

华融现金增利货币市场基金 2016 年半年度 报告 摘要

2016 年 6 月 30 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

送出日期：2016 年 8 月 27 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 2016 年 8 月 17 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核。

本报告期自 2016 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		
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	234,617,971.10 份		
基金合同存续期	不定期		
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	6,537,294.23 份	217,672,153.50 份	10,408,523.37 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	姓名	肖琦	方韡

人	联系电话	010-85556728	010-89936330
	电子邮箱	xiaoqio@hrsec.com.cn	fangwei@citicbank.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(2016年1月1日 - 2016年6月30日)	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	92,968.91	2,428,351.83	144,297.19
本期利润	92,968.91	2,428,351.83	144,297.19
本期净值收益率	1.10%	1.22%	1.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)		
期末基金资产净值	6,537,294.23	217,672,153.50	10,408,523.37
期末基金份额净值	1	1	1

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	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标	①-③	②-④
----	----------	----------	----------	------------	-----	-----

		准差②	率③	准差④		
过去一个月	0.18%	0.00%	0.11%	0.00%	0.07%	0.00%
过去三个月	0.53%	0.00%	0.34%	0.00%	0.19%	0.00%
过去六个月	1.10%	0.00%	0.67%	0.00%	0.43%	0.00%
过去一年	2.41%	0.01%	1.35%	0.00%	1.06%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.39%	0.01%	2.42%	0.00%	2.97%	0.01%

华融现金增利 B

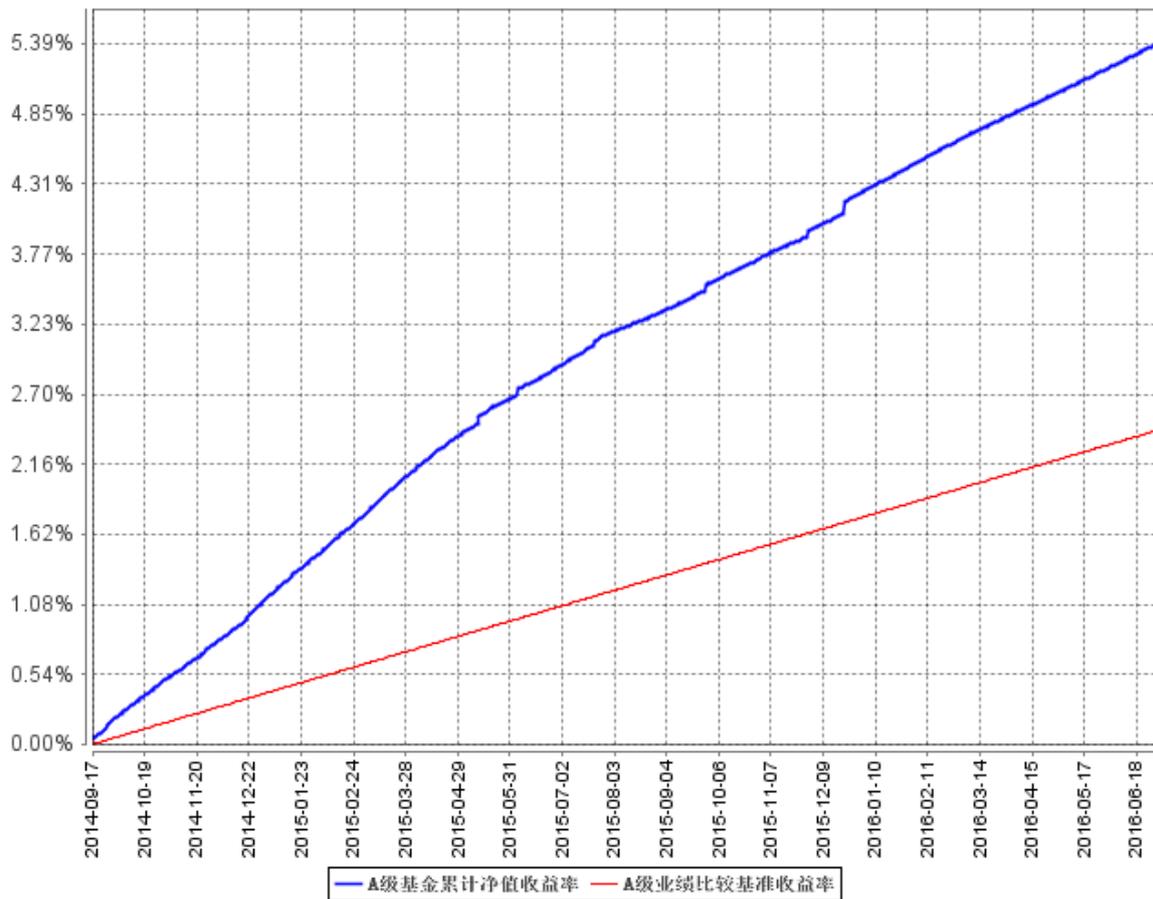
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.20%	0.00%	0.11%	0.00%	0.09%	0.00%
过去三个月	0.59%	0.00%	0.34%	0.00%	0.25%	0.00%
过去六个月	1.22%	0.00%	0.67%	0.00%	0.55%	0.00%
过去一年	2.66%	0.01%	1.35%	0.00%	1.30%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.84%	0.01%	2.42%	0.00%	3.42%	0.01%

