华融现金增利货币市场基金 2019年半年度报告摘要

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8月29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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年8月18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2019年1月1日起至6月30日止。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华融现金增利货币市场基金		
基金简称	华融现金增利货币		
场内简称	–		
基金主代码	000785		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年9月16日		
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		
报告期末基金份额总额	1,413,716,762.92份		
基金合同存续期	–		
基金份额上市的证券交易所	–		
上市日期	–		
下属分级基金的基金简称:	华融现金增利A	华融现金增利B	华融现金增利C
下属分级基金场内简称:	–	–	–
下属分级基金的交易代码:	000785	000786	000787
报告期末下属分级基金的份额总额	9,844,976.41份	299,766,617.93份	1,104,105,168.58份

2.2 基金产品说明

投资目标	在充分控制基金资产风险、保持基金资产流动性的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金的投资将以保证资产的安全性和流动性为基本原则,力求在对国内外宏观经济走势、货币财政政策变动等因素充分评估的基础上,科学预计未来利率走势,择优筛选并优化配置投资范围内的各种金融工具,进行积极的投资组合管理。
业绩比较基准	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,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

	华融现金增利A	华融现金增利B	华融现金增利C
下属分级基金的风险收益特征	–	–	–

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		华融证券股份有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梅思佳	李修滨
	联系电话	010-85556481	4006800000
	电子邮箱	meisijia@hrsec.com.cn	lixiubin@citichank.com
客户服务电话		400-898-9999	95558
传真		010-85556592	010-85230024

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.fund.hrsec.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§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

基金级别	华融现金增利A	华融现金增利B	华融现金增利C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	137,453.43	2,934,662.93	14,037,399.24
本期利润	137,453.43	2,934,662.93	14,037,399.24
本期净值收益率	1.2096%	1.3304%	1.2101%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)		
期末基金资产净值	9,844,976.41	299,766,617.93	1,104,105,168.58
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

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

华融现金增利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
过去一个月	0.1906%	0.0003%	0.1110%	0.0000%	0.0796%	0.0003%
过去三个月	0.5752%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.2386%	0.0004%
过去六个月	1.2096%	0.0006%	0.6695%	0.0000%	0.5401%	0.0006%
过去一年	2.5716%	0.0010%	1.3500%	0.0000%	1.2216%	0.0010%
过去三年	9.9641%	0.0038%	4.0500%	0.0000%	5.9141%	0.0038%
自基金合同生效起至今	15.8885%	0.0044%	6.4652%	0.0000%	9.4233%	0.0044%

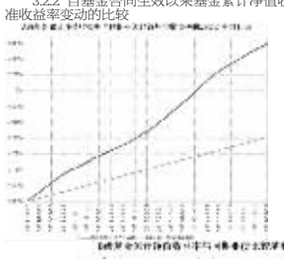
华融现金增利B

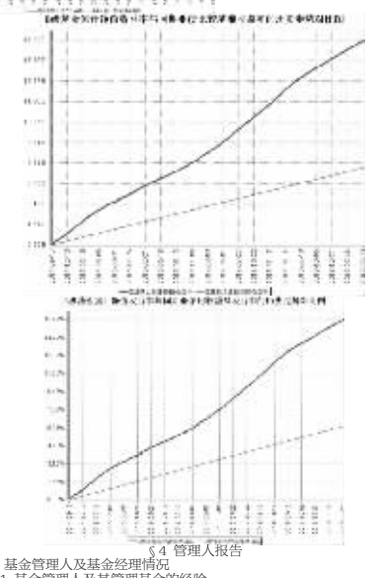
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2104%	0.0003%	0.1110%	0.0000%	0.0994%	0.0003%
过去三个月	0.6355%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.2989%	0.0004%
过去六个月	1.3304%	0.0006%	0.6695%	0.0000%	0.6609%	0.0006%
过去一年	2.8188%	0.0010%	1.3500%	0.0000%	1.4688%	0.0010%
过去三年	10.6285%	0.0038%	4.0500%	0.0000%	6.5785%	0.0038%
自基金合同生效起至今	17.0895%	0.0044%	6.4652%	0.0000%	10.6243%	0.0044%

