华安全球美元票息债券型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年七月十八日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月13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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安全球美元票息债券(QDII)	
基金主代码	002426	
交易代码	002426	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年6月3日	
报告期末基金份额总额	286,108,307.70份	
投资目标	本基金在严谨信用分析的基础上,通过分析来自全球各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面,寻求各类债券的投资机会。力争在严格控制风险的前提下,同时追求获取超越业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金将根据对全球市场经济发展的判断,以及对不同国家和地区宏观经济、财政和货币政策、证券市场走势、金融市场环境的分析,确定基金资产在不同国家和地区的配置比例。 同时基于对经济周期及其变化趋势等特征的研究和判断,根据对政府债券、信用债、可转债等不同债券板块之间的相对投资价值分析,确定不同经济周期阶段下的债券类属配置策略,并根据经济周期阶段变化及时进行调整。从而有效把握经济不同发展阶段的投资机会,实现基金资产的保值增值。	
业绩比较基准	95%×巴克莱资本美国综合债券指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期的风险水平和预期收益都要低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。 本基金可投资于境外证券,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
境外资产托管人英文名称	State Street Bank and Trust Company	
境外资产托管人中文名称	美国道富银行	
下属分级基金的基金简称	华安美元票息债-A	华安美元票息债-C
下属分级基金的交易代码	002426	002429
报告期末下属分级基金的份额总额	272,695,095.05份	13,413,212.65份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)	
	华安美元票息债-A	华安美元票息债-C
1.本期已实现收益	-22,984,175.64	-1,126,937.48
2.本期利润	4,170,647.15	186,113.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.0144	0.0132
4.期末基金资产净值	281,601,877.06	13,692,746.95
5.期末基金份额净值	1.033	1.021

1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、华安美元票息债-A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	1.57%	0.24%	4.80%	0.29%	-3.23%	-0.05%

2、华安美元票息债-C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	1.49%	0.25%	4.80%	0.29%	-3.31%	-0.04%

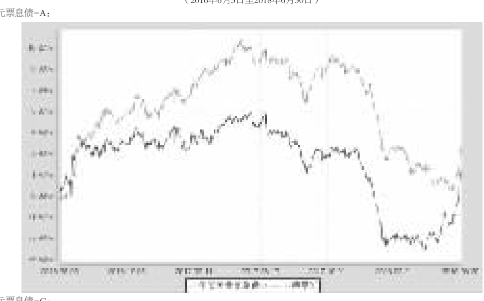
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安全球美元票息债券型证券投资基金

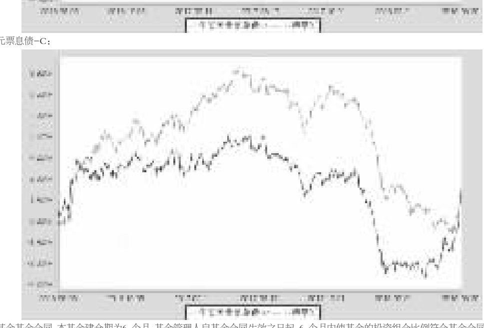
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年6月3日至2018年6月30日)

1. 华安美元票息债-A:



2. 华安美元票息债-C:



注:根据本基金基金合同,本基金建仓期为6 个月。基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§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	说明
		任职日期	离任日期		
庄宇飞	本基金的基金经理	2017-03-16	-	6年	硕士研究生,6年证券、基金从业经历,持有基金从业资格证书。历任上海证券创新发展总部分析师,上海吉金资产管理有限公司金融顾问事业部项目经理,上海证券创新发展总部创新实验室负责人。2016年6月加入华安基金,任全球投资部基金经理助理。2017年3月起担任本基金、华安全球美元收益债券型证券投资基金的基金经理。2018年6月起,同时担任华安全球稳健配置证券投资基金的基金经理。

注:此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,本着诚实信用、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求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节,公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行强制公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1) 交易所二级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则,实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2) 交易所一级市场业务,投资组合经理按意愿独立进行业务申报,集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签,则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先询价的控制原则。通过内部共同的iwind群,发布询价需求和结果,做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标,则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向,交易员以此进行投标,以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在风控部门的监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控;风险管理部根据市场公认的第三方信息(如:中债登的债券估值),定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则,并在投资系统中进行了设置,实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查;风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为2次,未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