华融现金增利 C

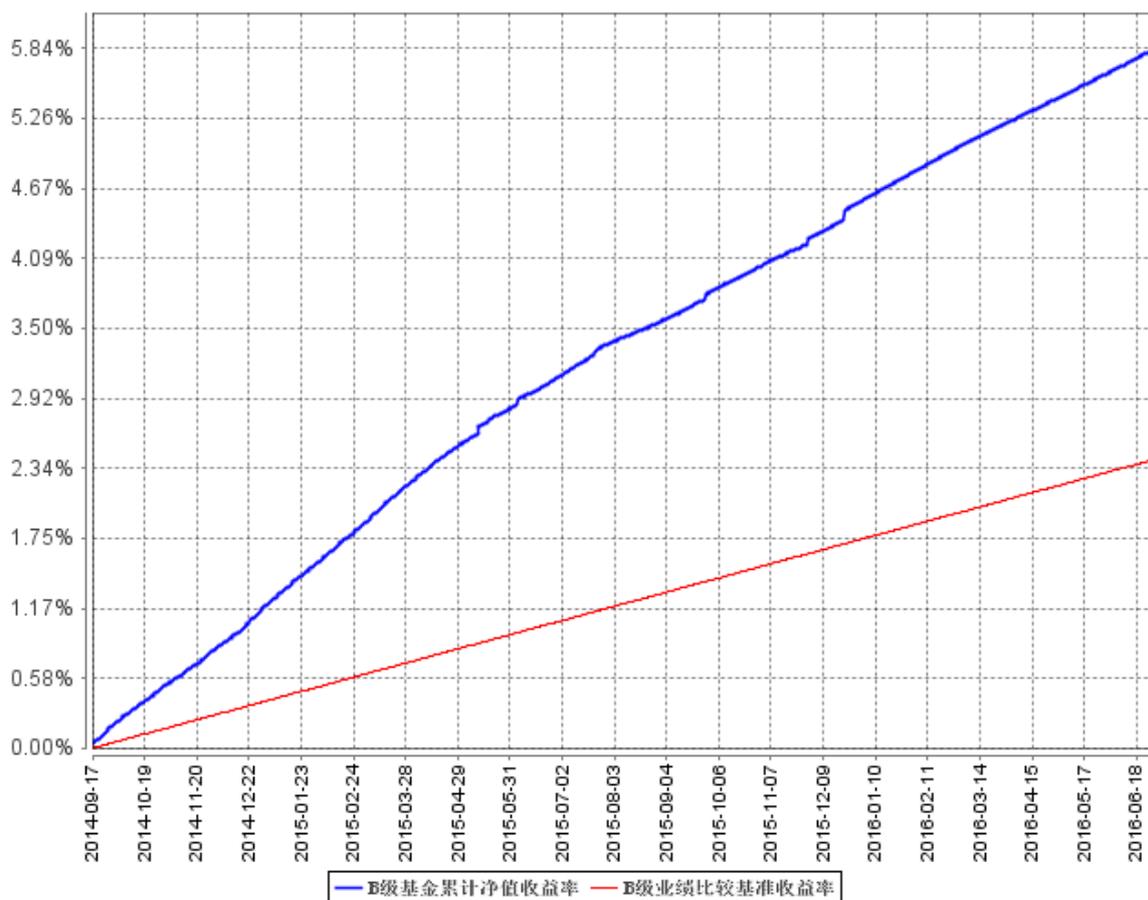
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.18%	0.00%	0.11%	0.00%	0.07%	0.00%
过去三个月	0.53%	0.00%	0.34%	0.00%	0.19%	0.00%
过去六个月	1.10%	0.00%	0.67%	0.00%	0.43%	0.00%
过去一年	2.41%	0.01%	1.35%	0.00%	1.05%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.38%	0.01%	2.42%	0.00%	2.96%	0.01%