华融现金增利C

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	0.1906%	0.0003%	0.1110%	0.0000%	0.0796%	0.0003%
过去三个月	0.5753%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.2387%	0.0004%
过去六个月	1.2101%	0.0006%	0.6695%	0.0000%	0.5406%	0.0006%
过去一年	2.5725%	0.0010%	1.3500%	0.0000%	1.2225%	0.0010%
过去三年	9.8674%	0.0038%	4.0500%	0.0000%	5.8174%	0.0038%
自基金合同生效起至今	15.7825%	0.0044%	6.4652%	0.0000%	9.3173%	0.0044%

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





§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

华融证券股份有限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作为主发起人设立的全国性综合证券公司。2007年9月在北京正式挂牌成立。目前,公司注册资本58.41亿元,总部设在北京,下设16家分公司、65家营业部,旗下拥有华融期货有限责任公司、华融瑞泽投资管理有限公司,在雄安注册首家公募基金子公司(筹)。

公司坚持以服务实体经济为使命,回归主责主业,持续加强“投行、投资、交易、风控和财富管理”五大核心能力建设,目前已经初步形成了以全品种、全链条的资本中介型服务为引领的轻资产运营模式, 以提升投资能力为核心竞争力的重资产运营模式,构建了包括“投行、资管、财富管理、自营投资、公募基金和私募股权基金”在内的较为全面的业务布局,同时拥有股票质押、代销金融产品、新三板、股票期权等多项重要业务资格,形成了较为健全的牌照体系,主动管理资产规模始终保持在行业前列。2018年公司荣获中国区十大创新项目君鼎奖、中国理财服务先锋、银行间本币市场交易300强等荣誉。

华融证券将贯彻落实党的十九大精神,聚焦金融工作“三大任务”,积极参与供给侧结构性改革等国家战略部署,助力实体经济发展,用专业为客户创造价值。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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		
桑劲乔	本基金的基金经理	2016年12月6日	–	6	桑劲乔,男,金融硕士。2012年11月加入华融证券股份有限公司,从事证券研究分析、证券交易工作。曾先后担任固定收益投资部交易员、投资经理。2016年12月至今,任华融现金增利货币基金经理。

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,本基金管理人严格按照《证券法》《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

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

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》和公司内部公平交易制度,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进,确保公平交易原则的实现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

为了抵御经济下行的压力,年初的货币政策比较积极,财政政策比较积极。央行1月份分两次累计下调存款准备金率100个基点, 公开市场也通过逆回购、MLF等方式进行流动性投放。信贷及社融的大力刺激,叠加地方政府债提前发行、减税降幅等因素的影响,基本面出现了一些企稳的迹象,生产开始加快,需求有所复苏。但进入2季度以来,随着货币政策的边际收紧,叠加贸易战等因素的影响,基本面重新步入下行通道。工业增加值增速开始放缓, 基建投资增速始终维持在5%以下,PM1跌破荣枯线。受到包商银行托管事件的影响,为了防止风险在同业之间进一步传染,监管当局采取了一系列稳定市场信心的措施,央行不断进行流动性投放,流动性十分宽松,隔夜价格跌破1%。

流动性管理是本基金最重要的功能, 在保证流动性充裕以及资产安全性的基础上,本基金将尽可能的提高组合的收益率。报告期内,本基金以同业存单、短期存款以及短期逆回购为主要配置资产。根据负债端申赎及资产端利率的变化规律,灵活的安排组合的杠杆率及剩余期限。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期华融现金增利A的基金份额净值收益率为1.2096%,本报告期华融现金增利B的基金份额净值收益率为1.3304%,本报告期华融现金增利C的基金份额净值收益率为1.2101%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

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年下半年,在外需走弱内需放缓的大背景下,经济基本面仍有下行的压力。通胀中枢上移属结构性因素所致,扣除食品和能源的核心CPI仍有进一步下行的压力。受地方隐性债务严监管的影响,基建投资增速难以大幅回升,难以有效冲制造业投资下行的压力。