美联储于6月FOMC会议上加息25个基点,符合市场预期;联储点阵图更新后,隐含的2018/19/20年加息次数从3/3/2调整为4/3/1,虽然长期利率预测不变,三年加息次数总共依然是8次,但节奏变快,美债及新兴经济体的压力增大。欧洲方面,欧央行6月议息决议,将在每月300亿欧元的资产购买计划至9月到期后,将10月-12月间的购买规模削减至每月150亿,随后停止并退出QE;并明确表示政策利率至少保持不变直至2019年夏天,随后视情况而定;总体来看,ECB在退出QE的速度,以及利率前瞻指引均略偏鸽派。美欧央行一鹰一鸽的政策指引,叠加全球贸易战、意大利组阁危机等外部宏观事件的袭扰,导致美元指数在2季度大幅反弹,对全球资本市场尤其是新兴市场造成了较大冲击。

2季度,各期限美国国债收益率均录得不同程度上行,但收益率曲线进一步趋平。受制于美债收益率上行、美元指数大幅反弹、市场风险偏好大幅降低、市场情绪明显走弱等不利因素,亚洲美元信用债市场在本季度表现疲软,JPM Asia Credit Index下跌1.19%,收益率上行0.45%,利差走阔了34.9bps;其中,亚洲美元高收益债市场表现尤为惨淡,整体收跌3.58%,收益率上行1.09%,利差大幅走阔了100.09bps。

本季度,本基金大幅降低了利率敞口,组合久期得到了明显压缩;同时,基于对信用风险,尤其是高收益债市场的防范,本基金出清了绝大部分高收益债持仓,组合配置以超短久期投资级信用债及浮息债为主。我们认为,在美债利率进一步上行以及信用环境恶化导致信用利差快速走阔的可能性下,组合持仓偏防御是可行的也是有必要的。短期内,我们仍将聚焦于收益率曲线短端所带来的确定性收益;在此基础上,我们将密切关注美元债券市场利率端与信用端的演变,适时捕捉市场可能的交易性机会,力争为投资者创造超额回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日,华安全球美元票息债A份额净值为1.033元,C份额净值为1.021元;华安全球美元票息债A份额净值增长率为1.57%, C份额净值增长率为1.49%,同期业绩比较基准增长率为4.80%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	266,136,405.26	84.95
	其中:债券	266,136,405.26	84.95
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	45,651,076.47	14.57
8	其他各项资产	1,504,831.22	0.48
9	合计	313,292,312.95	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
A+至A-	112,378,253.23	38.06
BBB+至BBB-	123,941,688.05	41.97
BB+至BB-	9,273,628.06	3.14
B+至B-	11,598,767.47	3.93
无评级	8,944,068.45	3.03

注:本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息,未提供评级信息的可适用内部评级。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	XS1830984628	IND & COMM BK CHN/LONDON	26,466,400	26,427,759.06	8.95
2	XS1823770828	VANKE REAL ESTATE HK	26,466,400	26,372,179.62	8.93
3	XS1822793821	BOC AVIATION LTD	19,849,800	19,842,058.58	6.72
4	US92343VEP58	VERIZON COMMUNICATIONS	19,849,800	19,836,302.14	6.72
5	XS1810003332	ICBCIL FINANCE CO LTD	19,849,800	19,817,444.83	6.71

注:1.债券代码为ISIN码。

2. 数量列示债券面值,外币按照期末估值汇率折为人民币,四舍五入保留整数。

5.7 报告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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,465,684.11
5	应收申购款	39,147.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,504,831.22

5.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安美元票息债-A	华安美元票息债-C
本报告期期初基金份额总额	304,317,609.91	14,991,599.24
报告期基金总申购份额	2,087,745.69	290,299.55
减:报告期基金总赎回份额	33,710,260.55	1,868,686.14
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	272,695,095.05	13,413,212.65

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	46,815,543.07
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	46,815,543.07
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	16.36

