华安日日鑫货币市场基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年八月二十四日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设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2018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	华安日日鑫货币		
场内简称	货币ETF		
基金主代码	040038		
交易代码	040038		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年11月26日		
基金管理人	华安基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	102,170,627,343.20份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	华安日日鑫货币A	华安日日鑫货币B	华安日日鑫货币H
下属分级基金的场内简称	-	-	货币ETF
下属分级基金的交易代码	040038	040039	511600
报告期末下属分级基金的份额总额	93,764,090,307.93份	8,224,389,569.66份	182,147,465.61份

2.2 基金产品说明

投资目标	为满足投资人现金管理和日常理财需求,本基金在力求本金安全、确保基金资产流动性的基础上,追求稳定的当期收益,谋求资产的稳定增值。
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	同期七天通知存款利率(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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱根	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要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(2018年1月1日-2018年6月30日)		
	华安日日鑫货币A	华安日日鑫货币B	华安日日鑫货币H
本期已实现收益	285,987,683.29	343,544,799.48	9,657,038.44
本期利润	285,987,683.29	343,544,799.48	9,657,038.44
本期净值收益率	2.0499%	2.1688%	2.0382%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)		
	华安日日鑫货币A	华安日日鑫货币B	华安日日鑫货币H
期末基金资产净值	93,764,090,307.93	8,224,389,569.66	182,147,465.61
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	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、自2016年9月12日起,本基金增设H类份额,简称为"货币ETF"。

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. 华安日日鑫货币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	0.3240%	0.0006%	0.0888%	0.0000%	0.2352%	0.0006%
过去三个月	0.9975%	0.0008%	0.2693%	0.0000%	0.7282%	0.0008%
过去六个月	2.0499%	0.0012%	0.5356%	0.0000%	1.5143%	0.0012%
过去一年	4.0859%	0.0011%	1.0800%	0.0000%	3.0059%	0.0011%
过去三年	10.3675%	0.0029%	3.2430%	0.0000%	7.1245%	0.0029%
自基金成立起至今	23.0839%	0.0039%	6.0450%	0.0000%	17.0389%	0.0039%

2. 华安日日鑫货币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	0.3433%	0.0006%	0.0888%	0.0000%	0.2545%	0.0006%
过去三个月	1.0561%	0.0007%	0.2693%	0.0000%	0.7868%	0.0007%
过去六个月	2.1688%	0.0012%	0.5356%	0.0000%	1.6332%	0.0012%
过去一年	4.3332%	0.0011%	1.0800%	0.0000%	3.2532%	0.0011%
过去三年	11.1615%	0.0029%	3.2430%	0.0000%	7.9185%	0.0029%
自基金成立起至今	24.7403%	0.0040%	6.0450%	0.0000%	18.6953%	0.0040%

3. 华安日日鑫货币H:

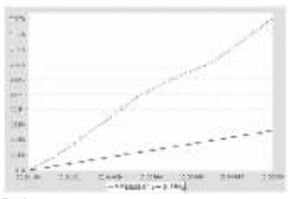
阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3212%	0.0006%	0.0888%	0.0000%	0.2324%	0.0006%
过去三个月	0.9890%	0.0007%	0.2693%	0.0000%	0.7197%	0.0007%
过去六个月	2.0382%	0.0012%	0.5356%	0.0000%	1.5026%	0.0012%
过去一年	4.0645%	0.0010%	1.0800%	0.0000%	2.9845%	0.0010%
自基金成立起至今	6.7351%	0.0023%	1.9440%	0.0000%	4.7911%	0.0023%

注:自2016年9月12日起,本基金增设H类份额,简称为"货币ETF"。

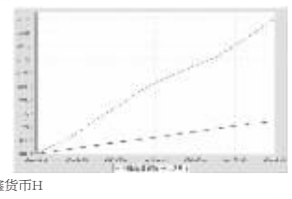
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安日日鑫货币市场基金
累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年11月26日至2018年6月30日)

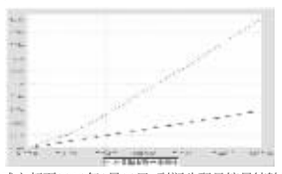
华安日日鑫货币A



华安日日鑫货币B



华安日日鑫货币H



注:本基金自成立起至2016年8月29日,利润分配是按月结转份额。自2016年8月30日起至今,利润分配是按日结转份额。

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		
李邦长	本基金的基金经理	2016-03-02	-	8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月起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、本基金的基金经理,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。
苏卿云	本基金的基金经理	2016-12-19	-	10年	硕士研究生,10年证券行业从业经历。曾任上海证券交易所基金业务部经理,2016年7月加入华安基金,任指数与量化投资事业总部ETF业务负责人。2016年12月起,担任本基金的基金经理,2017年6月起,担任华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年10月起,同时担任华安沪深300指数分级证券投资基金、华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2017年12月起,同时担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。

孙丽娜	本基金的基金经理	2018-05-31	-	7年	硕士研究生,7年债券、基金行业从业经验。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月起同时担任华安现金富利投资基金的基金经理。2015年2月起担任华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4月起同时担任华安添顺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,同时担任本基金的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

本报告期内,我们勤勉尽责,稳健操作,在保证组合流动性安全的前提下,甄选优质个券,捕捉流动性收紧资金利率冲高机会,投资定存、同业存单和逆回购等品种锁定高收益,并适时根据市场变化调整组合结构,拉长组合平均剩余期限,灵活把握投资机会,为持有人获得了可观的组合收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

华安日日鑫货币A:

投资回报:2.0499%　　比较基准:0.5356%

华安日日鑫货币B:

投资回报:2.1688%　　比较基准:0.5356%

华安日日鑫货币H:

投资回报:2.0382%　　比较基准:0.5356%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

操作方面,我们将继续把握基金的流动性和收益性的平衡,优化组合资产配置计划,把握结构性机会,主要通过锁定高收益同业存款和甄选优质同业存单博取较高的持有收益,提高组合整体收益,为投资者创造更多价值。我们将秉承稳健、专业的投资理念,优化组合结构,控制风险,勤勉尽责地维护持有人的利益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定,本基金收益根据每日基金收益公告,以每万份基金份额收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配。本报告期华安日日鑫货币A累计收益分配金额285,987,683.29元,华安日日鑫货币B累计收益分配金额343,544,799.48元,华安日日鑫货币H累计收益分配金额9,657,038.44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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期华安日日鑫货币A累计收益分配金额285,987,683.29元,华安日日鑫货币B累计收益分配金额343,544,799.48元,华安日日鑫货币H累计收益分配金额9,657,038.44元。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:华安日日鑫货币市场基金
报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:	-	-
银行存款	53,053,248,084.37	5,554,906,841.35
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	38,029,263,816.53	7,674,503,067.60
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	38,029,263,816.53	7,674,503,067.60
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	10,822,116,213.18	4,409,077,373.63
应收证券清算款	-	-
应收利息	325,639,054.98	54,431,786.43
应收股利	-	-
应收申购款	5,990,553.14	8,451,735.54
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	102,236,257,722.20	17,701,370,804.55
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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	-	921,498,297.75
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	277,013.40	551,658.26
应付管理人报酬	18,384,593.74	2,627,703.18
应付托管费	7,353,837.51	1,051,081.30
应付销售服务费	16,320,029.71	311,644.16
应付交易费用	456,383.15	174,646.14
应交税费	78,214.23	-
应付利息	-	426,218.60
应付利润	22,548,137.93	6,731,021.82
递延所得税负债	-	-
其他负债	212,169.33	309,000.00
负债合计	65,630,379.00	933,681,271.21
所有者权益:	-	-
实收基金	102,170,627,343.20	16,767,689,533.34
未分配利润	-	-
所有者权益合计	102,170,627,343.20	16,767,689,533.34
负债和所有者权益总计	102,236,257,722.20	17,701,370,804.55

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102,170,627,343.20份,其中A类基金份额总额93,764,090,307.93份;B类基金份额总额8,224,389,569.66份;H类基金份额总额182,147,465.61份,H类基金份额净值为100.00元,本表所列H类基金份额数据面值已折算为1.00元。

6.2 利润表

会计主体:华安日日鑫货币市场基金
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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	721,727,275.24	67,462,365.30
1.利息收入	711,537,283.91	67,770,709.07
其中:存款利息收入	300,507,753.02	24,807,969.60
债券利息收入	279,886,712.88	19,801,136.22
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	131,142,818.01	23,161,603.25
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	10,189,896.33	-308,343.77
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	10,189,896.33	-308,343.77
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)	95.00	-
减:二、费用	82,537,754.03	9,966,715.74
1. 管理人报酬	38,031,832.76	3,820,349.31
2. 托管费	15,212,733.09	1,528,139.77
3. 销售服务费	18,910,316.65	1,858,627.50
4. 交易费用	30.00	-
5. 利息支出	10,056,193.87	2,531,018.29
其中:卖出回购金融资产支出	10,056,193.87	2,531,018.29
6.税金及附加	49,784.89	-
7. 其他费用	277,862.77	229,580.87
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	639,189,521.21	57,495,649.56
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	639,189,521.21	57,495,649.56

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安日日鑫货币市场基金
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)	16,767,689,533.34	-	16,767,689,533.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	639,189,521.21	639,189,521.21
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)	85,402,937,809.86	-	85,402,937,809.86
其中:1.基金申购款	231,051,877,459.30	-	231,051,877,459.30
2.基金赎回款	-145,648,939,649.44	-	-145,648,939,649.44
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)	-	-639,189,521.21	-639,189,521.21
五、期末所有者权益(基金净值)	102,170,627,343.20	0.00	102,170,627,343.20
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)	9,019,960,403.33	-	9,019,960,403.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	57,495,649.56	57,495,649.56
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)	-6,955,126,018.77	-	-6,955,126,018.77
其中:1.基金申购款	6,880,181,470.64	-	6,880,181,470.64
2.基金赎回款	-13,835,307,489.41	-	-13,835,307,489.41
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)	-	-57,495,649.56	-57,495,649.56
五、期末所有者权益(基金净值)	2,064,834,384.56	0.00	2,064,834,384.56

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

华安日日鑫货币市场基金(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[2012]1442号文《关于核准华安日日鑫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自2012年11月16日至2012年11月22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(2012)验字第60971571_B09号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2012年11月26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926,586,589.70元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币191,274.11元,以上实收基金(本息)合计为人民币926,777,863.81元,折合926,777,863.81份基金份额,其中A类基金份额为575,145.376.19份,B类基金份额为351,632.487.62份。本基金的基金管理人和注册登记机构为华安基金管理有限公司,托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金根据基金份额持有人持有本基金份额的数量,对基金份额持有人持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,因此形成不同的基金份额类别:A类基金份额和B类基金份额。若基金份额持有人在单个基金交易账户保留的A类基金份额达到或超过500万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金交易账户保留的A类基金份额全部升级为B类基金份额。若基金份额持有人在单个基金交易账户保留的B类基金份额低于500万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金交易账户保留的B类基金份额全部降级为A类基金份额。

本基金投资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、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。

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:同期七天通知存款利率(税后)。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安宏利股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018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

7.4.6.1 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税;

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称"资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.8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 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	38,031,832.76	3,820,349.31
其中:支付销售机构的客户维护费	12,448,448.65	245,531.25

注:基金管理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为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累