逆周期调节对于2019年下半年的中国经济仍然重要。上半年澳大利亚、新西兰等国已经率先实施了降息,美联储下半年降息预期较强,中美利差重新走阔,为国内进行流动性宽松打开了空间。货币政策方面, 预测央行会进行定性降准、TMLF等操作,继续实现宽货币向宽信用的转化。

2019年下半年,本基金将持续关注中美贸易谈判、通胀、内需、外需等多方面因素的影响,在同业存单、短期逆回购、短期融资券等多种工具之间实现合理配置,力争为投资者实现稳定的回报。为有效预防信用分层来带的负面影响,本基金将严控信用风险,回避中低等级的同业存单及短期融资券。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布,月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。本基金管理人设立估值委员会,负责研究、指导基金估值业务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书等有关规定, 本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人,当日收益参与下一日的收益分配,并定期支付且结转为相应的基金份额。

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

报告期内, 本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对华融现金增利货币市场基金2019年上半年的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,履行了托管人的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为, 华融证券股份有限公司在华融现金增利货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,华融证券股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》 及其他相关法律法规的规定, 基金管理人所编制和披露的2019年半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:华融现金增利货币市场基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:			
银行存款		74,474,608.32	195,114,650.22
结算备付金		4,582,169.94	7,791,283.56
存出保证金		33,790.12	55,440.13
交易性金融资产		1,015,674,680.43	655,459,397.79
其中:股票投资		–	–
基金投资		–	–
债券投资		1,015,674,680.43	655,459,397.79
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		317,800,370.70	110,000,000.00
应收证券清算款		27,611.50	–
应收利息		2,559,215.60	1,670,738.48
应收股利		–	–
应收申购款		6,260.84	20,000.00
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		1,415,158,707.45	970,111,510.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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		–	–
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		–	–
应付管理人报酬		360,664.72	321,898.11
应付托管费		120,221.60	107,299.37
应付销售服务费		798,413.96	806,889.57
应付交易费用		25,748.16	133,109.36
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		136,896.09	170,000.00
负债合计		1,441,944.53	1,539,196.41
所有者权益:			
实收基金		1,413,716,762.92	968,572,313.77
未分配利润		–	–
所有者权益合计		1,413,716,762.92	968,572,313.77
负债和所有者权益总计		1,415,158,707.45	970,111,510.18

6.2 利润表

会计主体:华融现金增利货币市场基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		22,065,910.45	55,482,945.56
1.利息收入		21,819,638.14	54,169,955.87
其中:存款利息收入		6,177,807.98	18,281,874.65
债券利息收入		11,198,564.90	34,791,368.10
资产支持证券利息收入		–	3,717.45
买入返售金融资产收入		4,443,265.26	1,092,995.67
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以“-”填列)		246,272.31	1,312,989.69
其中:股票投资收益		–	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益		246,272.31	1,312,989.69
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
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		4,956,394.85	8,845,724.69
1. 管理人报酬		2,094,994.80	3,449,091.33
2. 托管费		698,331.61	1,149,697.13
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	1,480,535.57	1,673,544.22
4. 交易费用		510.61	–
5. 利息支出		558,954.19	2,418,142.12
其中:卖出回购金融资产支出		558,954.19	2,418,142.12
6. 其他费用		123,068.07	139,782.70
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		17,109,515.60	46,637,220.87
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		17,109,515.60	46,637,220.87

