

华安现金富利投资基金

2011 年年度报告

2011 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年三月二十九日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
§ 2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	5
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4	管理人报告	11
4.1	基金管理人及基金经理情况	11
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2	托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§ 6	审计报告	17
6.1	管理层对财务报表的责任	17
6.2	注册会计师的责任	17
6.3	审计意见	18
§ 7	年度财务报表	18
7.1	资产负债表	18
7.2	利润表	20
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4	报表附注	22
§ 8	投资组合报告	43
8.1	期末基金资产组合情况	43
8.2	债券回购融资情况	43
8.3	基金投资组合平均剩余期限	44
8.4	期末按债券品种分类的债券投资组合	45
8.5	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	45
8.6	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	46
8.7	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	46
8.8	投资组合报告附注	46

§ 9	基金份额持有人信息.....	47
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	47
§ 10	开放式基金份额变动.....	48
§ 11	重大事件揭示.....	48
11.1	基金份额持有人大会决议.....	48
11.2	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.....	48
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
11.4	基金投资策略的改变.....	49
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....	49
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
11.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	51
11.9	其他重大事件.....	51
§ 12	备查文件目录.....	54
12.1	备查文件目录.....	54
12.2	存放地点.....	54
12.3	查阅方式.....	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安现金富利投资基金	
基金简称	华安现金富利货币	
交易代码	040003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003 年 12 月 30 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	18,392,242,612.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B
下属分级基金的交易代码	040003	041003
报告期末下属分级基金的份 额总额	4,502,316,916.62 份	13,889,925,695.69 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是在资本保全的情况下，确保基金资产的高流动性，追求稳健的当期收益，并为投资者提供暂时的流动性储备。
投资策略	基金管理人将充分发挥自身的研究力量，利用公司研究开发的各种数量模型工具，采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，发现和捕捉短期资金市场的机会，实现基金的投资目标。 1、资产配置策略： 本基金在实际操作中主要依据各短期金融工具细分市场的规模、流动性和当时的利率环境，建立动态规划模型，通过求解确定不同资产配置比例和同类资产的基于不同利率期限结构的配置比例。 2、其它操作策略： 套利操作：根据各细分短期金融工具的流动性和收益特征，动态调整基金资产在各个细分市场之间的配置比例。比如，当交易所市场回购利率高于银行间市场回购利率时，可通过增加交易所市场回购的配置比例，或在银行间市场融资、交易所市场融券而实现跨市场套利。 期差操作：根据各细分市场中不同品种的风险收益特征，动态调整不同利率期限结构品种的配置比例。比如，短期

	回购利率低于长期回购利率时，在既定的变现率水平下，可通过增长长期回购的配置比例，或短期融资、长期融券而实现跨品种套利。 滚动配置：根据具体投资品种的市场特性，采用持续投资的方法，以提高基金资产的整体变现能力。例如，对 N 天期回购协议可每天进行等量配置，而提高配置在回购协议上的基金资产的流动性。 利率预期：在深入分析财政、货币政策以及短期资金市场、资本市场资金面的情况和流动性的基础上，对利率走势形成合理预期，并据此调整基金资产配置策略。
业绩比较基准	以当期银行个人活期储蓄利率（税前）作为衡量本基金操作水平的比较基准。
风险收益特征	本基金面临与其他开放式基金相同的风险（例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等），但由于本基金是以短期金融工具投资为主的低风险开放式基金，上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为：利率风险 信用风险，流动性风险等。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	赵会军
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		上海市浦东南路360号新上海国际大厦38楼	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		李勃	姜建清

2.4 信息披露方式

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

	32层
--	-----

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
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、32层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011 年		2010 年		2009 年 12 月 23 日-2009 年 12 月 31 日	
	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B
本期已实现收益	70,728,934.90	194,632,419.24	36,180,638.72	100,504,030.26	176,699,370.64	2,660,170.96
本期利润	70,728,934.90	194,632,419.24	36,180,638.72	100,504,030.26	176,699,370.64	2,660,170.96
本期基金份额净值收益率	3.5206%	3.7680%	1.8614%	2.1059%	1.4998%	0.0465%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末		2010 年末		2009 年末	
	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B
期末基金资产净值	4,502,316,916.62	13,889,925,695.69	1,721,805,120.53	7,257,428,794.68	1,992,153,839.24	12,116,082,260.96
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2011 年末		2010 年末		2009 年末	
	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B