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

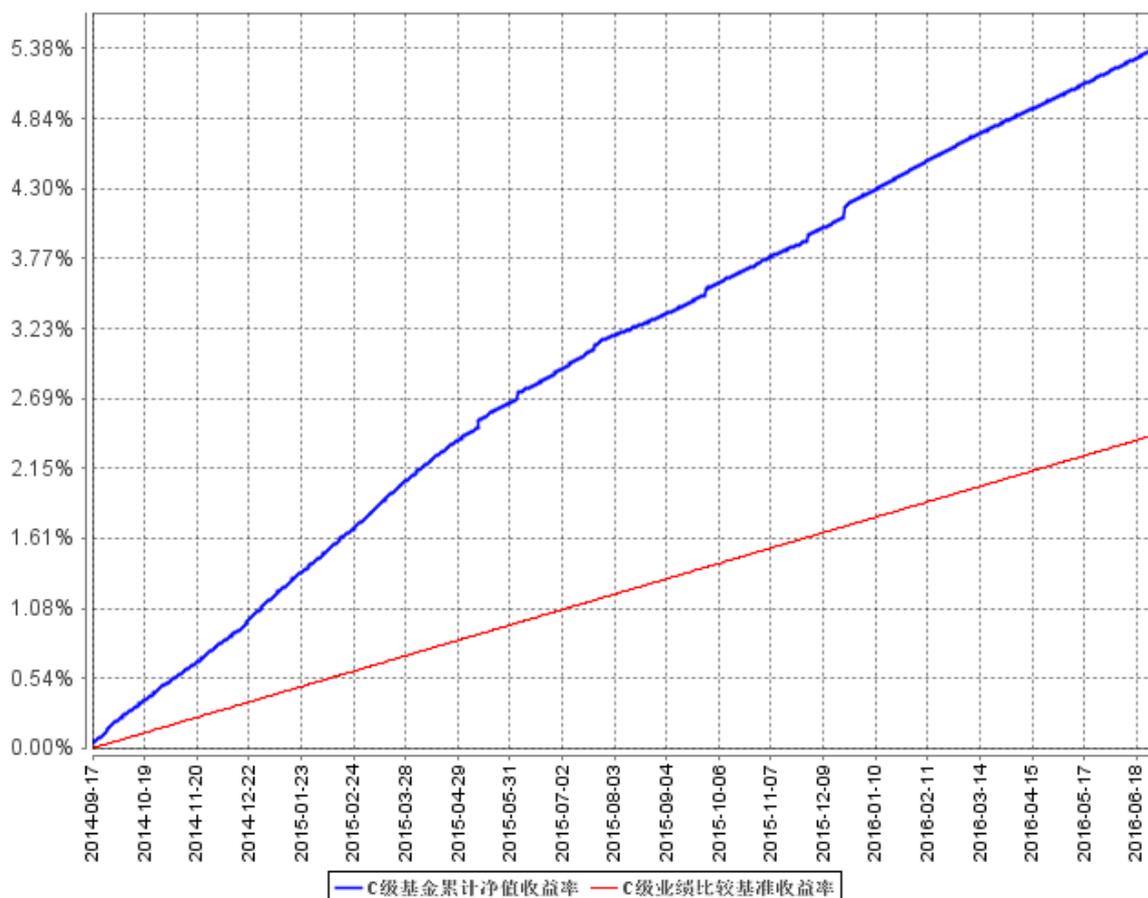
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

§ 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46.74亿元，其中：中国华融出资38.12亿元，中国葛洲坝集团公司、中国葛洲坝集团股份有限公司、北京纽森特投资有限公司、九江和汇进出口有限公司、江苏德源纺织服饰有限公司、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、吉林昊融集团有限公司、深圳市科铭实业有限公司、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、等12家股东共出资8.62亿元。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、陕西、贵州、四川、江西、海南、浙江、山东、福建等 14 家分公司，63 家营业部，上海和深圳 2 家投行业务部，控股华融期货有限责任公司。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。公司 2011-2014 年连续四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，2014 年最佳资产管理券商，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”。

