华融现金增利货币市场基金 2016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:2017年3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 2017年3月23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。

本报告中的财务资料经审计,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,请投资者注意阅读。

本报告期自 2016年1月1日起至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,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华融现金增利货币市场基金		
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	366,142,415.84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
下属分级基金的场内简称:	-	-	-
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	12,257,847.86份	349,316,673.18份	4,567,894.80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	肖琦	方韡
	联系电话	010-85556728	4006800000
	电子邮箱	xiaoqi@hrsec.com.cn	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		400-818-9999	95558
传真		010-85556692	010-85230024

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fundhrsec.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、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	2016年			2015年			2014年9月16日(基金合同生效日)-2014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	华融现金增利A	华融现金增利B	华融现金增利C	华融现金增利A	华融现金增利B	华融现金增利C
本期已实现收益	180,446.86	6,650,537.73	261,152.97	401,953.39	10,696,792.65	1,135,991.52	347,831.29	1,727,675.53	385,780.93
本期利润	180,446.86	6,650,537.73	261,152.97	401,953.39	10,696,792.65	1,135,991.52	347,831.29	1,727,675.53	385,780.93
本期净值收益率	2.44%	2.69%	2.44%	3.10%	3.35%	3.10%	1.11%	1.18%	1.10%
3.1.2期末数据和指标	2016年末			2015年末			2014年末		
期末基金资产净值	12,257,847.86	349,316,673.18	4,567,894.80	15,140,220.72	195,243,801.67	8,938,407.63	22,818,550.70	179,238,830.23	10,353,335.36
期末基金份额净值	1	1	1	1	1	1	1	1	1
3.1.3累计期末指标	2016年末			2015年末			2014年末		
累计净值收益率	6.78%	7.37%	6.78%	4.24%	4.56%	4.23%	1.11%	1.18%	1.10%

金额单位:人民币元

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。本基金利润分配是按日结转份额。

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
过去三个月	0.75%	0.01%	0.34%	0.00%	0.41%	0.01%
过去六个月	1.32%	0.01%	0.68%	0.00%	0.64%	0.01%
过去一年	2.44%	0.00%	1.35%	0.00%	1.09%	0.00%
自基金合同生效起至今	6.78%	0.01%	3.10%	0.00%	3.68%	0.01%

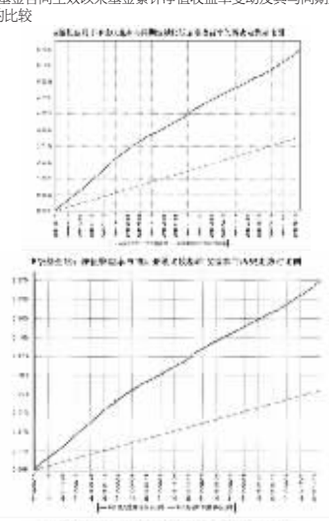
华融现金增利B

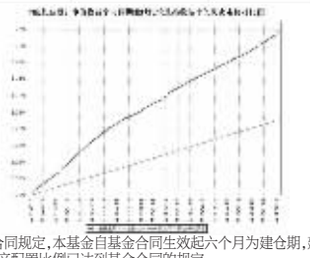
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.81%	0.01%	0.34%	0.00%	0.47%	0.01%
过去六个月	1.44%	0.01%	0.68%	0.00%	0.76%	0.01%
过去一年	2.69%	0.00%	1.35%	0.00%	1.33%	0.00%
自基金合同生效起至今	7.37%	0.01%	3.10%	0.00%	4.27%	0.01%

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
过去三个月	0.75%	0.01%	0.34%	0.00%	0.41%	0.01%
过去六个月	1.32%	0.01%	0.68%	0.00%	0.64%	0.01%
过去一年	2.44%	0.00%	1.35%	0.00%	1.08%	0.00%
自基金合同生效起至今	6.78%	0.01%	3.10%	0.00%	3.68%	0.01%

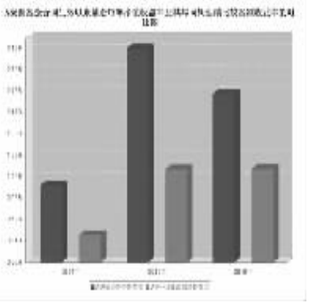
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

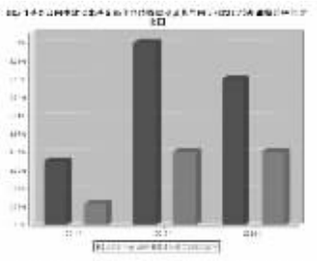


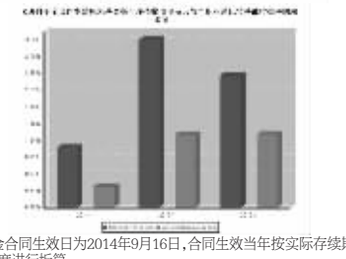


注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较







注:本基金合同生效日为2014年9月16日,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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