基金份额 额累计 净值收 益率	22.4960%	6.0023%	18.3303%	2.1533%	16.1680%	0.0465%
--------------------------	----------	---------	----------	---------	----------	---------

注：1、本基金收益分配按月结转份额。

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，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。

3、自 2009 年 12 月 23 日起，本基金实行销售服务费分级收费方式，分设两级基金份额：A 级基金份额和 B 级基金份额。详情请参阅相关公告。

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. 华安现金富利货币 A

阶段	份额净值 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	1.0736%	0.0024%	0.1260%	0.0000%	0.9476%	0.0024%
过去六个月	1.8630%	0.0032%	0.2521%	0.0000%	1.6109%	0.0032%
过去一年	3.5206%	0.0028%	0.4697%	0.0001%	3.0509%	0.0027%
过去三年	7.0289%	0.0038%	1.1897%	0.0002%	5.8392%	0.0036%
过去五年	14.4219%	0.0056%	2.6349%	0.0005%	11.7870%	0.0051%
自基金合同生效起 至今	22.4960%	0.0050%	4.8008%	0.0005%	17.6952%	0.0045%

2. 华安现金富利货币 B

阶段	份额净值 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	1.1339%	0.0024%	0.1260%	0.0000%	1.0079%	0.0024%
过去六个月	1.9855%	0.0032%	0.2521%	0.0000%	1.7334%	0.0032%
过去一年	3.7680%	0.0028%	0.4697%	0.0001%	3.2983%	0.0027%
自基金合同生 效起至今	6.0023%	0.0035%	0.8386%	0.0002%	5.1637%	0.0033%

注：自 2009 年 12 月 23 日起，本基金实行销售服务费分级收费方式，分设两级基金份额：A 级基金份额和 B 级基金份额。详情请参阅相关公告。

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

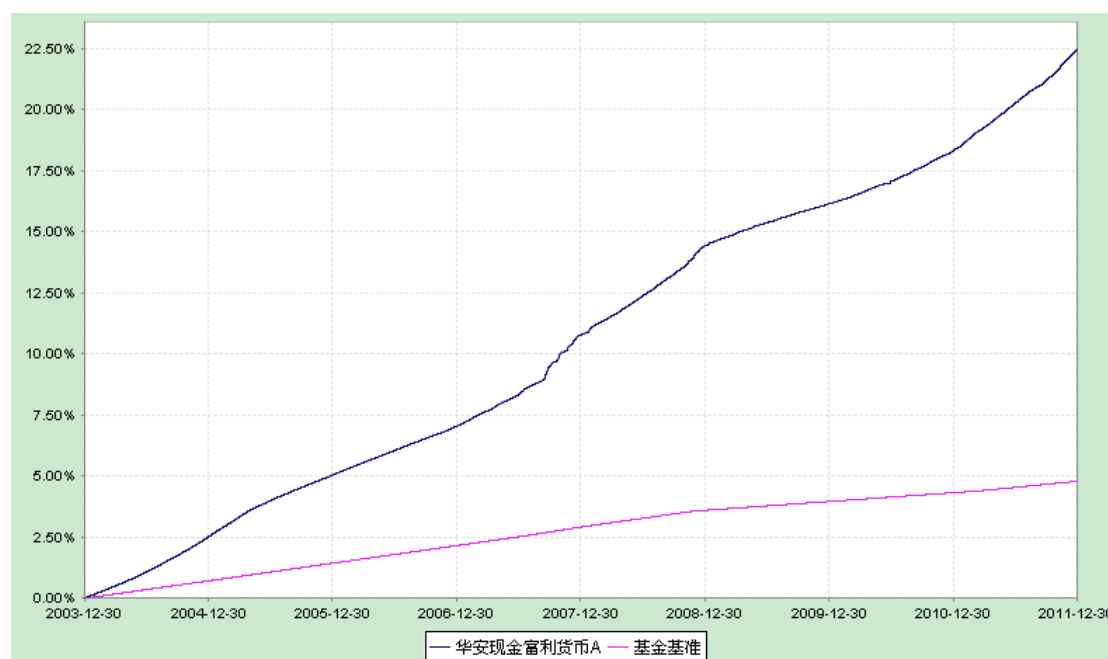
华安现金富利投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2003 年 12 月 30 日至 2011 年 12 月 31 日)

