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:二〇一五年八月二十八日

# 华安汇财通货币市场基金

## 【2015】半年度报告摘要

### 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2015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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

### 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 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 | 904,370,503.15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,追求超越银行活期存款基准的投资回报。 |
| 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。 |

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 | 钱昶 | 蒋松云 |
| | 联系电话 | 021-38969999 | 010-66106799 |
| | 电子邮箱 | qianchang@huaan.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008850099 | 95588 |
| 传真 | | 021-68816414 | 010-66106798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 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 |

### 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(2015年1月1日至2015年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 15,117,268.15 |
| 本期利润 | 15,117,268.15 |
| 本期净值收益率 | 2.2258% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015年6月30日) |
| 期末基金资产净值 | 904,370,503.15 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 |

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金合同于2014年7月17日生效。

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 | 0.3187% | 0.0039% | 0.1110% | 0.0000% | 0.2077% | 0.0039% |
| 过去三个月 | 1.0904% | 0.0038% | 0.3366% | 0.0000% | 0.7538% | 0.0038% |
| 过去六个月 | 2.2258% | 0.0036% | 0.6695% | 0.0000% | 1.5563% | 0.0036% |
| 自基金成立起至今 | 4.0921% | 0.0032% | 1.2908% | 0.0000% | 2.8013% | 0.0032% |

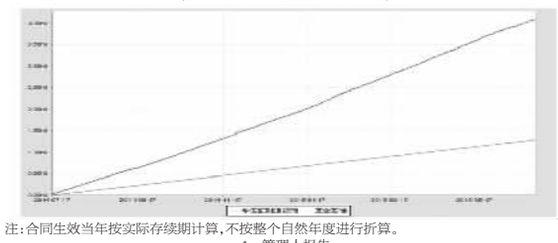
注:1、本基金业绩比较基准:人民币七天通知存款利率(税后)。

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

3、本基金合同于2014年7月17日生效。

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
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2015年6月30日)



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

### 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2015年6月30日,公司旗下共管理华安创新混合、华安中国A股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证180ETF、华安上证180ETF联接、华安宏利股票、华安大国新经济股票、华安安顺灵活配置混合、华安物联网股票、华安宝利配置、华安生态优先股票的基金经理,华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部总监。

杨明,投资研究部高级总监,研究生学历,15年金融、证券、基金从业经验,曾在上海银行工作。2004年10月进入华安基金管理有限公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部高级总监。

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

许之彦,指数投资部高级总监,理学博士,CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作,2005年加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部数量策略分析师,现任华安上证180ETF及华安上证180ETF联接、华安沪深300指数证券投资基金(LOF)、华安易富黄金ETF及联接基金、华安中证高分红指数增强型、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级的基金经理,指数投资部高级总监。

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

(2)托管银行

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

(3)会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.7 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15,117,268.15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

无。

### 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》、《货币市场基金管理暂行规定》、《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》、《货币市场基金管理暂行规定》、《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汇财通货币市场基金2015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:华安汇财通货币市场基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | - | - |
| 银行存款 | 82,880,965.93 | 81,119,562.91 |
| 结算备付金 | 95,000.00 | 100,500.00 |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 819,710,375.61 | 193,053,346.00 |
| 其中:股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 819,710,375.61 | 193,053,346.00 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 138,001,167.00 | 88,401,012.60 |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 5,591,111.37 | 3,027,944.24 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | 2,500.00 |
| 资产总计 | 1,046,278,619.91 | 365,704,865.75 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
| 负 债: | - | - |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 141,289,329.35 | 43,399,734.90 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 204,102.35 | 69,191.62 |
| 应付托管费 | 37,796.71 | 12,813.23 |
| 应付销售服务费 | 188,983.66 | 64,066.26 |
| 应付交易费用 | 29,807.71 | 21,035.56 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 5,375.02 | 5,760.42 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 152,661.96 | 209,000.00 |
| 负债合计 | 141,908,116.76 | 43,781,601.99 |
| 所有者权益: | - | - |
| 实收基金 | 904,370,503.15 | 321,923,263.76 |
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 904,370,503.15 | 321,923,263.76 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,046,278,619.91 | 365,704,865.75 |

注:(1)报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额904,370,503.15份。

(2)本基金合同于2014年7月17日生效。

6.2 利润表

会计主体:华安汇财通货币市场基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|---|---|
| 一、收入 | 18,062,160.41 |
| 1.利息收入 | 16,374,435.09 |
| 其中:存款利息收入 | 7,256,665.60 |
| 债券利息收入 | 8,429,931.76 |
| 资产支持证券利息收入 | - |
| 买入返售金融资产收入 | 687,834.74 |
| 其他利息收入 | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 1,685,777.37 |
| 其中:股票投资收益 | - |
| 基金投资收益 | - |
| 债券投资收益 | 1,685,777.37 |
| 资产支持证券投资收益 | - |
| 衍生工具收益 | - |
| 股利收益 | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | - |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 1,947.95 |
| 减:二、费用 | 2,944,892.26 |
| 1. 管理人报酬 | 928,919.92 |
| 2. 托管费 | 172,022.19 |
| 3. 销售服务费 | 860,111.04 |
| 4. 交易费用 | - |
| 5. 利息支出 | 797,978.36 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 797,978.36 |
| 6. 其他费用 | 185,860.76 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 15,117,268.15 |
| 减:所得税费用 | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 15,117,268.15 |