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《华安全球美元票息债券型证券投资基金基金合同》

2、《华安全球美元票息债券型证券投资基金招募说明书》

3、《华安全球美元票息债券型证券投资基金托管协议》

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇一八年七月十八日

华安全球美元收益债券型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年七月十八日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月13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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安美元收益债券(QDII)	
基金主代码	002391	
交易代码	002391	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年3月23日	
报告期末基金份额总额	841,183,953.62份	
投资目标	本基金在严谨信用分析的基础上,通过分析来自全球各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面,寻求各类债券的投资机会。力争在严格控制风险的前提下,同时追求获取超越业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金将根据对全球市场经济发展的判断,以及对不同国家和地区宏观经济、财政和货币政策、证券市场走势、金融市场环境的分析,确定基金资产在不同国家和地区的配置比例。 基于对经济周期及其变化趋势等特征的研究和判断,根据对政府债券、信用债、可转债等不同债券板块之间的相对投资价值分析,确定不同经济周期阶段下的债券类属配置策略,并根据经济周期阶段变化及时进行调整。从而有效把握经济不同发展阶段的投资机会,实现基金资产的保值增值。	
业绩比较基准	95%×巴克莱资本美国综合债券指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期的风险水平和预期收益都要低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。 本基金可投资于境外证券,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
境外资产托管人英文名称	Bank of China (Hong Kong) Limited	
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港)有限公司	
下属分级基金的基金简称	华安美元收益-A	华安美元收益-C
下属分级基金的交易代码	002391	002393
报告期末下属分级基金的份额总额	736,369,068.20份	104,814,885.42份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)	
	华安美元收益-A	华安美元收益-C
1.本期已实现收益	-62,508,540.53	-8,787,287.11
2.本期利润	8,228,517.31	982,547.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0101	0.0089
4.期末基金资产净值	772,034,471.57	108,754,661.91
5.期末基金份额净值	1.048	1.038

1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、华安美元收益-A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	1.06%	0.24%	4.80%	0.29%	-3.74%	-0.05%

2、华安美元收益-C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	1.07%	0.24%	4.80%	0.29%	-3.73%	-0.05%

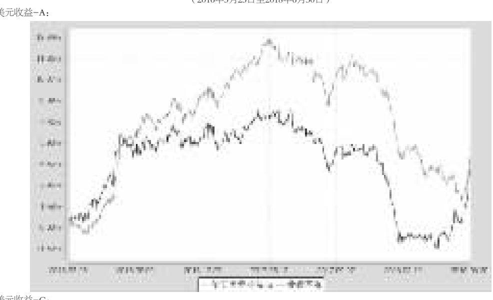
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安全球美元收益债券型证券投资基金

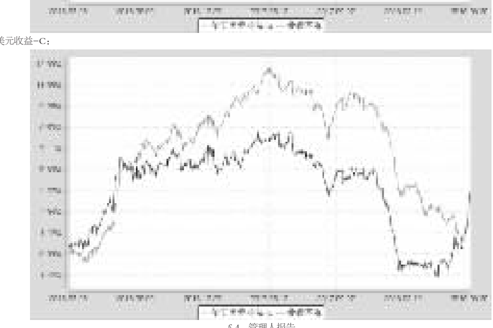
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年3月23日至2018年6月30日)

1. 华安美元收益-A:



2. 华安美元收益-C:



§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	说明
		任职日期	离任日期		
庄宇飞	本基金的基金经理	2017-03-16	-	6年	硕士研究生,6年证券、基金从业经历,持有基金从业资格证书。历任上海证券创新发展总部分析师,上海吉金资产管理有限公司金融顾问事业部项目经理,上海证券创新发展总部创新实验室负责人。2016年6月加入华安基金,任全球投资部基金经理助理。2017年3月起担任本基金、华安全球美元票息债券型证券投资基金的基金经理。2018年6月起,同时担任华安全球稳健配置证券投资基金的基金经理。

注:此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,本着诚实信用、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求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节,公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行强制公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1) 交易所二级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则,实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2) 交易所一级市场业务,投资组合经理按意愿独立进行业务申报,集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签,则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先询价的控制原则。通过内部共同的iwind群,发布询价需求和结果,做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标,则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向,交易员以此进行投标,以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在风控部门的监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控;风险管理部根据市场公认的第三方信息(如:中债登的债券估值),定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.4.2异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则,并在投资系统中进行了设置,实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查;风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为2次,未出现异常交易。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

