上, 债券市场收益率也表现为先下后上, 十年国债收益率一度创下 2003 年以来新低, 目前已回到疫情前水平附近。

报告期内, 基金配置以大额存单、定存、逆回购和高等级短融为主, 适当运用杠杆, 通过较高的票息收入和积极的价差操作赚取超额收益。通过审慎和积极的管理, 在把握流动性的基础上, 积极努力为投资者赚取较高收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

投资回报: 1.0350% 比较基准: 0.6732%

#### 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, 海外新冠疫情尚未得到有效控制, 全球经济疲弱, 出口压力仍存, 投资在基建带动下仍有回升动力, 消费受收入预期下降等因素影响预计难以持续回升, 失业率维持高位且在 7 月有季节性走高压力, 部分城市地产政策略有收紧, 预计三季度经济或有一定压力, 届时政策或有阶段性边际放松可能。目前来看, 债市风险已得到较为明显释放, 预计利率债或有阶段性机会, 信用债利差恢复后将具备配置价值。。

操作方面, 我们将积极关注债市的投资机会, 特别是中高评级短融, 甄选个券进行配置和波段操作。同时也会关注逆回购、定存和大额存单的价格走势, 把握利率冲高时点、锁定收益。在控制组合流动性和安全性风险的基础上, 为投资者积极赚取超额收益。

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。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，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，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。本报告期华安汇财通货币累计收益分配金额 111,556,966.39 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汇财通货币市场基金的托管过程中，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，华安汇财通货币市场基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安汇财通货币

市场基金的投资运作、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 托管人对本中期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汇财通货币市场基金 2020 年中期报告中财务指标、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：华安汇财通货币市场基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	3,195,987,026.79	4,455,581,617.91
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,664,266,154.64	5,059,612,248.58
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,664,266,154.64	5,059,612,248.58
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	4,195,233,412.86	1,334,595,121.90
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	19,585,147.97	38,329,988.19
应收股利		-	-
应收申购款		59,848,500.94	71,954,568.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,134,920,243.20	10,960,073,544.87
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 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		350,013,384.99	1,019,978,070.03
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		10,207.76	209.98
应付管理人报酬		2,582,891.06	2,346,660.56
应付托管费		478,313.14	434,566.77
应付销售服务费		2,391,565.77	2,172,833.87
应付交易费用	6.4.7.7	123,285.60	87,143.56
应交税费		36,010.34	30,406.66
应付利息		22,191.34	270,858.51
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	113,450.78	229,003.15
负债合计		355,771,300.78	1,025,549,753.09
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	11,779,148,942.42	9,934,523,791.78
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		11,779,148,942.42	9,934,523,791.78
负债和所有者权益总计		12,134,920,243.20	10,960,073,544.87

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 11,779,148,942.42 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安汇财通货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>145,508,743.59</b>	<b>251,165,758.08</b>
1.利息收入		143,456,510.37	248,525,770.68
其中：存款利息收入	6.4.7.11	54,996,373.63	92,560,055.80
债券利息收入		55,672,459.59	130,706,294.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		32,787,677.15	25,259,420.65
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,052,233.22	2,639,987.40
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	2,052,233.22	2,639,987.40
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-

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>33,951,777.20</b>	<b>52,018,907.66</b>
1. 管理人报酬		14,609,099.14	19,678,318.31
2. 托管费		2,705,388.70	3,644,133.03
3. 销售服务费		13,526,943.65	18,220,665.07
4. 交易费用	6.4.7.18	-	-
5. 利息支出		2,942,241.74	10,302,177.90
其中：卖出回购金融资产支出		2,942,241.74	10,302,177.90
6.税金及附加		13,241.70	8,687.92
7. 其他费用	6.4.7.19	154,862.27	164,925.43
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>111,556,966.39</b>	<b>199,146,850.42</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>111,556,966.39</b>	<b>199,146,850.42</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安汇财通货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	9,934,523,791.78	-	9,934,523,791.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	111,556,966.39	111,556,966.39
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,844,625,150.64	-	1,844,625,150.64
其中：1.基金申购款	88,777,859,357.37	-	88,777,859,357.37
2.基金赎回款	-86,933,234,206.73	-	-86,933,234,206.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-111,556,966.39	-111,556,966.39
五、期末所有者权益（基金净值）	11,779,148,942.42	-	11,779,148,942.42
项目	上年度可比期间		

