

华安日日鑫货币市场基金

2023 年中期报告

2023 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：二〇二三年八月三十日

1 重要提示及目录

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。本中期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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 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计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录 3	
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表 17	
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
6.4.14 公允价值	39
6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具	40
7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 债券回购融资情况.....	41
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	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.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	43
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....	43
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	43
7.9 投资组合报告附注.....	43
8 基金份额持有人信息	45

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末上市基金前十名持有人	45
8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	46
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.5 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	46
9 开放式基金份额变动	47
10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
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	50
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	51
10.9 其他重大事件	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息	51
12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安日日鑫货币市场基金		
基金简称	华安日日鑫货币		
场内简称	货币 ETF		
基金主代码	040038		
交易代码	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		
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		
报告期末基金份额总额	163,986,017,719.97 份		
基金合同存续期	不定期		
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	163,073,674,456.46 份	889,248,075.03 份	23,095,188.48 份

2.2 基金产品说明

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。

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		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	王小飞
	联系电话	021-38969999	021-60637103
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637228

传真	021-68863414	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 临港新片区环湖西二路888号B 楼2118室	北京市西城区金融大街25号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	朱学华	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层

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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 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
本期已实现收益	1,465,783,570.63	12,783,719.83	227,459.49
本期利润	1,465,783,570.63	12,783,719.83	227,459.49
本期净值收益率	0.9004%	1.0205%	0.9005%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 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
期末基金资产净值	163,073,674,456.46	889,248,075.03	23,095,188.48
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 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
累计净值收益率	36.9258%	40.4427%	18.7068%

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

金按实际利率计算账面价值，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，简称为“货币 ETF”。

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

1. 华安日日鑫货币 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
过去一个月	0.1454%	0.0001%	0.0888%	0.0000%	0.0566%	0.0001%
过去三个月	0.4643%	0.0004%	0.2693%	0.0000%	0.1950%	0.0004%
过去六个月	0.9004%	0.0004%	0.5356%	0.0000%	0.3648%	0.0004%
过去一年	1.6460%	0.0007%	1.0800%	0.0000%	0.5660%	0.0007%
过去三年	5.7942%	0.0008%	3.2400%	0.0000%	2.5542%	0.0008%
自基金合同生效起至今	36.9258%	0.0036%	11.4480%	0.0000%	25.4778%	0.0036%

2. 华安日日鑫货币 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	0.1651%	0.0001%	0.0888%	0.0000%	0.0763%	0.0001%
过去三个月	0.5244%	0.0004%	0.2693%	0.0000%	0.2551%	0.0004%
过去六个月	1.0205%	0.0004%	0.5356%	0.0000%	0.4849%	0.0004%
过去一年	1.8902%	0.0007%	1.0800%	0.0000%	0.8102%	0.0007%
过去三年	6.5582%	0.0007%	3.2400%	0.0000%	3.3182%	0.0007%
自基金合同生效起至今	40.4427%	0.0035%	11.4480%	0.0000%	28.9947%	0.0035%

3. 华安日日鑫货币 H:

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	0.1454%	0.0001%	0.0888%	0.0000%	0.0566%	0.0001%
过去三个月	0.4641%	0.0004%	0.2693%	0.0000%	0.1948%	0.0004%
过去六个月	0.9005%	0.0004%	0.5356%	0.0000%	0.3649%	0.0004%
过去一年	1.6459%	0.0006%	1.0800%	0.0000%	0.5659%	0.0006%
过去三年	5.8884%	0.0009%	3.2400%	0.0000%	2.6484%	0.0009%
自基金合同生效	18.7068%	0.0024%	7.3470%	0.0000%	11.3598%	0.0024%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

