

华融现金增利货币市场基金

2018年年度报告摘要

基金管理人:华融证券股份有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
送出日期:2019年3月29日

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月15日核对了本基金的财务报表、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请仔细阅读基金的投资说明书及其更新。

本报告中财务数据未经审计,德勤会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,投资者注意:
本财务报告自2018年1月1日起至2018年12月31日止。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应当阅读年度报告正文。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item and Content. Details include fund name, code, type, manager, and distributor.

2.2 基金产品说明

投资目标: 旨在有效分散投资风险,保持基金资产价值的相对稳定,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期增值。

投资策略: 本基金的投资范围包括国内依法发行和上市交易的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、期权及法律法规允许投资的其他金融工具。

业绩比较基准: 中证货币指数收益率*80%+银行活期存款利率*20%

风险收益特征: 本基金为货币市场基金,基金资产的预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 3 columns: Role, Name, and Contact Info. Lists the fund manager and custodian.

2.4 信息披露方式

基金年度报告正文的官方网站网址: www.huarong.com.cn
基金年度报告摘要网址: www.huarong.com.cn

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 4 columns: Item, 2018年, 2017年, 2016年. Financial metrics like net assets, income, and expenses.

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

Table with 4 columns: Period, Fund Return, Benchmark Return, Difference. Performance comparison for 2018, 2017, and 2016.

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



图1: 自基金合同生效以来基金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

3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



图2: 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

资产负债表

Balance Sheet table for 2018年12月31日 and 2017年12月31日.

3.3 过去三年基金的利润分配情况

Table showing dividend distribution details for 2018, 2017, and 2016.

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经营情况

4.1.1 基金管理人及其基金经营情况
华融证券股份有限公司(以下简称“公司”)是经中国证监会批准,由中国华融资产管理股份有限公司(以下简称“中国华融”)作为发起人,联合中国银河国际信托有限公司共同发起设立的货币市场基金公司,2007年9月,公司在北京正式注册成立,目前,公司注册地在北京,下设深圳、上海、天津、北京、广东、湖南、新疆、湖北、陕西、贵州、四川、江西、湖南、浙江、山东、福建、辽宁、广东共16个分公司,66家营业部,控股华融期货有限责任公司与中国融瑞投资管理咨询有限公司。

4.1.2 基金管理人(或基金管理人)及其基金经营情况
报告期内,不存在任何对组合参与的交易对手公平性有反向交易或成交对价的单边交易且超过该证券当日收盘价的5%的情况,未发现基金管理人有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.2 管理人报告期内遵守法律法规的情况

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规,以及中国证监会、基金业协会、基金托管人等相关监管规定,依法合规开展基金管理业务,未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大失信行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规,严格执行投资管理流程和风险控制制度,确保基金资产在投资管理、投资决策和交易执行等环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.4 异常交易行为的专项说明

本报告期内,不存在任何对组合参与的交易对手公平性有反向交易或成交对价的单边交易且超过该证券当日收盘价的5%的情况,未发现基金管理人有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.5 基金管理人报告期内基金投资情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规,严格执行投资管理流程和风险控制制度,确保基金资产在投资管理、投资决策和交易执行等环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.6 基金管理人报告期内基金估值情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司估值业务指导意见》及其他相关法律法规,严格执行估值流程和风险控制制度,确保基金资产在估值环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.7 基金管理人报告期内基金流动性风险的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司流动性风险管理指导意见》及其他相关法律法规,严格执行流动性风险管理流程和风险控制制度,确保基金资产在流动性风险管理环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.8 基金管理人报告期内基金投资情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规,严格执行投资管理流程和风险控制制度,确保基金资产在投资管理、投资决策和交易执行等环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.9 基金管理人报告期内基金估值情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司估值业务指导意见》及其他相关法律法规,严格执行估值流程和风险控制制度,确保基金资产在估值环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.10 基金管理人报告期内基金流动性风险的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司流动性风险管理指导意见》及其他相关法律法规,严格执行流动性风险管理流程和风险控制制度,确保基金资产在流动性风险管理环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.11 基金管理人报告期内基金投资情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规,严格执行投资管理流程和风险控制制度,确保基金资产在投资管理、投资决策和交易执行等环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.12 基金管理人报告期内基金估值情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司估值业务指导意见》及其他相关法律法规,严格执行估值流程和风险控制制度,确保基金资产在估值环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.13 基金管理人报告期内基金流动性风险的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司流动性风险管理指导意见》及其他相关法律法规,严格执行流动性风险管理流程和风险控制制度,确保基金资产在流动性风险管理环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.14 基金管理人报告期内基金投资情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规,严格执行投资管理流程和风险控制制度,确保基金资产在投资管理、投资决策和交易执行等环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.15 基金管理人报告期内基金估值情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司估值业务指导意见》及其他相关法律法规,严格执行估值流程和风险控制制度,确保基金资产在估值环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.16 基金管理人报告期内基金流动性风险的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司流动性风险管理指导意见》及其他相关法律法规,严格执行流动性风险管理流程和风险控制制度,确保基金资产在流动性风险管理环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.17 基金管理人报告期内基金投资情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规,严格执行投资管理流程和风险控制制度,确保基金资产在投资管理、投资决策和交易执行等环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.18 基金管理人报告期内基金估值情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司估值业务指导意见》及其他相关法律法规,严格执行估值流程和风险控制制度,确保基金资产在估值环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.19 基金管理人报告期内基金流动性风险的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司流动性风险管理指导意见》及其他相关法律法规,严格执行流动性风险管理流程和风险控制制度,确保基金资产在流动性风险管理环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.20 基金管理人报告期内基金投资情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规,严格执行投资管理流程和风险控制制度,确保基金资产在投资管理、投资决策和交易执行等环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.21 基金管理人报告期内基金估值情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司估值业务指导意见》及其他相关法律法规,严格执行估值流程和风险控制制度,确保基金资产在估值环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.22 基金管理人报告期内基金流动性风险的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司流动性风险管理指导意见》及其他相关法律法规,严格执行流动性风险管理流程和风险控制制度,确保基金资产在流动性风险管理环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.23 基金管理人报告期内基金投资情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规,严格执行投资管理流程和风险控制制度,确保基金资产在投资管理、投资决策和交易执行等环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.24 基金管理人报告期内基金估值情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司估值业务指导意见》及其他相关法律法规,严格执行估值流程和风险控制制度,确保基金资产在估值环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.25 基金管理人报告期内基金流动性风险的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司流动性风险管理指导意见》及其他相关法律法规,严格执行流动性风险管理流程和风险控制制度,确保基金资产在流动性风险管理环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.26 基金管理人报告期内基金投资情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规,严格执行投资管理流程和风险控制制度,确保基金资产在投资管理、投资决策和交易执行等环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

