华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年三月三十日

§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2019年3月26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,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至9月19日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	华安季季鑫短期理财债券	
基金主代码	040030	
交易代码	040030	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年5月23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	4,541,338,663.32份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B
下属分级基金的交易代码	040030	040031
报告期末下属分级基金的份额总额	15,943,340.99份	4,525,396,322.33份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求本金安全的基础上,追求稳健的当期收益。
投资策略	本基金采用“运作期滚动”的方式运作,在运作期内,本基金将在坚持组合久期与运作期基本匹配的原则下,采用持有到期策略构建投资组合,基本保持大类品种配置的比例恒定。集中申购期内,本基金将采用流动性管理与组合调整相结合的策略。
业绩比较基准	无。
风险收益特征	本基金为采用固定组合策略的短期理财债券型基金,属于证券投资基金中较低风险、预期收益较为稳定的品种,其预期的风险水平低于股票基金、混合基金和普通债券基金。

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	陆霆	郭明
	联系电话	021-38969999	(010)66105799
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	(010)66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	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、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

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	2018年		2017年		2016年	
	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B
本期已实现收益	602,553.96	161,595,624.40	3,296,512.43	130,369,781.86	304,395.11	81,509.77
本期利润	602,553.96	161,595,624.40	3,296,512.43	130,369,781.86	304,395.11	81,509.77
本期净值收益率	2.9799%	3.1098%	3.2573%	2.2139%	1.4076%	1.6401%
3.1.2期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B
期末基金资产净值	15,943,340.99	4,525,396,322.33	27,181,709.22	3,816,000,000.00	19,355,782.34	-
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000

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,由于短期理财债券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

1. 华安季季鑫短期理财债券A:

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
过去三个月	0.9285%	0.0011%	-	-	-	-
过去六个月	1.8563%	0.0011%	-	-	-	-
过去一年	4.0912%	0.0021%	-	-	-	-
过去三年	8.2403%	0.0043%	-	-	-	-
过去五年	16.6429%	0.0049%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	22.9874%	0.0052%	-	-	-	-

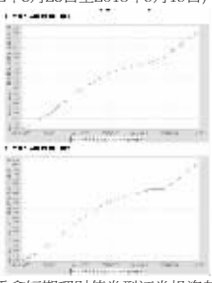
2. 华安季季鑫短期理财债券B:

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
过去三个月	0.9966%	0.0011%	-	-	-	-
过去六个月	1.9848%	0.0012%	-	-	-	-
过去一年	4.3098%	0.0018%	-	-	-	-
过去三年	7.6097%	0.0050%	-	-	-	-
过去五年	16.5845%	0.0056%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	23.3625%	0.0061%	-	-	-	-

注:各阶段均以最后运作日2018年9月19日为对日统计。

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

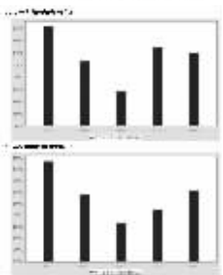
华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年5月23日至2018年9月19日)



注:根据《华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》规定,本基金已自基金合同生效之日起每个运作期的10 个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二部分投资范围的有关规定。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金
过去五年基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图



注:合同生效当年、暂停运作当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

华安季季鑫短期理财债券A:

单位:人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2017年	297,548.67	2,971,953.92	27,009.84	3,296,512.43	-
2016年	141,386.89	156,792.56	6,215.66	304,395.11	-
2018年	146,487.74	342,424.45	113,641.77	602,553.96	-
合计	585,423.30	3,471,170.93	146,867.27	4,203,461.50	-

华安季季鑫短期理财债券B:

单位:人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2016年	-	81,820.64	-310.87	81,509.77	-
2017年	5,001,058.18	120,216,594.85	5,152,128.83	130,369,781.86	-
2018年	9,396,322.33	112,259,329.22	39,940,972.85	161,595,624.40	-
合计	14,396,380.51	232,557,744.71	45,092,790.81	292,046,916.03	-

§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、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12月31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108只开放式基金,管理资产规模达到2756.06亿元人民币。

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、本基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金、华安日日鑫货币市场基金的基金经理2016年11月起,同时担任华安鼎瑞定期开放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。