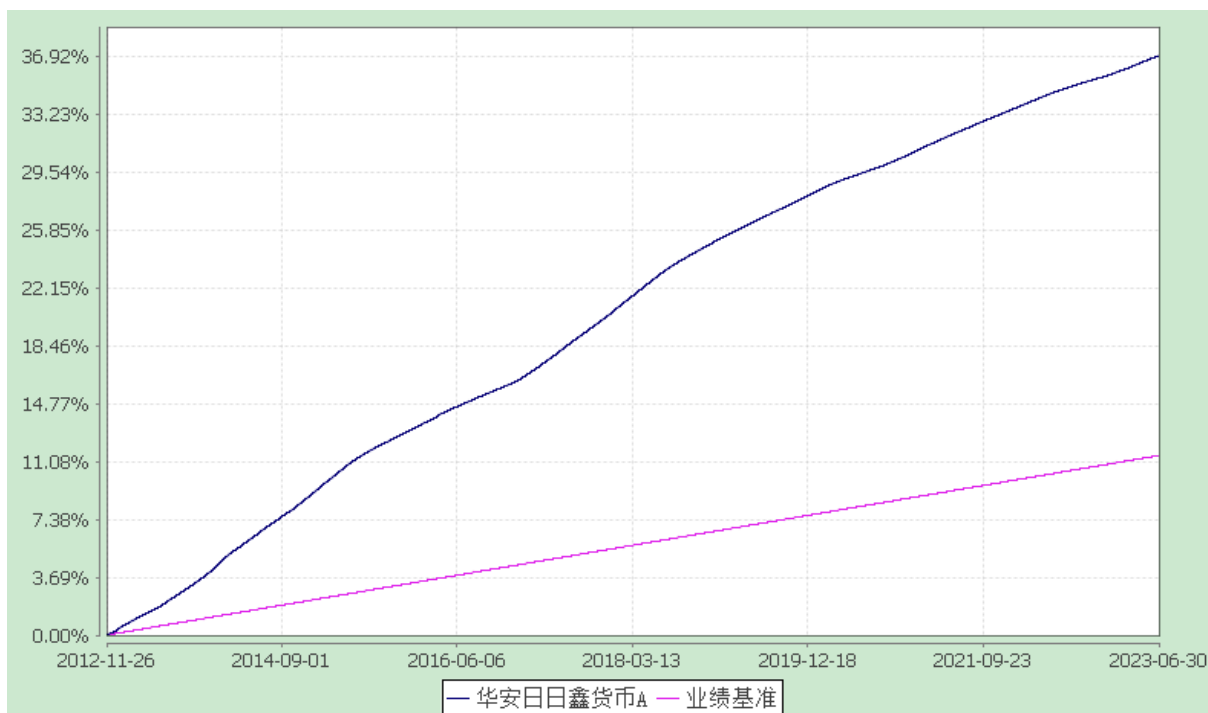
注：自 2016 年 9 月 12 日起,本基金增设 H 类份额，简称为“货币 ETF”。

3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额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

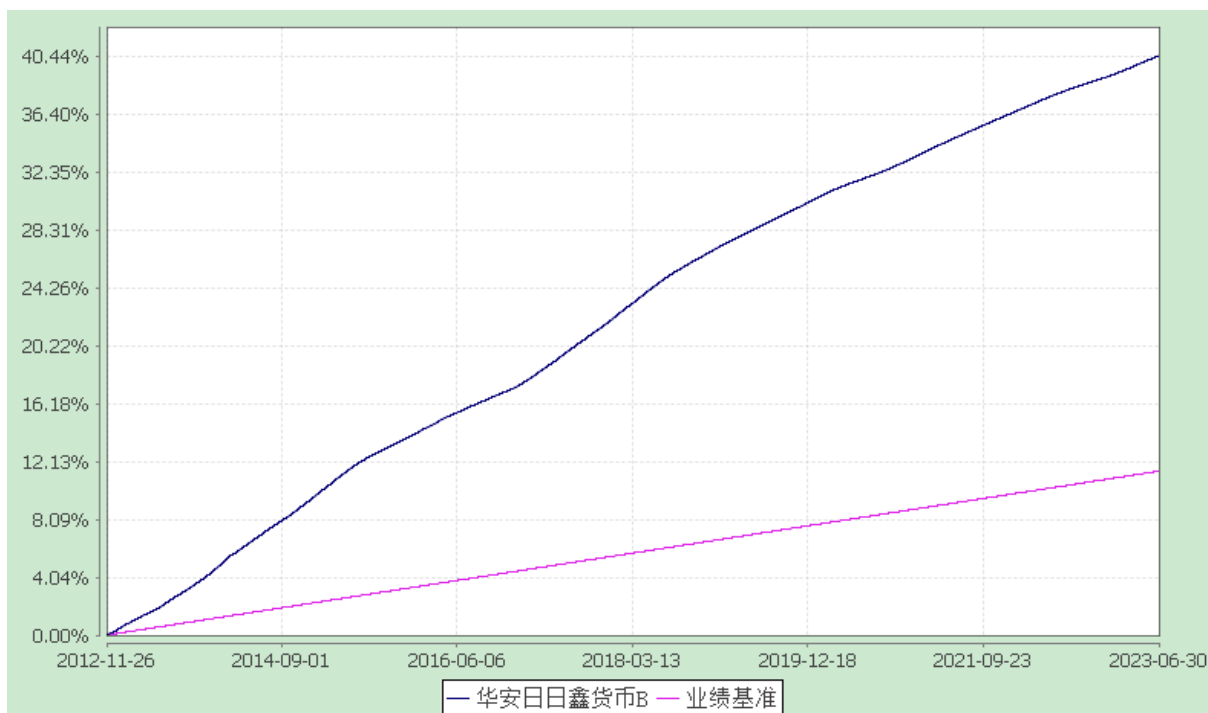
华安日日鑫货币市场基金

自基金合同生效以来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 2023 年 6 月 30 日)