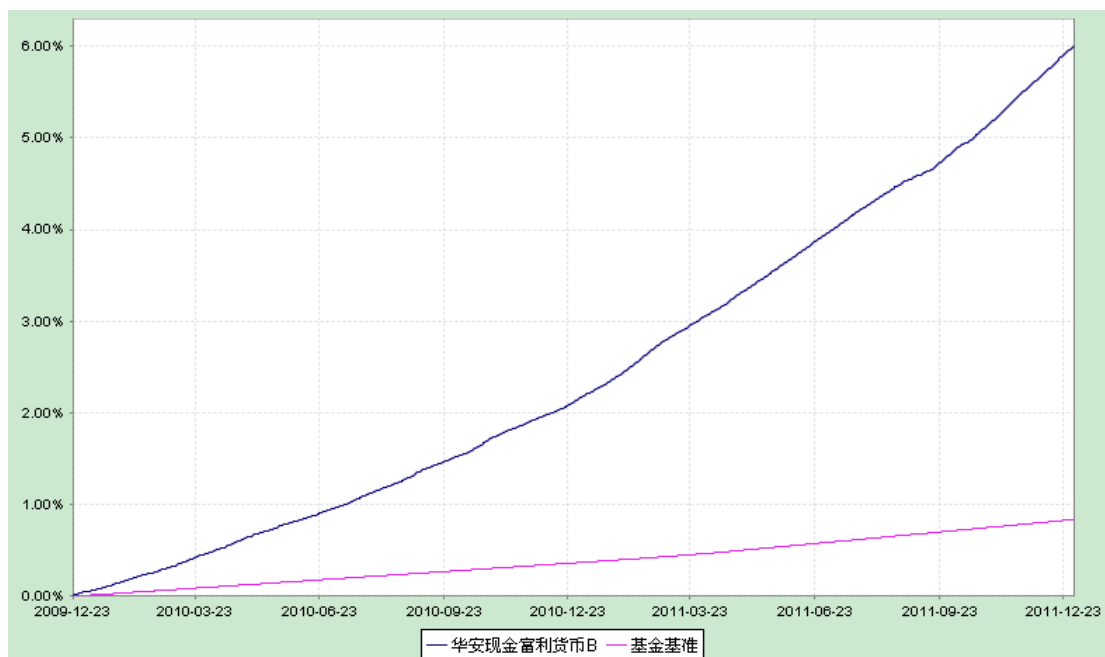
1、华安现金富利货币 A

(2003 年 12 月 30 日至 2011 年 12 月 31 日)



2、华安现金富利货币 B

(2009 年 12 月 23 日至 2011 年 12 月 31 日)



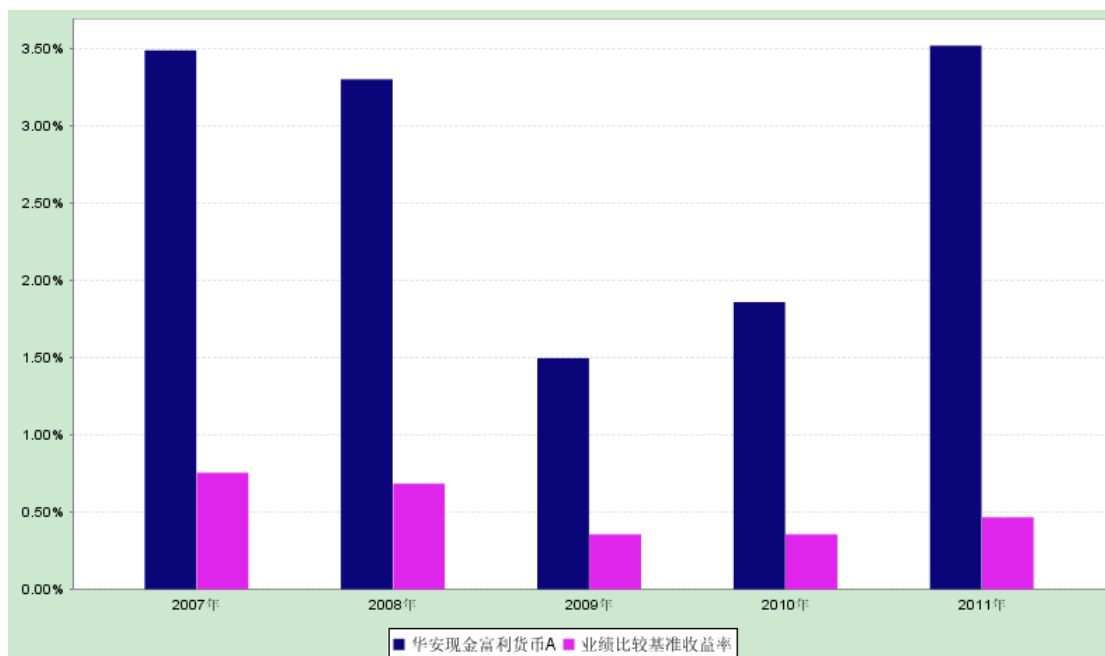
注：自 2009 年 12 月 23 日起，本基金实行销售服务费分级收费方式，分设两级基金份额：A 级基金份额和 B 级基金份额。详情请参阅相关公告。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