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		
轩玉婷	本基金的基金经理	2015 年 7 月 27 日	2016 年 2 月 25 日	8	轩玉婷，硕士研究生毕业。具有超过七年时间从事证券研究和投资管理等方面的工作经历。2008 年 12 月到 2012 年 8 月在中融国际信托有限公司担任固定收益部投资经理，从事固定收益证券投资分析工作；于 2012 年 8 月到 2014 年 8 月在中邮证券有限责任公司担任资产管理部投资经理，从事固定收益类理财产品投资分析工作；于 2014 年 8 月加入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。
赵亮	本基金的基金经理	2016 年 2 月 1 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。
--	--	--	--	--	-------------

注：本基金于 2016 年 2 月 1 日增聘赵亮为华融现金增利货币市场基金的基金经理。轩玉婷于 2016 年 2 月 25 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合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《基金法》及其他有关法律、基金合同的规定。

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

2016 年上半年货币市场收益率整体呈下行趋势，在季末和半年末出现短暂的流动性偏紧。由于《货币市场基金监督管理办法》的出台，本基金根据新的监管要求调整了资产组合。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。本基金资产组合的久期控制在 2-3 个月。50%以上的资产投资于风险较低的银行协议存款。30%左右的资产投资于信用良好、流动性较好的银行同业存单，此外在严格进行信用评估的基础上少量参与信用良好的短期融资券。并有 10%以上的资产为国债、到期日 7 天以内的逆回购以及现金资产。

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 1.1000%；B 类基金份额净值收益率为 1.2200%；C 类基金份额净值收益率为 1.1000%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管一季度经济出现小幅反弹，但年内宏观经济仍将处在下行趋势中，同时存在通货紧缩的风险。固定资产投资增速将继续回落。货币政策延续中性偏松，然而由于人民币贬值的预期，货币政策的空间有限。宏观基本面、流动性以及全球风险偏好的下移将带动长端收益率进一步下行，短端收益率则以低位震荡为主。

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验。

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

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

2016 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 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		102,614,907.62	185,439,385.01
结算备付金		840,037.70	1,047,619.05
存出保证金		-	-
交易性金融资产		129,784,156.08	19,987,249.74
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		129,784,156.08	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		-	14,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		1,595,415.55	354,384.93
应收股利		-	-

应收申购款		2,401.00	668,455.98
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		234,836,917.95	221,497,094.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30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		57,626.92	53,389.93
应付托管费		19,208.98	17,796.67
应付销售服务费		41,778.87	4,761.42
应付交易费用		880.00	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		99,452.08	100,000.00
负债合计		218,946.85	2,174,664.69
所有者权益:			
实收基金		234,617,971.10	219,322,430.02
未分配利润		-	-
所有者权益合计		234,617,971.10	219,322,430.02
负债和所有者权益总计		234,836,917.95	221,497,094.71

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年6月30日
一、收入		3,301,605.44	9,260,371.44
1.利息收入		3,301,605.44	9,116,514.33
其中：存款利息收入		2,233,210.30	7,096,331.35
债券利息收入		871,385.49	1,269,280.07
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		197,009.65	750,902.91
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-	143,857.11
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	143,857.11
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		635,987.51	1,028,253.00
1. 管理人报酬		330,023.09	639,052.21
2. 托管费		110,007.62	213,017.39
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	37,017.45	98,184.94
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		29,929.72	-
其中：卖出回购金融资产支出		29,929.72	-
6. 其他费用		129,009.63	77,998.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,665,617.93	8,232,118.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,665,617.93	8,232,118.44

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	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）	-	2,665,617.93	2,665,617.93
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）	15,295,541.08	-	15,295,541.08
其中：1.基金申购款	67,795,951.98	-	67,795,951.98
2.基金赎回款	-52,500,410.90	-	-52,500,410.90
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）	-	-2,665,617.93	-2,665,617.93
五、期末所有者权益（基金净值）	234,617,971.10	-	234,617,971.10
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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）	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）	-	8,232,118.44	8,232,118.44
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）	215,742,191.30	-	215,742,191.30
其中：1.基金申购款	1,604,457,995.85	-	1,604,457,995.85
2.基金赎回款	-1,388,715,804.55	-	-1,388,715,804.55
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）	-	-8,232,118.44	-8,232,118.44
五、期末所有者权益（基金净值）	428,152,957.59	-	428,152,957.59

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
基金管理人负责人

杨铭海
主管会计工作负责人

董维
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者收取）、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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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

华融天泽投资有限公司	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

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

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金于本报告期末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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
华融证券	1,225,400,000.00	100.00%	-	-

6.4.8.1.4 权证交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期末发生应支付关联方佣金。

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 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	330,023.09	639,052.21
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	110,007.62	213,017.39