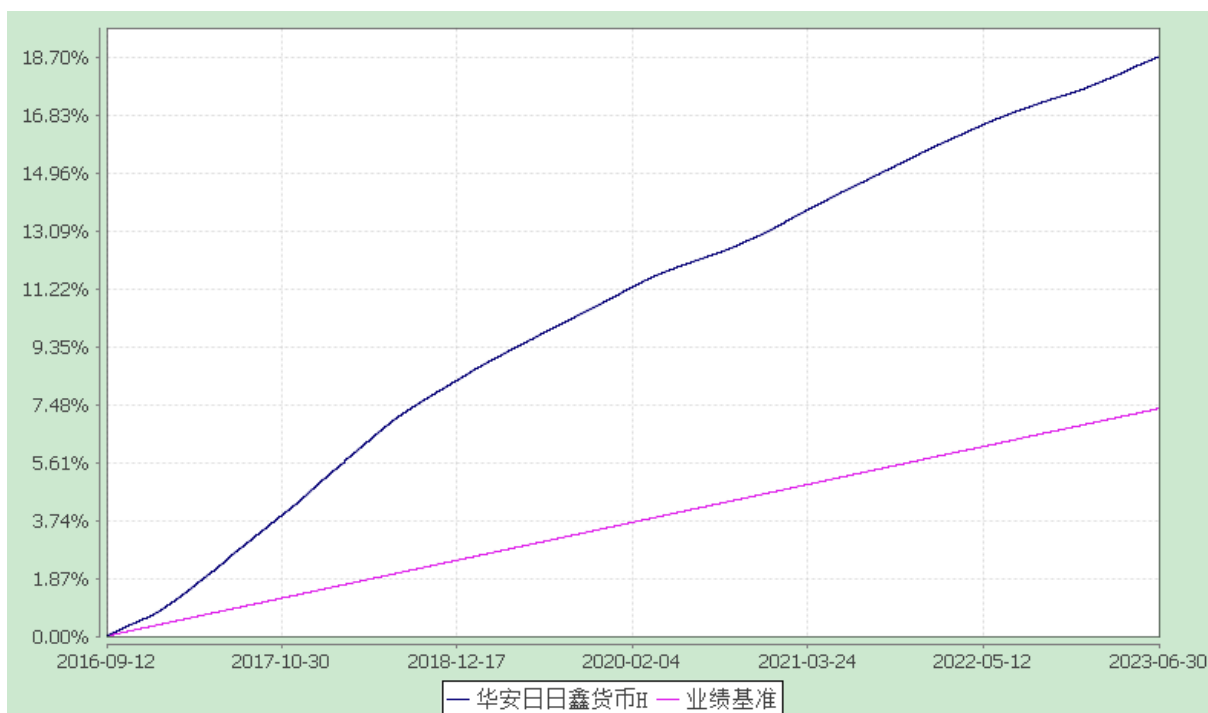
华安日日鑫货币 A



华安日日鑫货币 B



华安日日鑫货币 H



注：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。

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。

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

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2023 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 239 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,023.30 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
李邦长	本基金的 基金经 理、固定 收益部助 理总监	2016-03-02	-	13 年	硕士研究生，13 年基金行业从业经历，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 月至 2019 年 12 月，同时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的基金经理。2016 年 3 月起，同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。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 月至 2022 年 2 月，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。2019 年 7 月起，同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经

					理。2021 年 3 月起，同时担任华安现金宝货币市场基金、华安现金富利投资基金、华安现金润利浮动净值型发起式货币市场基金的基金经理。2022 年 6 月起，同时担任华安中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期发起式证券投资基金的基金经理。
孙丽娜	本基金的基金经理	2021-03-08	-	12 年	硕士研究生，12 年基金行业从业经验。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、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 月至 2023 年 3 月，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 月至 2021 年 3 月，同时担任华安添颐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 月至 2021 年 3 月，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 月至 2020 年 1 月，同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。2018 年 5 月至 2020 年 10 月，同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2018 年 9 月至 2021 年 3 月，同时担任华安安浦债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月起，同时担任华安鑫福 42 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 1 月起，同时担任华安鑫浦 87 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起，

					同时担任华安汇财通货币市场基金、华安日日鑫货币市场基金、华安现金宝货币市场基金、华安现金润利浮动净值型发起式货币市场基金的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 3 月，同时担任华安添祥 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。
庄文清	本基金的基金经理助理	2021-03-09	-	7 年	硕士研究生，7 年金融、基金行业从业经验。曾任上海国利货币经纪有限公司固定收益部交易员。2017 年 2 月加入华安基金，历任集中交易部交易员。现任固定收益部基金经理助理。

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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，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 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

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》，将各投资组合在研究分析、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、邮件发送、登录在研究报告管理系统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，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，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，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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

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》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、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。同时加强了对各类投资组合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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，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，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 7 次，未出现异常交易。

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

上半年，国内经济在一季度稳增长政策靠前发力背景下，工业生产加快修复速度，投资稳步增长，消费好转但结构性特征明显，但进入二季度，经济需求端疲软特征显现，复苏斜率有所放缓，除了基建投资稳定性较强外，房地产和制造业投资增速均有不同程度的下行，消费表现偏弱，地产