美联储于6月FOMC会议上加息25个基点,符合市场预期;联储点阵图更新后,隐含的2018/19/20年加息次数从3/3/2调整为4/3/1,虽然长期利率预测不变,三年加息次数总共依然是8次,但节奏变快,美债及新兴经济体的压力增大。欧洲方面,欧央行6月议息决议,将在每月300亿欧元的资产购买计划至9月到期后,将10月-12月间的购买规模削减至每月150亿,随后停止并退出QE;并明确表示政策利率至少保持不变直至2019年夏天,随后视情况而定;总体来看,ECB在退出QE的速度,以及利率前瞻指引均略偏鸽派。美欧央行一鹰一鸽的政策指引,叠加全球贸易战、意大利组阁危机等外部宏观事件的袭扰,导致美元指数在2季度大幅反弹,对全球资本市场尤其是新兴市场造成了较大冲击。

2季度,各期限美国国债收益率均录得不同程度上行,但收益率曲线进一步趋平。受制于美债收益率上行、美元指数大幅反弹、市场风险偏好大幅降低、市场情绪明显走弱等不利因素,亚洲美元信用债市场在本季度表现疲软,JPM Asia Credit Index下跌1.19%,收益率上行0.45%,利差走阔了34.9bps;其中,亚洲美元高收益债市场表现尤为惨淡,整体收跌3.58%,收益率上行1.09%,利差大幅走阔了100.09bps。

本季度,本基金大幅降低了利率敞口,组合久期得到了明显压缩;同时,基于对信用风险,尤其是高收益债市场的防范,本基金出清了绝大部分高收益债持仓,组合配置以超短久期投资级信用债及浮息债为主。我们认为,在美债利率进一步上行以及信用环境恶化导致信用利差快速走阔的可能性下,组合持仓偏防御是可行的也是有必要的。短期内,我们仍将聚焦于收益率曲线短端所带来的确定性收益;在此基础上,我们将密切关注美元债券市场利率端与信用端的演变,适时捕捉市场可能的交易性机会,力争为投资者创造超额回报。

4.5.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日,华安全球美元收益债A份额净值为1.048元,C份额净值为1.038元;华安全球美元收益债A份额净值增长率为1.06%, C份额净值增长率为1.07%,同期业绩比较基准增长率为4.80%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	809,253,538.57	88.38
	其中:债券	809,253,538.57	88.38
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	100,529,940.90	10.98
8	其他各项资产	5,847,886.31	0.64
9	合计	915,631,365.78	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
A+至A-	335,014,238.59	38.04
BBB+至BBB-	385,619,484.12	43.78
BB+至BB-	15,456,046.77	1.75
B+至B-	56,445,288.28	6.41
无评级	16,718,480.81	1.90

注:本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息,未提供评级信息的可适用内部评级。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	XS1830984628	IND & COMM BK CHN/LONDON	86,015,800	85,890,216.93	9.75
2	XS1822793821	BOC AVIATION LTD	59,549,400	59,526,175.73	6.76
3	XS1810003332	ICBCIL FINANCE CO LTD	59,549,400	59,452,334.48	6.75
4	XS1832936055	CHINA CONSTRUCT BANK/HK	46,316,200	46,276,831.23	5.25
5	XS1823770828	VANKE REAL ESTATE HK	46,316,200	46,151,314.33	5.24

注:1.债券代码为ISIN码;

2.数量列示债券面值,外币按照期末估值汇率折为人民币,四舍五入保留整数。

5.7 报告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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,158,990.27
5	应收申购款	688,896.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,847,886.31

5.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安美元收益-A	华安美元收益-C
本报告期期初基金份额总额	933,719,187.64	114,268,504.71
报告期基金总申购份额	2,297,530.40	4,791,035.24
减:报告期基金总赎回份额	199,647,649.84	14,244,654.53
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	736,369,068.20	104,814,885.42

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180423~20180630	194,345,406.36	0.00	0.00	194,345,406.36	23.10%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《华安全球美元收益债券型证券投资基金基金合同》