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:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015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) | 321,923,263.76 | - | 321,923,263.76 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 15,117,268.15 | 15,117,268.15 |
| 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) | 582,447,239.39 | - | 582,447,239.39 |
| 其中:1.基金申购款 | 5,820,366,084.42 | - | 5,820,366,084.42 |
| 2.基金赎回款 | -5,237,918,845.03 | - | -5,237,918,845.03 |
| 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) | - | -15,117,268.15 | -15,117,268.15 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 904,370,503.15 | - | 904,370,503.15 |

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:章国富,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。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》;修订了《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

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2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015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

除下述会计估计变更的说明以外,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

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

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、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》,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,继续免征营业税和企业所得税;

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。

6.4.6.2个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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、国家税务总局财税字[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关联方关系

6.4.7.1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

本报告期内未发生变化。

6.4.7.2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 | 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 | 基金托管人 |
| 华安基金管理有限公司工会委员会 | 基金管理人的工会委员会 |

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。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.4债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 928,919.92 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 112,283.71 |

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×0.27%/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。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 172,022.19 |

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×0.05%/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。

6.4.8.2.3 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 2015年1月1日至2015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 | 316,33164 |
| 合计 | 316,33164 |

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×0.25%/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。

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|---|---|
| 期初持有的基金份额 | 50,621,687.59 |
| 期间申购/买入总份额 | - |
| 期间因拆分变动份额 | - |
| 减:期间赎回/卖出总份额 | 50,621,687.59 |
| 期末持有的基金份额 | - |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - |

注:期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

6.4.8.4.2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

| 关联方名称 | 本期末 2015年6月30日 | | 上年度末 2014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 |
| 华安基金管理有限公司工会委员会 | 5,519,248.17 | 0.61% | - | - |

6.4.8.5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 2015年1月1日至2015年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 2,880,965.93 | 9,211.22 |

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.9期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1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。

6.4.9.2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。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015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141,289,329.35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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 041558036 | 15沈公用CP002 | 2015-07-01 | 99.96 | 50,000 | 4,998,073.06 |
| 041572002 | 15福施发CP001 | 2015-07-01 | 99.96 | 200,000 | 19,992,877.90 |
| 071504006 | 15广发CP006 | 2015-07-01 | 99.99 | 300,000 | 29,996,577.25 |
| 011562001 | 15太钢SCP001 | 2015-07-01 | 99.93 | 400,000 | 39,972,102.18 |
| 011569324 | 15粤电SCP001 | 2015-07-01 | 99.99 | 11,000 | 1,099,917.34 |
| 140223 | 14国开23 | 2015-07-01 | 100.14 | 200,000 | 20,028,314.49 |
| 140352 | 14进出52 | 2015-07-01 | 99.72 | 300,000 | 29,914,974.05 |
| 合计 | | | | 1,461,000 | 146,002,836.27 |

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015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。

6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10.1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。

6.4.10.2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。

6.4.10.3财务报表的批准

本财务报表已于2015年8月28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 | 819,710,375.61 | 78.35 |
| | 其中:债券 | 819,710,375.61 | 78.35 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 138,001,167.00 | 13.19 |
| | 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 | 82,975,965.93 | 7.93 |
| 4 | 其他各项资产 | 5,591,111.37 | 0.53 |
| 5 | 合计 | 1,046,278,619.91 | 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 | 9.80 | |
| | 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 | 141,289,329.35 | 15.62 |
| | 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 | 101 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 119 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 78 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过180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180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 | 22.22 | 15.62 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)—60天 | 27.63 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)—90天 | 29.85 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)—180天 | 12.16 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)—397天(含) | 23.21 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 115.06 | 15.62 |

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 | 49,943,281.54 | 5.52 |
| | 其中:政策性金融债 | 49,943,281.54 | 5.52 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 769,767,087.07 | 85.12 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 819,710,375.61 | 90.64 |
| 9 | 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 | 011562001 | 15太钢SCP001 | 400,000 | 39,972,102.18 | 4.42 |
| 2 | 071507002 | 15中信建投CP002 | 300,000 | 29,997,067.70 | 3.32 |
| 3 | 071511005 | 15国信证券CP005 | 300,000 | 29,996,887.06 | 3.32 |
| 4 | 011569345 | 15京能清洁能源SCP003 | 300,000 | 29,996,797.64 | 3.32 |
| 5 | 071504006 | 15广发CP006 | 300,000 | 29,996,577.25 | 3.32 |
| 6 | 071523004 | 15华融证券CP004 | 300,000 | 29,996,565.74 | 3.32 |
| 7 | 071503007 | 15中信CP007 | 300,000 | 29,996,382.76 | 3.32 |
| 8 | 071522003 | 15齐鲁证券CP003 | 300,000 | 29,994,733.24 | 3.32 |
| 9 | 071521004 | 15渤海证券CP004 | 300,000 | 29,994,699.82 | 3.32 |
| 10 | 011569361 | 15徐工SCP002 | 300,000 | 29,989,550.41 | 3.32 |

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 | 23 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.41% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.03% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.12% |

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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本报告期内本基金不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

7.8.3本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.8.4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 | 5,591,111.37 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 5,591,111.37 |

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 |
| 45,162 | 20,025.02 | 10,593,122.25 | 1.17% | 893,699,206.14 | 98.82% |

8.2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 | 4,166,977.55 | 0.461% |

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0至10万份(含);

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

| | |
|---|---|
| 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 | 321,923,263.76 |
| 本报告期基金总申购份额 | 5,820,366,084.42 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 5,237,918,845.03 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 904,370,503.15 |

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、本基金管理人重大人事变动如下:

(1)2015年3月7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,尚志民先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(2)2015年6月30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,秦军先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(3)2015年7月11日,基金管理人发布了华安基金管理有限公司高级管理人员变更公告,童威先生新任本基金管理人的总经理。

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报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计