销售也未见明显改善，国内出口因外需呈下行趋势，未来可能面临一定程度的压力。央行货币政策维持稳健基调，通过实施降准、降息、公开市场操作等措施维稳资金面，并支持实体经济发展。市场表现方面，一季度债市受信贷超预期、流动性呈紧平衡状态以及三月份降准等多空因素影响，各期限各品种走势分化明显；二季度债市受流动性宽松、降息等因素推动，各期限各品种收益率下行明显。从数据表现来看，上半年 1Y 期国债利率下行 22bp，10Y 期国债利率下行 20bp，3-5Y 期中高等级中短期票据收益率下行幅度在 39-55bp 区间，各期限品种信用利差有所收窄。

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，为持有人赚取收益。

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：0.9004% 比较基准：0.5356%

华安日日鑫货币 B:

投资回报：1.0205% 比较基准：0.5356%

华安日日鑫货币 H:

投资回报：0.9005% 比较基准：0.5356%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，积极的财政加力提效主基调将继续保持，政策维持对房地产市场、消费等行业的支持力度，国内经济进入复苏进程。通胀方面，由于需求扩张速度偏弱，通胀超预期上行的风险较低，维持温和水平。流动性方面，预计央行将继续实施稳健的货币政策以支持实体经济发展，资金面总体将维持平稳，债券市场仍存交易性机会。

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，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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配。本报告期华安日日鑫货币 A 累计收益分配金额 1,465,783,570.63 元，华安日日鑫货币 B 累计收益分配金额 12,783,719.83 元，华安日日鑫货币 H 累计收益分配金额 227,459.49 元。

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

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 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，中国建设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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期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：华安日日鑫货币市场基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	85,740,562,118.05	54,730,648,274.96
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	75,762,960,276.03	78,080,129,764.61
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		75,762,960,276.03	78,080,129,764.61
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	11,194,497,869.52	32,685,722,534.33
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		123,135.43	13,258,829.96

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		172,698,143,399.03	165,509,759,403.86
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		8,519,832,211.47	3,075,113,719.24
应付清算款		101,910,254.79	-
应付赎回款		102,873.25	1,970.44
应付管理人报酬		33,587,322.40	34,231,414.62
应付托管费		13,434,928.97	13,692,565.82
应付销售服务费		33,395,333.19	33,901,540.01
应付投资顾问费		-	-
应交税费		468,557.81	606,616.84
应付利润		7,774,671.24	15,230,469.75
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,619,525.94	1,716,522.98
负债合计		8,712,125,679.06	3,174,494,819.70
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	163,986,017,719.97	162,335,264,584.16
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		163,986,017,719.97	162,335,264,584.16
负债和净资产总计		172,698,143,399.03	165,509,759,403.86

注：报告截至日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 163,986,017,719.97 份，其中 A 类基金份额总额 163,073,674,456.46 份；B 类基金份额总额 889,248,075.03 份；H 类基金份额总额 23,095,188.48 份。

6.2 利润表

会计主体：华安日日鑫货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,976,444,068.27	2,087,380,448.18
1.利息收入		1,124,479,470.51	1,154,643,249.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	711,774,459.61	643,766,368.14

债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		412,705,010.90	510,876,881.14
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		851,964,597.76	932,736,998.90
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	851,964,597.76	930,722,520.52
资产支持证券投资收益		-	2,014,478.38
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	200.00
减：二、营业总支出		497,649,318.32	537,157,701.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2	204,370,892.60	204,665,030.90
2. 托管费	6.4.10.2	81,748,356.99	81,866,012.34
3. 销售服务费	6.4.10.2	202,889,464.76	201,564,217.30
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		8,081,652.02	48,306,984.14
其中：卖出回购金融资产支出		8,081,652.02	48,306,984.14
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		353,636.52	545,644.62
8. 其他费用	6.4.7.16	205,315.43	209,812.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,478,794,749.95	1,550,222,746.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,478,794,749.95	1,550,222,746.27
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,478,794,749.95	1,550,222,746.27

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安日日鑫货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	162,335,264,584.16	-	-	162,335,264,584.16
二、本期期初净资产（基金净值）	162,335,264,584.16	-	-	162,335,264,584.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,650,753,135.81	-	-	1,650,753,135.81
（一）、综合收益总额	-	-	1,478,794,749.95	1,478,794,749.95
（二）、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）	1,650,753,135.81	-	-	1,650,753,135.81
其中：1.基金申购款	955,791,417,446.81	-	-	955,791,417,446.81
2.基金赎回款	-954,140,664,311.00	-	-	-954,140,664,311.00
（三）、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）	-	-	-1,478,794,749.95	-1,478,794,749.95
四、本期期末净资产（基金净值）	163,986,017,719.97	-	-	163,986,017,719.97
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	161,807,700,234.70	-	-	161,807,700,234.70
二、本期期初净资产（基金净值）	161,807,700,234.70	-	-	161,807,700,234.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,210,019,786.25	-	-	4,210,019,786.25
（一）、综合收益总额	-	-	1,550,222,746.27	1,550,222,746.27
（二）、本期基金份额交易产生的	4,210,019,786.25	-	-	4,210,019,786.25