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华融现金增利货币市场基金

本报告期:2019年1月1日 至 2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	968,572,313.77	–	968,572,313.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	17,109,515.60	17,109,515.60
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)	445,144,449.15	–	445,144,449.15
其中:1.基金申购款	10,051,594,299.19	–	10,051,594,299.19
2.基金赎回款	-9,606,449,850.04	–	-9,606,449,850.04
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)	–	-17,109,515.60	-17,109,515.60
五、期末所有者权益(基金净值)	1,413,716,762.92	–	1,413,716,762.92
项目	上年度可比期间 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)	2,872,379,055.81	–	2,872,379,055.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	46,652,688.06	46,652,688.06
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)	-2,005,329,440.81	–	-2,005,329,440.81
其中:1.基金申购款	12,516,346,880.17	–	12,516,346,880.17
2.基金赎回款	-14,521,676,320.98	–	-14,521,676,320.98
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)	–	-46,637,220.87	-46,637,220.87
五、期末所有者权益(基金净值)	867,049,615.00	15,467.19	867,065,082.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 – 至 – 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华融现金增利货币市场基金(以下简称“本基金”)于2014年8月19日经中国证监会(证监许可[2014]867号文)核准,由华融证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华融现金增利货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金, 存续期限不定, 首次设立募集共募集人民币202,185,899.44元,已经立信会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具信会师报字[2014]第724056号验资报告。经向中国证监会备案,《华融现金增利货币市场基金基金合同》于2014年9月16日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为202,185,899.44份基金份额,其中认购资金利息折合3,729.13份基金份额。本基金的基金管理人为华融证券股份有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《华融现金增利货币市场基金招募说明书》和《华融现金增利货币市场基金基金合同》,本基金设A 类、B 类、C类三类基金份额,分别设置基金代码,不同级别的基金份额适用不同费率的销售服务费。A类基金份额指投资人使用非证券资金账户资金认、申购基金资产净值小于300万元的份额类别;B类基金份额指投资人使用非证券资金账户资金认、申购大于(含)300万元的份额类别;C类基金份额指投资人使用证券资金账户资金认、申购本基金,并按照0.35%年费率计提增值服务费 (仅向选择接受增值服务并与销售机构签署增值服务协议的投资人收取)、0.25%年费率计提销售服务费的基金份额类别。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《华融现金增利货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括:现金,通知存款,短期融资券,剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据,期限在一年以内(含一年)的银行定期存款与大额存单,剩余期限在一年以内(含一年)的中央银行票据与债券回购,剩余期限在397天以内(含397天)的债券,剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券,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货币市场工具。如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)并参考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》的规定而编制。本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

–

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

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税收优惠项目列示如下:

1、以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不缴纳营业税。

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入、债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

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

本基金本报告期不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。

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
华融证券股份有限公司	基金管理人、注册登记与过户机构、销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人
中国华融资产管理股份有限公司	基金管理人的控股股东
华融瑞泽投资有限公司	基金管理人的控股子公司
华融期货有限责任公司	基金管理人的控股子公司

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金未有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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

注:本基金于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 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例

注:本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

注:本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,094,994.80	3,449,091.33
其中:支付销售机构的客户维护费	1,746,230.70	981,104.91

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	698,331.61	1,149,697.13

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 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			
	华融现金增利A	华融现金增利B	华融现金增利C	合计
华融证券股份有限公司	1,294.35	11,003.09	1,455,192.35	1,467,489.79
合计	–	–	–	–
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	华融现金增利A	华融现金增利B	华融现金增利C	合计
华融证券股份有限公司	24,994.89	49,277.76	1,599,271.57	1,673,544.22
合计	–	–	–	–

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

单位:人民币元

本期 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
中信银行股份有限公司	48,997,218.08	–	–	–	–	–
上年度可比期间 2018年1月1日至2018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

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 2019年1月1日至2019年6月30日		
	华融现金增利A	华融现金增利B	华融现金增利C
基金合同生效日(2014年9月16日)持有的基金份额	–	–	–
期初持有的基金份额	–	–	–
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	–	–	–
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	–	–	–

项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	华融现金增利A	华融现金增利B	华融现金增利C
基金合同生效日(2014年9月16日)持有的基金份额	–	–	–
期初持有的基金份额	–	–	–
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	–	–	–
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	–	–	–

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

华融现金增利A

份额单位:份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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

华融现金增利B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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
华融资产管理有限公司	69,365,401.53	4.9066%	68,444,349.83	7.0700%

华融现金增利C

份额单位:份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
中信银行股份有限公司	4,474,608.32	636,815.88	4,143,790.10	208,162.64

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2019年1月1日至2019年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

–

6.4.9 期末(2019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

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别:股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

6.4.9.1.2 受限证券类别:债券									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

6.4.9.1.3 受限证券类别:权证									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

注:本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

–

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
合计				–	–

–

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

–

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

–

§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 |