	2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	16,584,041,198.25	-	16,584,041,198.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	199,146,850.42	199,146,850.42
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）	-4,691,072,599.08	-	-4,691,072,599.08
其中：1.基金申购款	36,583,042,975.89	-	36,583,042,975.89
2.基金赎回款	-41,274,115,574.97	-	-41,274,115,574.97
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）	-	-199,146,850.42	-199,146,850.42
五、期末所有者权益（基金净值）	11,892,968,599.17	-	11,892,968,599.17

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

华安汇财通货币市场基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]607 号《关于核准华安汇财通货币市场基金募集的批复》的核准，由华安基金管理有限公司作为管理人于 2014 年 7 月 7 日到 2014 年 7 月 10 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2014)验字第 60971571\_B07 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 2014 年 7 月 17 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 251,603,578.39 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 54,324.09 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 251,657,902.48 元，折合 251,657,902.48 份基金份额。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。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：现金，通知存款，短期融资券，一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单，期限在一年以内(含一年)的债券回购，期限在一年以内(含一年)的中央银行票据，剩余期限(或回售期限)在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融



工具。

法律法规或监管机构允许货币市场基金投资其他货币市场基金或同业存单的，在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的前提下，本基金可参与其他货币市场基金或同业存单的投资，不需召开份额持有人大会，具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

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

本基金业绩比较基准：人民币七天通知存款利率（税后）。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间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 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

##### 6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	25,987,026.79
定期存款	3,170,000,000.00
存款期限 1-3 个月	1,250,000,000.00
存款期限 3 个月以上	1,920,000,000.00
其他存款	-
合计	3,195,987,026.79

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 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	4,664,266,154.64	4,662,126,500.00	-2,139,654.64	-0.0182
	合计	4,664,266,154.64	4,662,126,500.00	-2,139,654.64	-0.0182
资产支持证券		-	-	-	-
合计		4,664,266,154.64	4,662,126,500.00	-2,139,654.64	-0.0182

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 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 2020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	4,195,233,412.86	-
合计	4,195,233,412.86	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	6,525.20
应收定期存款利息	3,782,166.73
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	11,896,165.58
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	3,900,290.46
应收申购款利息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	19,585,147.97

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本期末其他资产无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	123,285.60
合计	123,285.60

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	123.12
应付证券出借违约金	-
预提审计费	44,753.80
预提信息披露费	59,672.34
预提账户维护费	8,901.52
合计	113,450.78

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,934,523,791.78	9,934,523,791.78
本期申购	88,777,859,357.37	88,777,859,357.37
本期赎回（以“-”号填列）	-86,933,234,206.73	-86,933,234,206.73
本期末	11,779,148,942.42	11,779,148,942.42

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

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	111,556,966.39	-	111,556,966.39
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	-111,556,966.39	-	-111,556,966.39
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	59,427.83
定期存款利息收入	54,936,945.80
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	54,996,373.63

#### 6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,019,080,307.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,992,473,847.20
减：应收利息总额	24,554,227.08
买卖债券差价收入	2,052,233.22

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.18 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	31,934.61
账户维护费	17,901.52
其他费用	600.00
合计	154,862.27

#### 6.4.7.20 分部报告

无。

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无

##### 6.4.9.2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（以下简称“华安基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构

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未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,609,099.14	19,678,318.31
其中：支付销售机构的客户维护费	7,492,569.78	8,897,424.13

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,705,388.70	3,644,133.03



注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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 2020年1月1日至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
华安基金管理有限 公司	4,543,110.58
中国工商银行股份 有限公司	-
合计	4,543,110.58
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
华安基金管理有限 公司	6,808,419.42
工商银行	-
合计	6,808,419.42

注：基金销售服务费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

### 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

本期 2020年1月1日至2020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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
工商银行	-	-	-	-	6,045,096,000.00	568,209.70

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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

无。

##### 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	25,987,026.79	59,427.83	18,720,740.08	99,359.39

##### 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

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
111,556,966.39	-	-	111,556,966. 39	-