2、《华安全球美元收益债券型证券投资基金招募说明书》

3、《华安全球美元收益债券型证券投资基金托管协议》

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所和基金托管人的住所,并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇一八年七月十八日

华安日日鑫货币市场基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人:华安基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一八年七月十八日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月13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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安日日鑫货币		
场内简称	货币ETF		
基金主代码	040038		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年11月26日		
报告期末基金份额总额	102,170,627,343.20份		
投资目标	为满足投资人现金管理和日常理财需求,本基金在力求本金安全、确保基金资产流动性的基础上,追求稳定的当期收益,谋求资产的稳定增值。		
投资策略	本基金将根据市场情况和可投资品种的容量,在严谨深入的研究分析基础上,综合考量宏观经济形势、市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等,确定各类货币市场工具的配置比例并进行积极的投资组合管理,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。		
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。		
基金管理人	华安基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	华安日日鑫货币A	华安日日鑫货币B	华安日日鑫货币H
下属分级基金的场内简称	-	-	货币ETF
下属分级基金的交易代码	040038	040039	511600
报告期末下属分级基金的份额总额	93,764,090,307.93份	8,224,389,569.66份	182,147,465.61份

注:自2016 年9月12日起,本基金新增场内基金份额(H类基金份额)简称为"货币ETF",基金份额净值为100.00元。本表所列场内份额数据面值已折算为1.00元;场外基金份额(A类基金份额)简称为"华安日日鑫货币A",基金份额净值为1.00元;场外基金份额(B类基金份额)简称为"华安日日鑫货币B",基金份额净值为1.00元。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)		
	华安日日鑫货币A	华安日日鑫货币B	华安日日鑫货币H
1.本期已实现收益	282,405,217.55	123,935,603.71	2,990,526.89
2.本期利润	282,405,217.55	123,935,603.71	2,990,526.89
3.期末基金资产净值	93,764,090,307.93	8,224,389,569.66	182,147,465.61

注:1、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。

2、自2016年9月12日起,本基金增设H类份额类别。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、华安日日鑫货币A:

阶段	净值收益率①	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	0.9975%	0.0008%	0.2693%	0.0000%	0.7282%	0.0008%

2、华安日日鑫货币B:

阶段	净值收益率①	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	1.0551%	0.0007%	0.2693%	0.0000%	0.7858%	0.0007%

3、华安日日鑫货币H:

阶段	净值收益率①	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	0.9890%	0.0007%	0.2693%	0.0000%	0.7197%	0.0007%

注:自2016年9月12日起,本基金增设H类份额。

本基金自成立起至2016年8月29日,利润分配是按月结转份额。自2016年8月30日起至今,利润分配是按日结转份额。

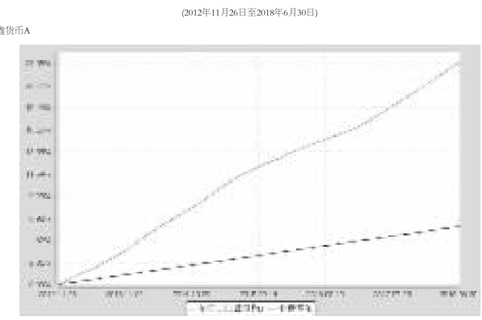
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安日日鑫货币市场基金

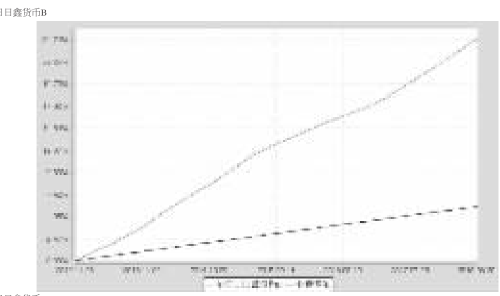
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年11月26日至2018年6月30日)