4.27 基金管理人报告期内基金估值情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司估值业务指导意见》及其他相关法律法规,严格执行估值流程和风险控制制度,确保基金资产在估值环节的公平交易,未发现任何不公平交易和利益输送的情况。

利润表

Income Statement table for 2018年12月31日 and 2017年12月31日.

现金流量表

Cash Flow Statement table for 2018年12月31日 and 2017年12月31日.

所有者权益变动表

Equity Statement table for 2018年12月31日 and 2017年12月31日.

6.1 审计报告的基本信息

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师: 张俊

6.2 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.3 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.4 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.5 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.6 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.7 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.8 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.9 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.10 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.11 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.12 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.13 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.14 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.15 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.16 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.17 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.18 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.19 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.20 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.21 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.22 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.23 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.24 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.25 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.26 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.27 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.28 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.29 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.30 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.31 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.32 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.33 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.34 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.35 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.36 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.37 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

6.38 审计报告的基本内容

我们认为,后附财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2018年12月31日的财务状况,以及2018年度的经营成果和现金流量。

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: Bond Code, Name, Quantity, Value, and Ratio. Lists top 10 bonds.

7.4.1.3 债券回购交易

Table with 2 columns: Item and Amount. Details on bond repurchase transactions.

7.4.1.4 权证交易

7.4.1.4 权证交易
本基金报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.1.5 应支付关联方的佣金

7.4.1.5 应支付关联方的佣金
本基金本报告期无应付关联方的佣金。

7.4.2 关联方报酬

7.4.2.1 基金管理费

Table with 2 columns: Item and Amount. Details on management fees.

7.4.2.2 基金托管费

Table with 2 columns: Item and Amount. Details on custody fees.

7.4.2.3 销售服务费

Table with 2 columns: Item and Amount. Details on sales service fees.

7.4.3 关联方报酬

7.4.3 关联方报酬
本基金本报告期无关联方报酬。

7.4.4 关联方报酬

7.4.4 关联方报酬
本基金本报告期无关联方报酬。

7.4.5 关联方报酬

7.4.5 关联方报酬
本基金本报告期无关联方报酬。

7.4.6 关联方报酬

7.4.6 关联方报酬
本基金本报告期无关联方报酬。

7.4.7 关联方报酬

7.4.7 关联方报酬
本基金本报告期无关联方报酬。

7.4.8 关联方报酬

7.4.8 关联方报酬
本基金本报告期无关联方报酬。

7.4.9 关联方报酬

7.4.9 关联方报酬
本基金本报告期无关联方报酬。

7.4.10 关联方报酬

7.4.10 关联方报酬
本基金本报告期无关联方报酬。

7.4.11 关联方报酬

7.4.11 关联方报酬
本基金本报告期无关联方报酬。

7.4.12 关联方报酬

7.4.12 关联方报酬
本基金本报告期无关联方报酬。

7.4.13 关联方报酬

7.4.13 关联方报酬
本基金本报告期无关联方报酬。

7.4.14 关联方报酬

7.4.14 关联方报酬
本基金本报告期无关联方报酬。

7.4.15 关联方报酬

7.4.15 关联方报酬
本基金本报告期无关联方报酬。

7.4.16 关联方报酬