#### 6.4.12 期末（2020 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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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 2020 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金融资产款余额人民币 350,013,384.99 元，是以如下债券作为质押：

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
209918	20 贴现国债 18	2020-07-01	99.95	1,068,000	106,751,591.73
150420	15 农发 20	2020-07-01	100.27	1,000,000	100,267,793.52
112015194	20 民生银行 CD194	2020-07-01	99.51	964,000	95,930,175.81
200304	20 进出 04	2020-07-01	99.92	483,000	48,263,306.00
112015194	20 民生银行 CD194	2020-07-01	99.51	100,000	9,951,263.05
合计				3,615,000	361,164,130.11

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险

主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在力求本金安全、确保资产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。

#### 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控制委员会，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；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

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

#### 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。

#### 6.4.13.3 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。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、连续 3 个交易日累计赎回 20% 以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30% 以上的情形外，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%。

#### 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。

#### 6.4.13.3.2 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 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。

本基金的基金管理人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。

本基金主要投资于交易所及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 2020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	3,195,987,026.79	-	-	-	3,195,987,026.79
交易性金融资产	4,312,695,661.86	351,570,492.78	-	-	4,664,266,154.64

买入返售金融资产	4,195,233,412.86	-	-	-	4,195,233,412.86
应收利息	-	-	-	19,585,147.97	19,585,147.97
应收申购款	-	-	-	59,848,500.94	59,848,500.94
资产总计	11,703,916,101.51	351,570,492.78	-	79,433,648.91	12,134,920,243.20
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	350,013,384.99	-	-	-	350,013,384.99
应付赎回款	-	-	-	10,207.76	10,207.76
应付管理人报酬	-	-	-	2,582,891.06	2,582,891.06
应付托管费	-	-	-	478,313.14	478,313.14
应付销售服务费	-	-	-	2,391,565.77	2,391,565.77
应付交易费用	-	-	-	123,285.60	123,285.60
应交税费	-	-	-	36,010.34	36,010.34
应付利息	-	-	-	22,191.34	22,191.34
其他负债	-	-	-	113,450.78	113,450.78
负债总计	350,013,384.99	-	-	5,757,915.79	355,771,300.78
利率敏感度缺口	11,353,902,716.52	351,570,492.78	-	73,675,733.12	11,779,148,942.42
上年度末 2019 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
银行存款	4,455,581,617.91	-	-	-	4,455,581,617.91
交易性金融资产	4,764,603,249.48	295,008,999.10	-	-	5,059,612,248.58
买入返售金融资产	1,334,595,121.90	-	-	-	1,334,595,121.90
应收利息	-	-	-	38,329,988.19	38,329,988.19
应收申购款	-	-	-	71,954,568.29	71,954,568.29
资产总计	10,554,779,989.29	295,008,999.10	-	110,284,556.48	10,960,073,544.87
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,019,978,070.03	-	-	-	1,019,978,070.03
应付赎回款	-	-	-	209.98	209.98
应付管理人报酬	-	-	-	2,346,660.56	2,346,660.56
应付托管费	-	-	-	434,566.77	434,566.77
应付销售服务费	-	-	-	2,172,833.87	2,172,833.87
应付交易费用	-	-	-	87,143.56	87,143.56
应交税费	-	-	-	30,406.66	30,406.66
应付利息	-	-	-	270,858.51	270,858.51
其他负债	-	-	-	229,003.15	229,003.15
负债总计	1,019,978,070.03	-	-	5,571,683.06	1,025,549,753.09
利率敏感度缺口	9,534,801,919.26	295,008,999.10	-	104,712,873.42	9,934,523,791.78

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了归类。

#### 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	上年度末
		2020 年 6 月 30 日	2019 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 371	减少约 311
	市场利率下降 25 个基点	增加约 371	增加约 312

#### 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。本基金主要投资于交易所及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。

#### 6.4.14 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 2020 年 8 月 25 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	4,664,266,154.64	38.44
	其中：债券	4,664,266,154.64	38.44