基金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)				
其中：1.基金申 购款	1,096,213,091,084.50	-	-	1,096,213,091, 084.50
2.基金赎回款	-1,092,003,071,298.25	-	-	-1,092,003,07 1,298.25
(三)、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)	-	-	-1,550,222,746.27	-1,550,222,74 6.27
四、本期期末净 资产(基金净值)	166,017,720,020.95	-	-	166,017,720,0 20.95

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈松一

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安日日鑫货币市场基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]1442 号文《关于核准华安日日鑫货币市场基金募集的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2012 年 11 月 26 日生效，首次设立募集规模为 926,777,863.81 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金自 2016 年 8 月 30 日起增加 H 类基金份额，A 类基金份额和 B 类基金份额在场外申购和赎回，H 类基金份额在场内申购和赎回。本基金每份 A 类基金份额和 B 类基金份额的面值为人民币 1.00 元，每份 H 类基金份额的面值为人民币 100.00 元。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，托管人为中国建设银行股份有限公司，A 类基金份额和 B 类基金份额的注册登记机构为华安基金管理有限公司，H 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

本基金根据基金份额持有人持有本基金场外份额的数量，对基金份额持有人持有的场外基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成不同的基金份额类别：A 类基金份额和 B 类基金份额。若基金份额持有人在单个基金交易账户保留的 A 类基金份额达到或超过 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金交易账户保留的 A 类基金份额全部升级为 B 类基金份额。若基金份额持有人在单个基金交易账户保留的 B 类基金份额低于 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将

其在该基金交易账户保留的 B 类基金份额全部降级为 A 类基金份额。H 类基金份额不进行基金份额升降级。

本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：现金、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、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金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准：同期七天通知存款利率（税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 所采用的会计政策上年度会计报表相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》

及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	185,717,721.57
等于：本金	185,685,601.55
加：应计利息	32,120.02
定期存款	85,554,844,396.48
等于：本金	85,220,000,000.00
加：应计利息	334,844,396.48
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	6,302,511,666.59
存款期限 3 个月以上	79,252,332,729.89
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	85,740,562,118.05

- 注：1. 定期存款的存款期限为定期存款的票面存期。
2. 本基金本期发生定期存款提前支取的情况，适用利率不变。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	202,542,465.76	203,042,465.76	500,000.00	0.0003
	银行间市场	75,560,417,810.27	75,581,116,835.54	20,699,025.27	0.0126
	合计	75,762,960,276.03	75,784,159,301.30	21,199,025.27	0.0129
资产支持证券		-	-	-	-
合计		75,762,960,276.03	75,784,159,301.30	21,199,025.27	0.0129

- 注：1、偏离金额=影子定价－摊余成本；
2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	11,194,497,869.52	-
合计	11,194,497,869.52	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,341,594.21
其中：交易所市场	-
银行间市场	1,341,594.21
应付利息	-
预提账户维护费	9,000.00
预提审计费	209,424.36
预提信息披露费	59,507.37
合计	1,619,525.94

6.4.7.7 实收基金

华安日日鑫货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	161,423,873,509.53	161,423,873,509.53
本期申购	954,448,153,054.08	954,448,153,054.08
本期赎回（以“-”号填列）	-952,798,352,107.15	-952,798,352,107.15
本期末	163,073,674,456.46	163,073,674,456.46

华安日日鑫货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	893,616,835.91	893,616,835.91
本期申购	1,317,331,261.28	1,317,331,261.28

本期赎回（以“-”号填列）	-1,321,700,022.16	-1,321,700,022.16
本期末	889,248,075.03	889,248,075.03

华安日日鑫货币 H

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,774,238.72	17,774,238.72
本期申购	25,933,131.45	25,933,131.45
本期赎回（以“-”号填列）	-20,612,181.69	-20,612,181.69
本期末	23,095,188.48	23,095,188.48

注：（1）申购含红利再投、转换入和 A 类基金份额与 B 类基金份额之间自动升降级而增加的基金份额，赎回含转换出和 A 类基金份额与 B 类基金份额之间自动升降级而减少的基金份额。

（2）H 类基金份额净值为 100.00 元，本表所列 H 类基金份额数据面值已折算为 1.00 元。

6.4.7.8 未分配利润

华安日日鑫货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	1,465,783,570.63	-	1,465,783,570.63
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-1,465,783,570.63	-	-1,465,783,570.63
本期末	-	-	-

华安日日鑫货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	12,783,719.83	-	12,783,719.83
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-12,783,719.83	-	-12,783,719.83

本期末	-	-	-
-----	---	---	---

华安日日鑫货币 H

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	227,459.49	-	227,459.49
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-227,459.49	-	-227,459.49
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	426,553.39
定期存款利息收入	711,338,369.26
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,536.96
其他	-
合计	711,774,459.61

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	852,214,724.52
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-250,126.76
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	851,964,597.76

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	106,498,333,780.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	106,013,993,365.27
减：应计利息总额	484,590,542.26
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-250,126.76

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.14 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.15 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	69,424.36
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	57,783.70
预提账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	205,315.43

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

无。

6.4.9.2 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
华安基金管理有限公司（“华安基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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
国泰君安证券股份有限公司	-	-	110,579,372.60	22.37%