华融现金增利A					
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
2014年	347,831.29	-	-	347,831.29	
2015年	401,953.39	-	-	401,953.39	
2016年	180,446.86	-	-	180,446.86	
合计	930,231.54	-	-	930,231.54	注:-
华融现金增利B					
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
2014	1,727,675.53	-	-	1,727,675.53	
2015	10,696,792.65	-	-	10,696,792.65	
2016	6,650,537.73	-	-	6,650,537.73	
合计	19,075,005.91	-	-	19,075,005.91	注:-
华融现金增利C					
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
2014	385,780.93	-	-	385,780.93	
2015	1,135,991.52	-	-	1,135,991.52	
2016	261,152.97	-	-	261,152.97	
合计	1,782,925.42	-	-	1,782,925.42	注:-

§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(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")作为主发起人,联合中国葛洲坝集团有限公司共同发起设立的全国性证券公司。2007年9月,公司在北京正式挂牌成立。目前,公司注册资本51.42亿元,其中:中国华融出资42.04亿元,中国葛洲坝集团有限公司、中国葛洲坝集团股份有限公司、深圳市科铭实业有限公司、北京纽森特投资有限公司、九江和汇进出口有限公司、星星集团有限公司、浙江金财控股集团有限公司、广州南雅房地产开发有限公司、吉林昊融集团股份有限公司、北京双融福泰投资有限公司、张家港市中达针织服饰制造有限公司、北京立磐国际贸易有限公司等12家股东共出资9.38亿元。公司的注册地址:北京市西城区金融大街8号。

公司总部设在北京,下设深圳总部、上海总部,北京、上海、深圳、湖南、新疆、湖北、陕西、贵州、四川、江西、海南、浙江、山东、福建、辽宁、广东等16家分公司,66家营业部,控股华融期货有限责任公司与华融瑞泽投资管理有限公司。公司紧紧依托中国华融在资产管理、银行、信托和金融租赁等方面的综合优势,可为客户提供证券经纪、融资融券、证券承销与保荐、与证券交易及证券投资活动有关的财务顾问、证券投资咨询、证券自营、证券资产管理、投资顾问等综合化的财富管理服务。公司2011-2016年连续六年被中国证监会评为A类A级券商,2015年被中国证监会评为A类AA级券商。2009年、2011年两次获评为"首都文明单位",2014年获评"首都精神文明建设标兵单位",荣获2014年最佳资产管理券商,2015年公司荣获中国债券市场优秀成员及债券业务进步奖第一名,"中国新三板最具投资眼光券商",2016年荣获中国最佳财富管理品牌,最具创新性的证券资产管理公司等奖项。

公司坚持以市场为导向,以客户为中心,以诚信、专业、稳健、共赢为经营宗旨,在社会各界和投资者的大力支持下,努力打造一家有尊严、有价值、有内涵、有实力、有责任的"五有"现代一流投资银行!

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		
赵亮	本基金的基金经理	2013年8月1日	2016年12月15日	4	赵亮,博士研究生毕业。具有超过三年时间从事证券研究和投资管理等方面的工作经历。2012年7月到2013年8月在华融证券股份有限公司市场研究部,任职研究员;从事证券研究分析工作;2013年8月至今在华融证券基金业务部,任职投资经理,从事固定收益类投研工作。
桑劲乔	本基金的基金经理	2016年12月6日	-	4	桑劲乔,男,硕士研究生。2012年11月进入华融证券股份有限公司以来先后从事证券研究分析、证券交易的工作,曾先后担任固定收益投资部交易员、投资经理。

注:本基金于2016年12月6日增聘桑劲乔为华融现金增利货币市场基金的基金经理。 赵亮于

2016年12月15日解聘本基金的基金经理一职。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华融证券股份有限公司基金管理业务公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2016年全年,受外汇占款下降、金融去杠杆、中美利差中枢下移等因素影响,货币市场收益率整体呈现出缓慢抬升的趋势,在货币政策执行方面,央行一直坚持稳健中性的立场。本基金在流动性宽松的时期,会通过拉长资产久期、提高杠杆率的策略增厚持仓收益。在流动性紧张的时候,会通过增配线下协议存款、线上买入返售资产、同业存单来提高产品收益。同时,本基金也通过主动承担适度的信用风险来获取较高的收益,在个券投资中注重对信用风险的评估。

报告期内,本基金在做好流动性管理、控制好信用风险的基础上,坚持跨市场套利策略、久期策略、息差策略等投资策略,提高产品投资收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内A类基金份额净值收益率为2.4400%;B类基金份额净值收益率为2.6900%;C类基金份额净值收益率为2.4400%

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2017年,在宏观经济方面,由于受到原材料价格大幅上涨的影响,去年4季度生产者物价指数大幅提升,工业企业利润持续攀升,通胀预期仍然较高。但同时消费者物价指数并没有出现大幅攀升,反映出商品端的需求仍然不足,加上房地产泡沫可能破裂,中国经济在2017年的走势尚不明朗。在货币政策方面,受制于美联储加息、人民币贬值、内部去杠杆等因素的影响,资金面大概率会维持紧平衡的状态。在供给侧改革、金融市场去杠杆、监管趋严的大背景下,企业再融资风险增加,地产等行业融资链条收紧,信用风险或将有所暴露。