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公平交易制度和控制方法

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wind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。

4.3.2公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3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4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

2018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,通胀预期较为平稳,美联储议息会议多次上调联邦基金利率,但最新 PMI 数据开始下滑,显示经济增长动能有所走弱。欧元区经济基本面转弱,制造业 PMI 数据下滑,投资者信心指数继续回落,通胀也进一步走弱。国内经济方面,工业企业利润增速从下半年开始持续下滑,工业增加值增速明显回落,基建投资增速走平,消费低于预期,制造业投资有所回升,叠加贸易摩擦影响,短期经济运行出现疲弱态势;由于经济增速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,全年通过实施多次定向降准、增量操作MLF以及CRA等操作释放资金使得流动性总体较为宽松,除季末等个别时点有所波动外,资金面总体较为宽松。债市方面,受降准利好、机构融资需求放缓、中美贸易摩擦反复变化推升避险情绪,以及基本面数据走弱等因素推动,债券市场全年总体维持做多行情。从数据表现来看,十年期国债收益率下行幅度超60bp,3Y-5Y 期 AAA 级中短期票据收益率下行幅度超130bp,各期限品种信用利差收窄。

本报告期内,合理安排组合久期,主要投资于利率较高的同业存款和同业存单,同时把握机会,配置银行间逆回购以获得可观的持有收益。组合整体在有效控制流动性风险的前提下,保证了适中的整体收益率。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

华安季季鑫短期理财债券A:

投资回报:2.9799%

华安季季鑫短期理财债券B:

投资回报:3.1098%

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 2019 年,基建将继续加大托底力度,但国内地产仍处下行周期,贸易摩擦的不确定性可能对进出口带来一定扰动,宏观经济存下行压力,但随着诸多宽信用举措的推进,经济失速风险较低。通胀总体来看较为平稳,关注下半年猪价等因素对CPI的扰动;随着央行进入降准通道,银行表内外资金将更加趋于平衡,预计2019年上半年资金面总体维持平稳。债券市场面临的大环境变得更加复杂,交易性机会依然存在但是波动性加大。

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,每季集中支付收益。本报告期华安季季鑫短期理财A累计收益分配金额602,553.96元, 华安季季鑫短期理财B累计收益分配金额 161,595,624.40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季季鑫短期理财债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他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, 华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金的投资运作、每万份基金净收益和基金利润分配、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本期利润分配情况为华安季季鑫短期理财债券A:602,553.96元; 华安季季鑫短期理财债券B:161,595,624.40元。

5.3 托管人对本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季季鑫短期理财债券型证券投资基金2018年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 蒋燕华 沈熙苑签字出具了安永华明(2019)专字第60971571_B02号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金
报告截止日:2018年9月19日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年9月19日	上年度末 2017年12月31日
资产:	-	-
银行存款	892,537,613.34	262,807,430.37
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	-	3,244,117,378.94
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	-	3,244,117,378.94
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	3,697,502,888.75	1,497,707,086.56
应收证券清算款	-	-
应收利息	292,717.74	2,361,521.01
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,590,333,219.83	5,006,993,416.88
负债和所有者权益	本期末 2018年9月19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	-	1,150,197,514.70
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,721,070.26	4,832,988.24
应付托管费	806,243.22	1,431,996.57
应付销售服务费	110,333.34	246,569.70
应付交易费用	14,666.86	121,199.25
应交税费	-	-
应付利息	-	1,680,968.59
应付利润	45,241,085.23	5,186,470.61
递延所得税负债	-	-
其他负债	101,157.60	114,000.00
负债合计	48,994,556.51	1,163,811,707.66
所有者权益:	-	-
实收基金	4,541,338,663.32	3,843,181,709.22
未分配利润	-	-
所有者权益合计	4,541,338,663.32	3,843,181,709.22
负债和所有者权益总计	4,590,333,219.83	5,006,993,416.88

注:(1)报告截止日2018年9月19日,基金份额净值1.00元,基金份额总额4,541,338,663.32份,其中A类基金份额总额15,943,340.99份;B类基金份额总额4,525,395,322.33份。