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	204,370,892.60	204,665,030.90
其中：支付销售机构的客户维护费	101,377,770.59	100,705,761.54

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	81,748,356.99	81,866,012.34

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关	本期
------------	----

关联方名称	2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	华安日日鑫货币 A	华安日日鑫货 币 B	华安日日鑫货币 H	合计
国泰君安证券股份有限公 司	-	-	557.70	557.70
华安基金管理有限公司	51,149.70	60,149.57	17,900.07	129,199.34
中国建设银行股份有限公司	27,546.11	15.76	-	27,561.87
合计	78,695.81	60,165.33	18,457.77	157,318.91
获得销售服务费的各关 联方名称	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	华安日日鑫货币 A	华安日日鑫货 币 B	华安日日鑫货币 H	合计
国泰君安证券股份有限公 司	-	-	408.77	408.77
华安基金管理有限公司	29,353.56	125,343.72	15,192.34	169,889.62
中国建设银行股份有限公司	33,005.85	34.02	-	33,039.87
合计	62,359.41	125,377.74	15,601.11	203,338.26

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。H 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，且不适用基金份额升降级规则。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额的销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2023年1月1日至2023年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
建设银行	-	1,689,925.4	-	-	9,900,500,000.	1,510,927

		00.00			00	.66
国泰君安	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
建设银行	-	-	-	-	8,000,000,000.00	2,597,917.81
国泰君安	-	-	19,294,000,000.00	13,034,771.20	-	-

6.4.10.4 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中国建设银行	15,038,690,500.13	100,741,832.16	6,167,848,281.24	2,775,842.18

6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

6.4.10.6.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

1、华安日日鑫货币 A

单位：人民币元

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	本期利润分 配合计	备注
1,473,191,255.73	-	-7,407,685.10	1,465,783,570.63	-

2、华安日日鑫货币 B

单位：人民币元

已按再投资形式转	直接通过应付	应付利润	本期利润分	备注
----------	--------	------	-------	----

实收基金	赎回款转出金额	本年变动	配合计	
12,831,261.28	-	-47,541.45	12,783,719.83	-

3、华安日日鑫货币 H

单位：人民币元

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	本期利润分 配合计	备注
228,031.45	-	-571.96	227,459.49	-

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金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人民币 8,519,832,211.47,是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
210213	21 国开 13	2023-07-03	100.70	10,500,000.00	1,057,342,296.20
210213	21 国开 13	2023-07-03	100.70	10,000,000.00	1,006,992,663.05
220306	22 进出 06	2023-07-03	101.50	8,300,000.00	842,412,545.89
210213	21 国开 13	2023-07-03	100.70	7,500,000.00	755,244,497.29
220211	22 国开 11	2023-07-03	101.57	7,200,000.00	731,309,585.55
210213	21 国开 13	2023-07-03	100.70	7,000,000.00	704,894,864.14
112310175	23 兴业银行 CD175	2023-07-04	99.62	5,620,000.00	559,870,403.37
200407	20 农发 07	2023-07-03	102.83	5,100,000.00	524,455,608.92
112306133	23 交通银行 CD133	2023-07-05	97.90	4,200,000.00	411,188,366.41
220216	22 国开 16	2023-07-03	100.89	3,400,000.00	343,031,226.25
112321209	23 渤海银行 CD209	2023-07-05	99.02	3,300,000.00	326,776,707.99
092118003	21 农发清发	2023-07-03	102.42	3,100,000.00	317,512,303.27

	03				
2304107	23 农发贴现 07	2023-07-03	99.62	2,500,000.00	249,060,831.24
200313	20 进出 13	2023-07-03	102.96	2,200,000.00	226,504,744.19
200407	20 农发 07	2023-07-03	102.83	1,900,000.00	195,385,422.93
200207	20 国开 07	2023-07-03	102.76	1,400,000.00	143,866,903.16
112321209	23 渤海银行 CD209	2023-07-05	99.02	1,450,000.00	143,583,705.03
130240	13 国开 40	2023-07-03	104.30	1,000,000.00	104,303,041.62
2304105	23 农发贴现 05	2023-07-03	99.70	1,000,000.00	99,702,118.76
2304106	23 农发贴现 06	2023-07-03	99.67	1,000,000.00	99,670,739.61
130247	13 国开 47	2023-07-03	104.27	800,000.00	83,418,183.39
220308	22 进出 08	2023-07-03	101.04	100,000.00	10,104,277.06
合计				88,570,000.00	8,936,631,035.32

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币市场基金，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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金为满足投资人现金管理和日常理财需求，在力求本金安全、确保基金资产流动性的基础上，追求稳健的当期收益，谋求资产的稳定增值。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损

