

# 华融现金增利货币市场基金

## 2017年第三季度报告

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的研究研究决策流程、交易流程,以及强化事前风控手段确保公平对待不同投资组合,切勿利益输送。本基金管理人建立了严格的投后跟踪管理流程,投资组合管理过程中严格执行交易纪律,并重视交易执行中的公平交易措施,以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.2 异常交易行为的专项说明  
报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.3 报告期内基金投资策略和运作分析  
2017年第三季度除月中下旬以外,货币市场收益率基本保持平稳。本基金各子账户收益率总体呈上升趋势,流动性管理仍为本基金最重要的功能。在保持流动性以及安全性的基础上,尽可能的提高收益率。本基金资产组合的剩余期限控制在2-3个月,25%左右的资产投资于同业存款,35%左右的资产投资于信用良好、流动性较好的银行同业存单,10%左右的资产投资于高等级短久期国债,20%左右的资产投资于短期利率债,10%左右的资产投资于国债、政策性金融债。

4.4 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0.9493%,本报告期华融现金增利B的基金份额净值收益率为1.0113%,本报告期华融现金增利C的基金份额净值收益率为0.9510%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.5 报告期内基金的投资组合报告  
本报告期华融现金增利A的基金份额净值收益率为0.9493%,本报告期华融现金增利B的基金份额净值收益率为1.0113%,本报告期华融现金增利C的基金份额净值收益率为0.9510%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明  
截至本报告期末,本基金未出现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况。

5. 投资组合报告  
5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,343,149,626.89	92.10
	其中:债券	1,302,482,626.89	90.52
	资产支持证券	40,667,000.00	2.58
2	买入返售金融资产	528,121,193.23	20.51
	其中:买入返售金融资产中的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	697,700,857.57	27.06
4	其他资产	9,447,748.06	0.33
5	合计	2,578,179,426.75	100.00

5.2 报告期末债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	0.11
	其中:逆回购融资余额	-

5.3 报告期末基金资产组合公允价值(元)

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	固定收益投资	1,343,149,626.89	92.10
2	买入返售金融资产	528,121,193.23	20.51
3	银行存款和结算备付金合计	697,700,857.57	27.06
4	其他资产	9,447,748.06	0.33
5	合计	2,578,179,426.75	100.00

5.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,793,110.00	0.44
C	制造业	10,692,546.00	26.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,319,000.00	3.27
F	批发和零售业	644,000.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	34,510.00	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	429,200.00	1.06
J	金融业	629,600.00	1.56
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	448,160.00	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生健康工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	15,898,120.00	39.30

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603993	华测检测	150,000	1,176,000.00	2.91
2	300088	中顺洁柔	20,000	971,800.00	2.41
3	603799	华纳实业	10,000	914,700.00	2.27
4	600477	航新航空	70,000	898,800.00	2.23
5	002168	爱康医疗	44,000	850,560.00	2.11
6	002938	宏达新材	19,000	772,540.00	1.91
7	002273	美的集团	30,000	796,200.00	1.97
8	601603	横源科技	90,000	673,200.00	1.67
9	600699	招商局	120,000	629,600.00	1.58
10	601881	中国国航	40,000	629,600.00	1.56

5.6 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	16,898,120.00	39.13
2	基金投资	16,898,120.00	39.13
3	固定收益投资	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	989,763.89	2.24
7	银行存款和结算备付金合计	6,343,360.03	15.20
8	其他资产	989,763.89	2.24
9	合计	41,229,248.81	100.00

5.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	62,856,616.54	33.78
C	制造业	62,856,616.54	33.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,468,500.00	0.79
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,391,700.00	1.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	4,223,000.00	2.27
J	金融业	29,209,464.00	15.70
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	684,600.00	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生健康工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,313,444.46	0.71
S	综合	-	-
	合计	112,170,827.23	60.27

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601898	工商银行	2,600,000	16,140,000.00	8.67
2	000569	工商银行	112,300	6,432,540.00	3.46
3	002076	中航证券	94,128	5,641,014.00	3.03
4	600030	中信证券	209,100	3,893,520.00	2.14
5	601766	兴业银行	300,000	3,406,500.00	1.83
6	601166	兴业银行	160,000	2,766,400.00	1.49
7	600718	东兴证券	140,000	2,398,400.00	1.28
8	000619	烟台台	4,000	2,070,560.00	1.11
9	000638	云南铜业	21,600	1,909,120.00	1.06
10	000638	云南铜业	38,196	1,790,431.24	0.96

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,982,000.00	5.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
9	合计	9,982,000.00	5.36

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170003	17国债03	100,000	9,982,000.00	5.36

5.11 报告期末按行业分类的债券投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	62,856,616.54	33.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,468,500.00	0.79
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,391,700.00	1.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	4,223,000.00	2.27
J	金融业	29,209,464.00	15.70
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	684,600.00	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生健康工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,313,444.46	0.71
S	综合	-	-
	合计	112,170,827.23	60.27

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601898	工商银行	2,600,000	16,140,000.00	8.67
2	000569	工商银行	112,300	6,432,540.00	3.46
3	002076	中航证券	94,128	5,641,014.00	3.03
4	600030	中信证券	209,100	3,893,520.00	2.14
5	601766	兴业银行	300,000	3,406,500.00	1.83
6	601166	兴业银行	160,000	2,766,400.00	1.49
7	600718	东兴证券	140,000	2,398,400.00	1.28
8	000619	烟台台	4,000	2,070,560.00	1.11
9	000638	云南铜业	21,600	1,909,120.00	1.06
10	000638	云南铜业	38,196	1,790,431.24	0.96

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,982,000.00	5.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
9	合计	9,982,000.00	5.36

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170003	17国债03	100,000	9,982,000.00	5.36

5.15 报告期末按行业分类的债券投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	62,856,616.54	33.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,468,500.00	0.79
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,391,700.00	1.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	4,223,000.00	2.27
J	金融业	29,209,464.00	15.70
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	684,600.00	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生健康工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,313,444.46	0.71
S	综合	-	-
	合计	112,170,827.23	60.27

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601898	工商银行	2,600,000	16,140,000.00	8.67
2	000569	工商银行	112,300	6,432,540.00	3.46
3	002076	中航证券	94,128	5,641,014.00	3.03
4	600030	中信证券	209,100	3,893,520.00	2.14
5	601766	兴业银行	300,000	3,406,500.00	1.83
6	601166	兴业银行	160,000	2,766,400.00	1.49
7	600718	东兴证券	140,000	2,398,400.00	1.28
8	000619	烟台台	4,000	2,070,560.00	1.11
9	000638	云南铜业	21,600	1,909,120.00	1.06
10	000638	云南铜业	38,196	1,790,431.24	0.96

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,982,000.00	5.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
9	合计	9,982,000.00	5.36

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细