

华融现金增利货币市场基金

[2015] 第四季度报告

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
报告送出日期：2016年1月21日

§ 1 基本情况

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等，保证复核结果不存在虚假记载、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。

§ 2 主要财务指标

报告期利润 2015年10月1日起至12月31日止。

§ 3 基本产品概况

基金简称 华融现金增利货币市场基金

交易代码 000795

基金运作方式 约定定期开放式

基金合同生效日 2014年9月17日

报告期末基金份额总额 210,322,430.02份

投资目标 花旗银行股份有限公司，附属基金货币市场的份额，力求在对宏观经济、货币政策及行业走势的简要展望

在对宏观经济、货币政策及行业走势的简要展望的基础上，科学合理地安排资产配置比例并优化投资范围内

的风险与收益，从而实现基金资产的保值增值。

风险收益特征 低风险、低收益

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

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

下属分级基金的基金内码 - - -

下属分级基金的交易代码 000795 000796 000797

报告期末下属分级基金的份额总额 16,140,220.72份 196,243,001.67份 8,938,407.63份

§ 4 主要财务指标和基金净值表现

报告期(2015年10月1日—2015年12月31日)

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年10月1日—2015年12月31日)

华融现金增利A 华融现金增利B 华融现金增利C

1. 本期已实现收益 43,399.42 1,410,266.24 78,290.35

2. 本期利润 43,399.42 1,410,266.24 78,290.35

3. 期末基金资产净值 15,140,220.72 196,243,001.67 8,938,407.63

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)和期间相关费用后的余额，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2.1 本基金报告期内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 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.67% 0.01% 0.34% 0.00% 0.33% 0.01%

注：本基金定期报告中数据截至日折算份额。

华融现金增利B

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.73% 0.01% 0.34% 0.00% 0.39% 0.01%

注：本基金定期报告中数据截至日折算份额。

华融现金增利C

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.67% 0.01% 0.34% 0.00% 0.33% 0.01%

注：本基金定期报告中数据截至日折算份额。

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

华融现金增利货币市场基金成立以来净值增长率走势图

华融现金增利货币市场基金成立以来净值增长率与业绩比较基准收益率走势图

注：按基金合同规定，本基金基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 离任日期 离任原因

轩玉婷 本基金的基金经理 2016年7月27日 - 7 因个人原因辞职

注：1.此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。
2.证券业协会通过行业自律协会、证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作合规性的说明

本基金报告期内，基金管理人遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基本合同，基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以诚信、谨慎、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取最大利益。在本基金报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

本基金管理人主要通过对建立和完善规范的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资决策委员会制度和集中交易风险管理，并重视交易执行环节的公平交易政策，以“时间优先、价格优先”作为公平交易的基本原则，通过设置交易系统的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。

4.4 公平交易交易行为的专项说明

本基金管理人对旗下所有基金的公平交易制度和执行情况进行定期评估，形成了书面的评估报告。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内未出现能够导致不公平交易的情形。

4.6 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内基金的业绩表现符合基金合同的规定。

4.7 投资组合报告

本基金报告期内无投资组合。

4.8 管理人对宏观经济、行业及市场走势的简要展望

本基金管理人对宏观经济、行业及市场走势的简要展望。

4.9 备查文件目录

华融现金增利货币市场基金向中国证监会提交的募集文件；

《华融现金增利货币市场基金托管协议》；

《华融现金增利货币市场基金费率协议》；

《华融现金增利货币市场基金招募说明书》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议二》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议三》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议四》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议五》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议六》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议七》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议八》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议九》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议十》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议十一》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议十二》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议十三》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议十四》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议十五》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议十六》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议十七》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议十八》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议十九》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议二十》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议二十一》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议二十二》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议二十三》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议二十四》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议二十五》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议二十六》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议二十七》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议二十八》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议二十九》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议三十》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议三十一》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议三十二》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议三十三》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议三十四》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议三十五》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议三十六》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议三十七》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议三十八》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议三十九》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议四十》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议四十一》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议四十二》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议四十三》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议四十四》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议四十五》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议四十六》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议四十七》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议四十八》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议四十九》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议五十》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议五十一》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议五十二》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议五十三》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议五十四》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议五十五》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议五十六》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议五十七》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议五十八》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议五十九》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议六十》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议六十一》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议六十二》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议六十三》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议六十四》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议六十五》；

《华融现金增利货币市场基金基金合同之补充协议六十六》；