	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,195,233,412.86	34.57
	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	3,195,987,026.79	26.34
4	其他各项资产	79,433,648.91	0.65
5	合计	12,134,920,243.20	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	3.50	
	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	350,013,384.99	2.97
	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	67
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	97
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	55

### 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	各期限负债占基金资产净
----	--------	-------------	-------------

		值的比例 (%)	值的比例 (%)
1	30 天以内	40.31	2.97
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	12.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	21.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	6.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	21.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	102.35	2.97

#### 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

本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

#### 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	159,927,478.25	1.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	465,566,874.04	3.95
	其中：政策性金融债	465,566,874.04	3.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	769,871,230.14	6.54
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,268,900,572.21	27.75
8	其他	-	-
9	合计	4,664,266,154.64	39.60
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	112015194	20 民生银行 CD194	4,000,000	398,050,522.02	3.38
2	112016151	20 上海银行 CD151	3,000,000	299,565,894.38	2.54
3	112091920	20 杭州银行 CD035	3,000,000	298,987,494.92	2.54
4	112095896	20 中原银行 CD087	3,000,000	298,599,674.32	2.53
5	112020071	20 广发银行 CD071	2,000,000	199,057,300.73	1.69
6	112097802	20 苏州银行 CD117	2,000,000	199,013,067.30	1.69
7	112098129	20 东莞农村商业银行 CD091	2,000,000	198,978,957.42	1.69
8	112099608	20 宁波银行 CD092	2,000,000	198,720,547.61	1.69
9	112095319	20 贵阳银行 CD034	2,000,000	197,790,328.85	1.68
10	112003014	20 农业银行 CD014	2,000,000	196,649,659.42	1.67

### 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	0.1508%
报告期内偏离度的最低值	-0.0299%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0607%

#### 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。

### 7.8 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。

7.9.22019 年 12 月 14 日，民生银行因同业票据业务管理失控等违法违规事项，被北京银保监局（京银保监罚决字〔2019〕56 号）责令改正，并给予合计 700 万元罚款的行政处罚。2020 年 2 月 10 日，民生银行因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易，被中国人民银行（银罚字〔2020〕1 号）给予罚款 2360 万元的行政处罚。

2020 年 3 月 9 日，农业银行因可回溯制度执行不到位、可回溯基础管理不到位、部分可回溯视频质检结果未反馈给保险公司等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2020〕3 号）给予罚款 50 万元的行政处罚。2020 年 4 月 22 日，农业银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在资金交易信息漏报严重、信贷资产转让业务漏报等违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2020〕12 号）给予罚款合计 230 万元的行政处罚。2020 年 4 月 22 日，农业银行因“两会一层”境外机构管理履职不到位、国别风险管理不满足监管要求等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2020〕11 号）给予罚款合计 200 万元的行政处罚。

2019 年 11 月 2 日，上海银行因违反支付业务规定，被中国人民银行上海分行（上海银罚字〔2019〕22 号）给予没收违法所得 1,762,787.61 元，并处以 1,762,787.61 元罚款，共计 3,525,575.22 元的行政处罚。

2019 年 12 月 5 日，宁波银行因设立时点性规模考核指标、股权质押管理不合规，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2019〕67 号）给予罚款人民币 40 万元的行政处罚，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

2020 年 6 月 28 日，贵阳银行因向关系人发放信用贷款，被中国银行保险监督管理委员会贵州监管局（贵银保监罚决字〔2020〕4 号）给予罚款五十万元的行政处罚。2020 年 6 月 28 日，贵阳银行因重要岗位轮岗执行不到位，被中国银行保险监督管理委员会贵州监管局（贵银保监罚决字〔2020〕5 号）给予罚款二十万元的行政处罚。2020 年 6 月 28 日，贵阳银行因理财资金借助通道发放委托贷款等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会贵州监管局（贵银保监罚决字〔2020〕6 号）给予罚款五十万元的行政处罚。2020 年 6 月 28 日，贵阳银行因以贷还贷、掩盖不良、贷款五级分类不准确，被中国银行保险监督管理委员会贵州监管局（贵银保监罚决字〔2020〕7 号）给予罚款三十万元的行政处罚。2020 年 6 月 28 日，贵阳银行因理财资金投资本行信贷资产收益权，被中国