在人民币贬值压力加重、基本面不能提供支撑的背景下,2017年短期债券收益率以及银行存款利率将会面临更大的不确定性。我们将对2017年的债券市场保持谨慎的态度,应注意对"黑天鹅事件"及宏观风险的防范,做好流动性管理。投资以银行协议存款、同业存单为主,同时适度介入中短期利率债以及中高评级信用债,规避产能严重过剩、信用风险较高的行业。

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。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。

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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

4.9 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

本报告期,中信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

2014年度, 华融现金增利货币市场基金的管理人——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、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(17)第P00376号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华融现金增利货币市场基金全体持有人
引言段	我们审计了后附的华融现金增利货币市场基金(以下简称"贵基金")财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表和2016年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是贵基金管理人华融证券股份有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用的会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了华融现金增利货币市场基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	赵耀 杨丽
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路222号30楼
审计报告日期	2017年3月28日

§7 年度财务报表

7.1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: 2016年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产:			
银行存款		34,713,637.13	185,439,385.01
结算备付金		1,067,276.67	1,047,619.05
存出保证金		-	-
交易性金融资产		109,526,629.05	19,987,249.74
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		109,526,629.05	19,987,249.74
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		220,000,000.00	14,000,000.00
应收证券清算款		93,011.14	-
应收利息		1,135,342.62	354,384.93
应收股利		-	-
应收申购款		30,528.88	668,455.98
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		366,566,424.49	221,497,094.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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		-	1,997,916.67
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		109,108.86	53,389.93
应付托管费		36,369.61	17,796.67
应付销售服务费		76,235.18	4,761.42
应付交易费用		2,295.00	800.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		200,000.00	100,000.00
负债合计		424,008.65	2,174,664.69
所有者权益:			
实收基金		366,142,415.84	219,322,430.02
未分配利润		-	-
所有者权益合计		366,142,415.84	219,322,430.02
负债和所有者权益总计		366,566,424.49	221,497,094.71

注: 报告截止日2016年12月31日, 货币基金A级基金份额净值人民币1.0000元,基金份额总额12,257,847.86份;货币基金B级基金份额净值人民币1.0000元,基金份额总额349,316,673.18份; 货币基金C级基金份额净值人民币1.0000元,基金份额总额4,567,894.80份。

7.2 利润表

会计主体:华融现金增利货币市场基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		8,509,620.75	13,996,602.26
1.利息收入		8,396,477.39	13,534,897.56
其中:存款利息收入		3,350,312.65	10,256,688.27
债券利息收入		3,553,649.85	2,311,303.07
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,492,514.89	966,906.22
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		113,143.36	461,704.70
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		113,143.36	461,704.70
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		1,417,483.19	1,761,864.70
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	787,185.72	1,081,962.69
2. 托管费	7.4.8.2.2	262,395.18	360,654.28
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	71,473.76	153,841.26
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		36,895.75	-
其中:卖出回购金融资产支出		36,895.75	-
6. 其他费用		259,532.78	165,406.47
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		7,092,137.56	12,234,737.56
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		7,092,137.56	12,234,737.56

7.3 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:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	219,322,430.02	-	219,322,430.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	7,092,137.56	7,092,137.56
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)	146,819,985.82	-	146,819,985.82
其中:1.基金申购款	705,195,892.17	-	705,195,892.17
2.基金赎回款	-558,375,906.35	-	-558,375,906.35
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)	-	-7,092,137.56	-7,092,137.56
五、期末所有者权益(基金净值)	366,142,415.84	-	366,142,415.84
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	212,410,766.29	-	212,410,766.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	12,234,737.56	12,234,737.56
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)	6,911,663.73	-	6,911,663.73
其中:1.基金申购款	2,076,312,004.02	-	2,076,312,004.02
2.基金赎回款	-2,069,400,340.29	-	-2,069,400,340.29
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)	-	-12,234,737.56	-12,234,737.56
五、期末所有者权益(基金净值)	219,322,430.02	-	219,322,430.02

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:

_____祝献忠_____ _____杨铭海_____ _____董维____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 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2016年12月31日的财务状况以及2016年1月1日至2016年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

-

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估计变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 关联方关系

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

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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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
华融证券	2,086,900,000.00	100.00%	14,000,000.00	100.00%

7.4.8.1.4 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31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 2015年1月1日至2015年12月31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

注:本基金本报告期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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	787,185.72	1,081,962.69
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	262,395.18	360,654.28

7.4.8.2.3 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 2016年1月1日至2016年12月31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	18,734.63	24,354.83	28,384.30	71,473.76
合计	18,734.63	24,354.83	28,384.30	71,473.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	30,037.54	31,158.07	92,645.65	153,841.26
合计	30,037.54	31,158.07	92,645.65	153,841.26

注:本基金C类基金份额的年销售服务费率为0.25%。本基金A