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			
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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	11,860.80	11,572.19	18,345.88	41,778.87
合计	11,860.80	11,572.19	18,345.88	41,778.87
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 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	47,009.26	22,396.78	81,391.38	150,797.42
合计	47,009.26	22,396.78	81,391.38	150,797.42

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

本基金于本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

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		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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	-	40,759,084.30	-
期间因拆分变动份额	-	499,746.42	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	41,258,830.72	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	7.9400%	-

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	-	120,000,000.00	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	800,067,020.44	-
期末持有的基金份额	-	39,993,297.56	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	8.2947%	-

注：本基金的基金管理人于本报告期内未运用固有资金投资本基金，截至本报告期末，基金管理人运用固有资金投资本基金的资产余额为 41,258,830.72 元。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于 2016 年 6 月 30 日未持有本基金份额。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	6,614,907.62	153,829.32	76,867,170.59	416,001.67

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2016 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

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

本基金本报告未持有因认购新发/期末持有的暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	129,784,156.08	55.27
	其中：债券	129,784,156.08	55.27
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	103,454,945.32	44.05
4	其他各项资产	1,597,816.55	0.68
5	合计	234,836,917.95	100.00

7.2 债券回购融资情况

本基金本报告期末无债券融资回购余额。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金本报告期内未发生资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	95
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	38

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限未有超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	44.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	12.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	17.00	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	17.02	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	8.53	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.41	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限未有超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	20,017,450.64	8.53
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	40,073,894.08	17.08
6	中期票据	-	-
7	同业存单	69,692,811.36	29.70
8	其他	-	-
9	合计	129,784,156.08	55.32
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	041552052	15 长虹 CP002	200,000	19,993,821.61	8.52
2	041553090	15 万达 CP003	100,000	10,061,418.14	4.29
3	041564071	15 中盐 CP003	100,000	10,018,654.33	4.27
4	160001	16 付息国债 01	100,000	10,011,332.10	4.27
5	019533	16 付息国债 05	100,000	10,006,118.54	4.26
6	111694146	16 长春农村商业银行 CD041	100,000	9,995,882.42	4.26

7	111694187	16 德州德 城区农联社 CD009	100,000	9,994,992.99	4.26
8	111692950	16 温州银 行 CD054	100,000	9,976,182.40	4.25
9	111693741	16 杭州联 合银行 CD073	100,000	9,954,561.44	4.24
10	111694278	16 威海商 行 CD013	100,000	9,941,795.96	4.24

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.10%
报告期内偏离度的最低值	-0.04%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.05%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未有负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未有正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

鉴于货币市场基金的特性，本基金采用摊余成本法计算基金资产净值，即本基金按持有债券投资的票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价，以摊余的成本计算基金资产净值。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率或交易市价计算的基金资产净值

发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人采用“影子定价”，即于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行重新评估，当基金资产净值与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为“公允价值变动损益”，并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至 1.00 元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

7.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,595,415.55
4	应收申购款	2,401.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,597,816.55

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华融	955	6,845.33	1,710,700.28	26.17%	4,826,593.95	73.83%

现金增利 A						
华融现金增利 B	5	43,534,430.70	217,672,153.50	100.00%	0.00	0.00%
华融现金增利 C	1,696	6,137.10	3,394,085.91	32.61%	7,014,437.46	67.39%
合计	2,656	88,335.08	222,776,939.69	94.95%	11,841,031.41	5.05%

8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金为未上市基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华融现金增利 A	63,001.35	0.9637%
	华融现金增利 B	-	-
	华融现金增利 C	1,076,256.44	10.3400%
	合计	1,139,257.79	0.4856%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用期末基金份额总额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华融现金增利 A	0~10
	华融现金增利 B	-
	华融现金增利 C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	华融现金增利 A	0~10
	华融现金增利 B	-
	华融现金增利 C	0~10

	合计	0~10
--	----	------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	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）基金份额总额	325,121.97	110,001,555.55	91,859,221.92
本报告期期初基金份额总额	15,140,220.72	195,243,801.67	8,938,407.63
本报告期基金总申购份额	3,993,317.80	22,909,016.57	40,893,617.61
减：本报告期基金总赎回份额	12,596,244.29	480,664.74	39,423,501.87
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期末基金份额总额	6,537,294.23	217,672,153.50	10,408,523.37

注：总申购份额含转换入、分级调整、红利再投的基金份额，本期总赎回份额含转换出、分级调整的基金份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华融证券	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华融证券	-	-	-1,225,400,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本基金本报告期偏离度绝对值未超过 0.5%。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华融证券股份有限公司
2016 年 8 月 27 日