银行保险监督管理委员会贵州监管局（贵银保监罚决字〔2020〕8号）给予罚款二十万元的行政处罚。2020年6月29日，贵阳银行因代为履职超过规定期限、股东出质银行股份未向董事会备案等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会贵州监管局（贵银保监罚决字〔2020〕10号）给予罚款六十万元的行政处罚。2020年6月29日，贵阳银行因以自有资金借道发放信托贷款等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会贵州监管局（贵银保监罚决字〔2020〕11号）给予罚款三十万元的行政处罚。

2020年1月3日，杭州银行因贷后管理不到位、流动资金贷款挪用入房地产企业，被中国银保监会浙江监管局（浙银保监罚决字〔2020〕5号）给予罚款人民币50万元的行政处罚。2020年1月16日，杭州银行因虚增存贷款、向资本金比例不足的房地产项目提供融资等违法违规事项，被中国银保监会浙江监管局（浙银保监罚决字〔2020〕12号）给予罚款225万元的行政处罚。

2019年11月25日，中原银行因未按规定报送银行结售汇统计表，被国家外汇管理局河南省分局（豫汇检罚〔2019〕8号）给予警告，并处3万元罚款的行政处罚。

2019年12月17日，广发银行因办理经常项目资金收付未对交易单证的真实性及其外汇收支的一致性进行合理审查、违反规定办理结汇、违反外汇账户管理规定，被国家外汇管理局广东省分局（粤汇处〔2019〕10号）责令改正，给予警告、没收违法所得370,961.98元人民币、并处120万元人民币罚款的行政处罚。

2019年12月31日，苏州银行因房地产开发贷款发放不审慎、个人信贷资金用途管理不到位、同业业务交易对手管理不到位，被中国银行保险监督管理委员会苏州监管分局（苏州银保监罚决字〔2019〕58号）给予罚款人民币150万元的行政处罚。

本基金投资 20 民生银行 CD194、20 农业银行 CD014、20 上海银行 CD151、20 宁波银行 CD092、20 杭州银行 CD035、20 中原银行 CD087、20 广发银行 CD071、20 苏州银行 CD117、20 贵阳银行 CD034 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名其他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	19,585,147.97
4	应收申购款	59,848,500.94
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	79,433,648.91

#### 7.9.4 其他需说明的重要事项

无。

### 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

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
2,497,309	4,716.74	141,148,861.83	1.20%	11,638,000,080.59	98.80%

#### 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	个人	52,999,569.21	0.45%
2	个人	47,709,830.98	0.41%
3	个人	37,572,550.57	0.32%
4	其他机构	35,861,118.35	0.30%
5	其他机构	30,436,600.34	0.26%
6	个人	25,020,412.19	0.21%

7	其他机构	20,853,494.05	0.18%
8	个人	20,523,228.80	0.17%
9	基金类机构	12,888,982.25	0.11%
10	个人	10,849,317.93	0.09%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	29,416,746.63	0.25%

### 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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 7 月 17 日）基金份额总额	251,657,902.48
本报告期期初基金份额总额	9,934,523,791.78
本报告期基金总申购份额	88,777,859,357.37
减：本报告期基金总赎回份额	86,933,234,206.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,779,148,942.42

注：申购含红利再投份额。

## 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：

无。

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	
招商证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
北京高华证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
广发华福证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-



中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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

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

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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：

2020 年 1 月完成托管在工商银行的华西证券上海交易单元 45727 租用

2020 年 6 月完成托管在工商银行的开源证券深圳交易单元 010273 租用

2020 年 6 月完成托管在工商银行的长城证券上海交易单元 20267 退租

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
北京高华证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
广发华福证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

### 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调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-28
2	华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-04
3	华安基金管理有限公司关于根据信息披露管理办法修订旗下公募基金基金合同等法律文件的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
4	华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台调整“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-14
5	华安基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-25
6	华安基金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》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-30
7	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-11
8	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》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
9	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交	《上海证券报》、中国证	2020-06-29

	易费率优惠活动的公告	监会基金电子披露网站 和公司网站	
--	------------	---------------------	--

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

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

### 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

二〇二〇年八月二十八日