(2)本基金自2018年9月20日起暂停运作。

7.2 利润表

会计主体:华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年9月19日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年9月19日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	187,633,096.75	177,090,013.64
1.利息收入	186,513,143.56	175,742,310.12
其中:存款利息收入	5,813,783.12	53,232,275.75
债券利息收入	151,005,309.61	108,187,985.46
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	29,694,050.83	14,322,048.91
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	1,119,953.19	1,347,703.52
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,119,953.19	1,347,703.52
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)	-	-
减:二、费用	25,434,918.39	43,423,719.35
1. 管理人报酬	10,279,214.66	8,364,703.01
2. 托管费	3,045,693.45	2,478,431.05
3. 销售服务费	418,811.79	533,690.43
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	11,560,381.20	31,889,265.84
其中:卖出回购金融资产支出	11,560,381.20	31,889,265.84
6. 其他费用	130,817.29	157,629.02
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	162,198,178.36	133,666,294.29
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	162,198,178.36	133,666,294.29

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年9月19日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年9月19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)	3,843,181,709.22	-	3,843,181,709.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	162,198,178.36	162,198,178.36
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)	698,156,954.10	-	698,156,954.10
其中:1.基金申购款	5,410,424,204.20	-	5,410,424,204.20
2.基金赎回款	-4,712,267,250.10	-	-4,712,267,250.10
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)	-	-162,198,178.36	-162,198,178.36
五、期末所有者权益(基金净值)	4,541,338,663.32	-	4,541,338,663.32
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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)	19,355,782.34	-	19,355,782.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	133,666,294.29	133,666,294.29
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)	3,823,825,926.88	-	3,823,825,926.88
其中:1.基金申购款	9,946,204,152.85	-	9,946,204,152.85
2.基金赎回款	-6,122,378,225.97	-	-6,122,378,225.97
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)	-	-133,666,294.29	-133,666,294.29
五、期末所有者权益(基金净值)	3,843,181,709.22	-	3,843,181,709.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,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

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金(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]539号《关于核准华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集, 基金合同于2012年5月23日正式生效, 首次设立募集规模为5,526,551,295.11份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金以“运作期滚动”方式运作。自基金合同生效日起,本基金在运作期内不开放日常申购与赎回,仅在运作期最后1日开放当期赎回。每个运作期结束后,本基金将安排一个集中申购期,开放下一运作期的集中申购。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。

根据《华安季季鑫短期理财债券型基金关于2018年第3期运作期到期后暂停下一运作期运作的公告》, 本基金在2018年第3期到期后将暂停下一运作期运作,不再接受申购申请,2018年第3期运作期为2018年6月22日至2018年9月19日,到期赎回开放日为2018年9月19日,基金份额持有人可在该日赎回或转换转出本基金基金份额,2018年9月19日未提交赎回或转换转出申请的本基金A类和B类份额,将与第3期通过约定赎回代码(000568)集中申购本基金的基金份额一起,在本运作期期末发起自动全额赎回。

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。

本基金投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金、银行定期存款、大额存单、债券回购、短期融资券、国债、中央银行票据、金融债、中期票据、企业债及中国证监会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的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

根据《华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》和《华安季季鑫短期理财债券型基金关于2018年第3期运作期到期后暂停下一运作期运作的公告》, 本基金在2018年第3期到期后暂停下一运作期运作。本基金暂停运作以后,暂停运作期间所发生的费用,由基金管理人承担,本基金管理人将根据监管要求和实际情况,在履行相应程序后,决定本基金后续运作的相关安排,详情以届时公告为准。

7.4.2会计报表的编制基础

本财务报表系按照 《华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》 约定的资产估值和会计核算方法及财务报表7.4.4所述的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表按照7.4.2所述的编制基础编制,真实、完整地反映了本基金于2018年9月19日的财务状况以及2018年1月1日至2018年9月19日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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。

7.4.7关联方关系

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(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.5应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年9月19日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,279,214.66	8,364,703.01
其中:支付销售机构的客户维护费	17,504.23	110,354.71

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×基金管理费年费率/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,逐日累计至每个运作期结束月末。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年9月19日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,045,693.45	2,478,431.05

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.08%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×基金托管费年费率/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