失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20% 以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30% 以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券),并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天,平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天,且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天,平均剩余存续期不得超过 180 天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天,平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月 30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	80,463,251,284.54	5,277,310,833.51	-	-	85,740,562,118.05
交易性金融资产	68,839,861,227.86	6,923,099,048.17	-	-	75,762,960,276.03
买入返售金融资产	11,194,497,869.52	-	-	-	11,194,497,869.52
应收清算款	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	123,135.43	123,135.43
资产总计	160,497,610,381.92	12,200,409,881.68	-	123,135.43	172,698,143,399.03
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	8,519,832,211.47	-	-	-	8,519,832,211.47
应付证券清	-	-	-	101,910,254.79	101,910,254.79

算款					4.79
应付赎回款	-	-	-	102,873.25	102,873.25
应付管理人报酬	-	-	-	33,587,322.40	33,587,322.40
应付托管费	-	-	-	13,434,928.97	13,434,928.97
应付销售服务费	-	-	-	33,395,333.19	33,395,333.19
应交税费	-	-	-	468,557.81	468,557.81
应付利润	-	-	-	7,774,671.24	7,774,671.24
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,619,525.94	1,619,525.94
负债总计	8,519,832,211.47	-	-	192,293,467.59	8,712,125,679.06
利率敏感度缺口	151,977,778,170.45	12,200,409,881.68	-	-192,170,332.16	163,986,017,719.97
上年度末 2022 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	51,569,641,635.69	3,161,006,639.27	-	-	54,730,648,274.96
交易性金融资产	74,586,961,083.65	3,493,168,680.96	-	-	78,080,129,764.61
买入返售金融资产	32,685,722,534.33	-	-	-	32,685,722,534.33
应收清算款	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	13,258,829.96	13,258,829.96
资产总计	158,842,325,253.67	6,654,175,320.23	-	13,258,829.96	165,509,759,403.86
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	3,075,113,719.24	-	-	-	3,075,113,719.24
应付证券清算款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	1,970.44	1,970.44
应付管理人报酬	-	-	-	34,231,414.62	34,231,414.62
应付托管费	-	-	-	13,692,565.82	13,692,565.82
应付销售服务费	-	-	-	33,901,540.01	33,901,540.01
应交税费	-	-	-	606,616.84	606,616.84
应付利润	-	-	-	15,230,469.75	15,230,469.75
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,716,522.98	1,716,522.98
负债总计	3,075,113,719.24	-	-	99,381,100.46	3,174,494,819.70
利率敏感度缺口	155,767,211,534.43	6,654,175,320.23	-	-86,122,270.50	162,335,264,584.16

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了归类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-63,531,083.44	-54,718,812.48
	市场利率下降 25 个基点	63,637,927.80	54,811,726.15

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上期末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	75,762,960,276.03	78,080,129,764.61
第三层次	-	-
合计	75,762,960,276.03	78,080,129,764.61

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。本基金本报告期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，除债权投资外，其余金融工具因其剩余期限较短，因此账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

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	75,762,960,276.03	43.87
	其中：债券	75,762,960,276.03	43.87
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	11,194,497,869.52	6.48
	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	85,740,562,118.05	49.65
4	其他各项资产	123,135.43	0.00
5	合计	172,698,143,399.03	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	0.59	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	8,519,832,211.47	5.20
	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%。

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	115
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

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。

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	9.70	5.19
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	2.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	39.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	7.00	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	45.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		105.00	5.19

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

报告期内投资组合无平均剩余存续期超过 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,328,007,743.59	5.08
	其中：政策性金融债	8,328,007,743.59	5.08
4	企业债券	202,542,465.76	0.12
5	企业短期融资券	7,753,607,867.08	4.73
6	中期票据	1,182,407,176.23	0.72
7	同业存单	58,296,395,023.37	35.55
8	其他	-	-
9	合计	75,762,960,276.03	46.20
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按实际利率计算账面价值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)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	210213	21 国开 13	35,900,000	3,615,103,660.35	2.20
2	112380626	23 广州银行 CD030	21,000,000	2,079,949,024.25	1.27
3	112380277	23 南京银行 CD071	20,000,000	1,992,275,565.48	1.21
4	112380606	23 成都银行 CD124	20,000,000	1,980,904,653.37	1.21
5	112380611	23 徽商银行 CD081	20,000,000	1,980,819,825.91	1.21
6	112321209	23 渤海银行 CD209	20,000,000	1,980,464,896.93	1.21
7	112380643	23 贵阳银行 CD102	20,000,000	1,980,464,896.92	1.21
8	112382015	23 中原银行 CD234	20,000,000	1,977,319,760.48	1.21
9	112380344	23 广州银行 CD028	19,000,000	1,892,554,686.39	1.15
10	112395323	23 徽商银行 CD035	18,000,000	1,789,689,064.21	1.09

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0322%
报告期内偏离度的最低值	0.0011%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0161%

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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 基金计价方法说明

本基金计价采用实际利率法，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。

7.9.22022 年 7 月 8 日，成都银行因侵害消费者个人信息依法得到保护的权利、漏报金融消费者投诉

数据等违法违规事项，被中国人民银行成都分行（成银罚字〔2022〕20号）给予警告、并罚款194.6万元的行政处罚。2022年12月13日，成都银行因违规发放土地储备贷款、违规置换他行贷款、贷款风险分类不准确、违规向不符合信贷条件的项目承接主体授信，严重违反审慎经营规则，被中国银行保险监督管理委员会四川监管局（川银保监罚决字〔2022〕95号）给予罚款人民币650万元的行政处罚。