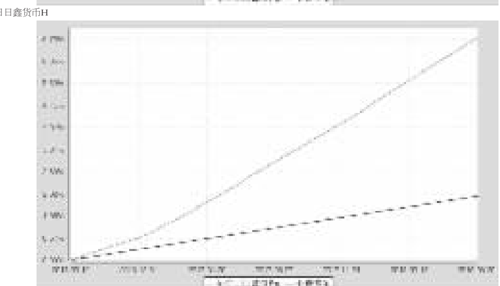
1、华安日日鑫货币A



2、华安日日鑫货币B



3、华安日日鑫货币H



§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	说明
		任职日期	离任日期		
李邦长	本基金的基金经理	2016-03-02	-	8年	硕士研究生,具有基金从业资格证书,曾任安永华明会计师事务所审计师,2010年3月加入华安基金管理有限公司,先后从事基金运营、债券交易和债券研究等工作,2014年9月起担任基金经理助理,2016年3月起担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金、本基金的基金经理。2016年11月起,同时担任华安鼎丰债券型发起式证券投资基金的基金经理。2017年12月起,同时担任华安鼎瑞定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
苏卿云	本基金的基金经理	2016-12-19	-	10年	硕士研究生,10年证券行业从业经历,曾任上海证券交易所基金业务部经理。2016年7月加入华安基金,任指数与量化投资事业总部ETF业务负责人。2016年12月起,担任本基金的基金经理。2017年6月起,担任华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年10月起,同时担任华安沪深300指数分级证券投资基金、华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2017年12月起,同时担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。
孙丽娜	本基金的基金经理	2018-05-31	-	7年	硕士研究生,7年债券、基金行业从业经验。曾任上海国际货币经纪公司债券经纪人。2010年8月加入华安基金管理有限公司,先后担任债券交易员、基金经理助理。2014年8月至2017年7月担任华安日日鑫货币市场基金及华安汇财通货币市场基金的基金经理。2014年8月至2015年1月,同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014年10月起同时担任华安现金富利投资基金的基金经理。2015年2月起担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安添颐养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016年10月至2018年1月,同时担任华安安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月起,同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起,同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。2018年5月起,同时担任本基金的基金经理。

注:此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,本着诚实信用、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求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节,公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行强制公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1) 交易所二级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则,实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2) 交易所一级市场业务,投资组合经理按意愿独立进行业务申报,集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签,则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先询价的控制原则。通过内部共同的iwind群,发布询价需求和结果,做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标,则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向,交易员以此进行投标,以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在风控部门的监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控;风险管理部根据市场公认的第三方信息(如:中债登的债券估值),定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则,并在投资系统中进行了设置,实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查;风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为2次,未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

二季度,全球经济反弹出现分化,主要国家货币政策松紧不一。美国经济维持复苏态势,居民消费稳健增长,劳动力市场持续改善,失业率再创新低,通胀压力有所抬升,6月美联储议息会议再次上调联邦基金利率。欧元区经济基本面转弱,PMI 数据下滑,投资者信心指数从高点回落,通胀也有所走弱。国内经济方面,工业企业利润增速延续增长态势,工业增加值增速有所放缓,工业生产总体平稳;投资受融资环境收紧等因素影响回落较大,消费增长也受到冲击,叠加贸易争端影响,短期经济出现疲弱态势;由于经济面临的不确定性加大,央行货币政策在维持稳健中性的基调上适时微调以进行对冲,二季度通过两次定向降准分别替换中期借贷便利和支持债转股去杠杆、中小微企业融资困难等,除季末等个别时点资金面有所波动外,流动性总体较为宽松。降准利好,机构融资需求放缓以及中美贸易摩擦反复变化推升避险情绪,二季度债券市场迎来做多行情,十年期国债收益率下行幅度超20bp,3Y-5Y 期 AAA级中短期票据收益率下行幅度超40bp,信用利差收窄。

本报告期内,我们勤勉尽责,稳健操作,在保证组合流动性安全的前提下,甄选优质个券,捕捉流动性收紧资金利率冲高机会,投资定存、同业存单和逆回购等品种锁定高收益,并适时根据市场变化调整组合结构,拉长组合平均剩余期限,灵活把握投资机会,为持有人获得了可观的组合收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

华安日日鑫货币A:

投资回报:0.9975% 比较基准:0.2693%

华安日日鑫货币B:

投资回报:1.0551% 比较基准:0.2693%

华安日日鑫货币H:

投资回报:0.9890% 比较基准:0.2693%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,贸易争端可能对进出口带来一定扰动,但实现经济基本面将总体维持平稳,政策控风险和金融去杠杆将继续深化,机构融资需求放缓带来的流动性被动宽松具有可持续性,表内外资金将更加趋于平衡,预计三季度资金面总体平稳。债券市场面临的大环境总体较为有利,但受供给释放、信用收缩是否会产生连锁反应等因素影响,收益率可能波动加大。

操作方面,我们将继续把握基金的流动性和收益性的平衡,优化组合资产配置计划,把握结构性机会,主要通过锁定高收益同业存款和甄选优质同业存单博取较高的持有收益,提高组合整体收益水平,为投资者创造更多价值。我们将秉承稳健、专业的投资理念,优化组合结构,控制风险,勤勉尽责地维护持有人的利益。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§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	38,029,263,816.53	37.20
	其中:债券	38,029,263,816.53	37.20
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	10,822,116,213.18	10.59
	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	53,053,248,084.37	51.89
4	其他资产	331,629,608.12	0.32
5	合计	102,236,257,722.20	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.73	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	97
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	102
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告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	11.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	11.41	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	37.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	2.64	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	36.05	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.74	-

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

报告期内投资组合无平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	2,772,567,861.71	2.71
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,601,990,682.26	2.55
	其中:政策性金融债	2,601,990,682.26	2.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,000,081.25	0.03
6	中期票据	-	-
7	同业存单	32,624,705,191.31	31.93
8	其他	-	-
9	合计	38,029,263,816.53	37.22
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111811150	18平安银行CD150	30,000,000	2,976,193,697.45	2.91
2	111809172	18浦发银行CD172	20,000,000	1,983,952,127.12	1.94
3	111898371	18宁波银行CD104	20,000,000	1,983,778,159.46	1.94
4	111820124	18广发银行CD124	20,000,000	1,983,399,678.25	1.94
5	111803120	18农业银行CD120	12,000,000	1,176,506,488.34	1.15
6	111815262	18民生银行CD262	11,000,000	1,090,870,898.42	1.07
7	111808154	18中信银行CD154	10,000,000	992,671,531.51	0.97
8	111820119	18广发银行CD119	10,000,000	992,671,531.51	0.97
9	111820121	18广发银行CD121	10,000,000	991,975,354.72	0.97
10	111809181	18浦发银行CD181	10,000,000	991,701,300.39	0.97

5.7"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	6次
报告期内偏离度的最高值	0.1568%
报告期内偏离度的最低值	0.0066%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0689%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

无。

5.8报告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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.00元。

5.9.2本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	325,639,054.98
4	应收申购款	5,990,553.14
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	331,629,608.12

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安日日鑫货币A	华安日日鑫货币B	华安日日鑫货币H
本报告期期初基金份额总额	324,963,592.11	11,050,590,261.25	389,510,945.63
报告期基金总申购份额	202,906,786,124.22	5,573,531,561.92	67,490,898.28
报告期基金总赎回份额	109,467,659,408.40	8,399,732,253.51	274,854,378.30
报告期基金拆分变动份额	-	-	-
报告期期末基金份额总额	93,764,090,307.93	8,224,389,569.66	182,147,465.61

注:自2016 年9月12日起,本基金新增场内基金份额(H类基金份额)简称为"货币ETF",基金份额净值为100.00元。本表所列场内份额数据面值已折算为1.00元;场外基金份额(A类基金份额)简称为"华安日日鑫货币A",基金份额净值为1.00元;场外基金份额(B类基金份额)简称为"华安日日鑫货币B",基金份额净值为1.00元。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2018-04-03	110,000,000.00	110,000,000.00	-
2	赎回	2018-04-16	-70,000,000.00	-70,000,000.00	-
3	赎回	2018-04-24	-120,000,000.00	-120,000,000.00	-
4	赎回	2018-05-22	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
合计			-100,000,000.00	-100,000,000.00	

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1、《华安日日鑫货币市场基金基金合同》

2、《华安日日鑫货币市场基金基金招募说明书》

3、《华安日日鑫货币市场基金托管协议》

8.2存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。

8.3查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇一八年七月十八日