2023年5月23日，徽商银行因未按规定开展持续的客户身份识别等违法违规事项，被中国人民银行合肥中心支行（合银罚决字〔2023〕16号）给予罚款人民币431.33万元的行政处罚。

2023年2月16日，渤海银行因小微企业贷款风险分类不准确、小微企业贷款资金被挪用于购买理财产品等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2023〕8号）给予对总行罚款430万元，对分支机构罚款1230万元，合计罚款1660万元的行政处罚。2023年2月17日，渤海银行因风险加权资产计算不准确、流动性风险指标计算不准确等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2023〕21号）给予罚款860万元的行政处罚。2023年2月28日，渤海银行因违反存款准备金管理规定、违反账户管理规定等违法违规事项，被中国人民银行（银罚决字〔2023〕16号）给予警告，没收违法所得106.98706万元，并处罚款1589.486898万元。

2022年12月29日，中原银行因未按规定履行客户身份识别义务、与身份不明的客户进行交易，被中国人民银行郑州中心支行（郑银罚决字〔2022〕23号）给予罚款78万元的行政处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名其他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。

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	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	123,135.43
5	其他应收款	-

6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	123,135.43

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
华安日日鑫货币 A	19,651,130	8,298.44	32,051,184.88	0.02%	163,041,623,27 1.58	99.98%
华安日日鑫货币 B	36	24,701,335. 42	876,435,566.45	98.56%	12,812,508.58	1.44%
华安日日鑫货币 H	343	67,332.91	6,867,796.80	29.74%	16,227,391.68	70.26%
合计	19,651,509	8,344.70	915,354,548.13	0.56%	163,070,663,17 1.84	99.44%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、本基金场内基金份额（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。

8.2 期末上市基金前十名持有人

华安日日鑫货币 H

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	华泰证券股份有限公司	4,725,600.00	20.46%
2	北京中科天宁投资有限责任公司	1,059,700.00	4.59%
3	叶明骅	1,030,100.00	4.46%
4	西安蒲公英基金管理有限公司—蒲公英ETF混合FOF私募证券投资基金	1,003,200.00	4.34%
5	王蓉	735,000.00	3.18%
6	王文英	674,000.00	2.92%
7	陈武军	583,100.00	2.53%
8	朱永芳	559,100.00	2.42%
9	黄莹	530,000.00	2.30%
10	李亚婕	478,500.00	2.07%

注：本基金场内基金份额（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。

8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	799,299,990.18	0.49%
2	基金类机构	73,524,760.08	0.04%
3	个人	21,543,247.74	0.01%
4	个人	15,932,335.29	0.01%
5	个人	15,065,169.52	0.01%
6	个人	14,032,280.44	0.01%
7	个人	13,283,356.99	0.01%
8	个人	13,211,774.87	0.01%
9	个人	12,591,353.81	0.01%
10	个人	11,787,788.30	0.01%

8.4 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	华安日日鑫货币 A	2,491,165.21	0.00%
	华安日日鑫货币 B	0.00	0.00%
	华安日日鑫货币 H	0.00	0.00%
	合计	2,491,165.21	0.00%

8.5 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	华安日日鑫货币 A	0~10

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华安日日鑫货币 B	-
	华安日日鑫货币 H	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华安日日鑫货币 A	0~10
	华安日日鑫货币 B	-
	华安日日鑫货币 H	-
	合计	0~10

9 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
基金合同生效日（2012 年 11 月 26 日）基金份额总额	575,145,376.19	351,632,487.62	-
本报告期期初基金份额总额	161,423,873,509.53	893,616,835.91	17,774,238.72
本报告期基金总申购份额	954,448,153,054.08	1,317,331,261.28	25,933,131.45
减：本报告期基金总赎回份额	952,798,352,107.15	1,321,700,022.16	20,612,181.69
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	163,073,674,456.46	889,248,075.03	23,095,188.48

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。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	
招商证券	3	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

上海证券	3	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

(1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求，可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无

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		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
招商证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	1,190,390,000.00	84.50%	-	-
华泰证券	-	-	218,329,000.00	15.50%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安日日鑫货币市场基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-01-20
2	华安日日鑫货币市场基金 2022 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-30
3	华安日日鑫货币市场基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-04-21
4	华安日日鑫货币市场基金更新的招募说明书 (2023 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-05-29
5	华安日日鑫货币市场基金 (华安日日鑫货币 A) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-05-29
6	华安日日鑫货币市场基金 (华安日日鑫货币 B) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-05-29
7	华安日日鑫货币市场基金 (华安日日鑫货币 H) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-05-29

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

§11 影响投资者决策的其他重要信息**11.1 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。

12 备查文件目录**12.1 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招募说明书》

- 3、《华安日日鑫货币市场基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安日日鑫货币市场基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

12.2 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>。

12.3 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

二〇二三年八月三十日