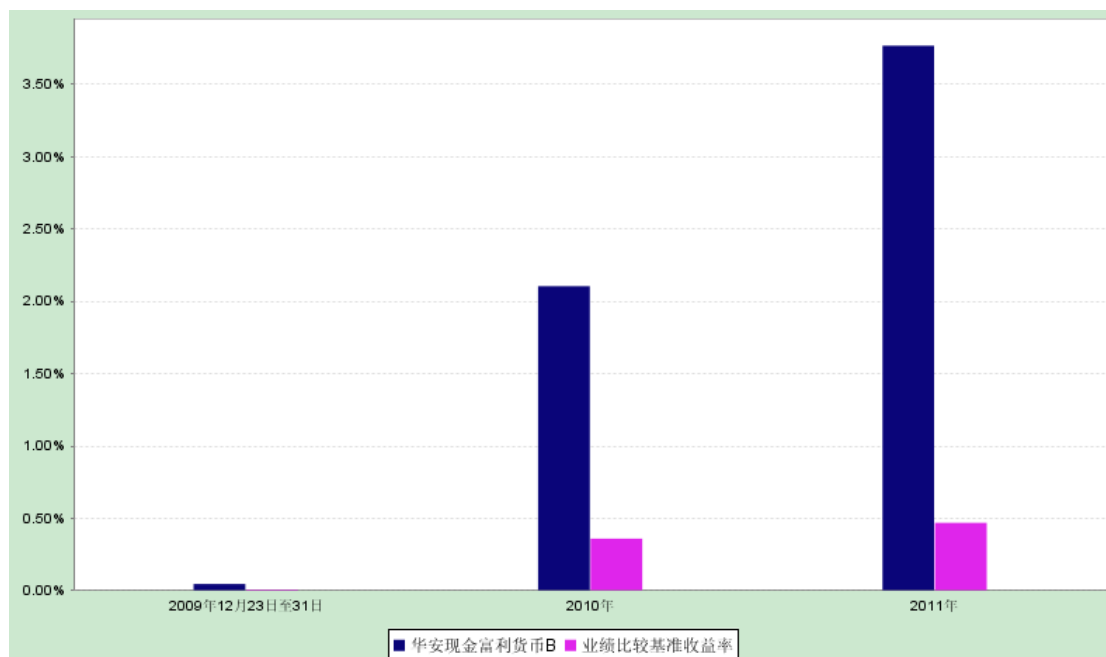
华安现金富利投资基金

过去五年净值收益率图

1、华安现金富利货币 A



2、华安现金富利货币 B



注：自 2009 年 12 月 23 日起，本基金实行销售服务费分级收费方式，分设两级基金份额：A 级基金份额和 B 级基金份额。详情请参阅相关公告。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、华安现金富利货币 A

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润分配 合计	备注
2011 年	62,148,846.12	7,833,724.69	746,364.09	70,728,934.90	-
2010 年	33,311,454.11	4,607,313.81	-1,738,129.20	36,180,638.72	-
2009 年	189,828,147.88	19,842,651.22	-32,971,428.46	176,699,370.64	-
合计	285,288,448.11	32,283,689.72	-33,963,193.57	283,608,944.26	-

2、华安现金富利货币 B

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润分配 合计	备注
2011 年	158,588,199.11	22,081,748.68	13,962,471.45	194,632,419.24	-
2010 年	86,646,807.33	8,970,857.54	4,886,365.39	100,504,030.26	-
2009 年 12 月 23 日至 31 日	-	390,684.37	2,269,486.59	2,660,170.96	-

合计	245,235,006.44	31,443,290.59	21,118,323.43	297,796,620.46	-
----	----------------	---------------	---------------	----------------	---

注：自 2009 年 12 月 23 日起，本基金实行销售服务费分级收费方式，分设两级基金份额：A 级基金份额和 B 级基金份额。详情请参阅相关公告。

§ 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。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2011 年 12 月 31 日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭 2 只封闭式证券投资基金，华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活配置混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证龙头 ETF、华安上证龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安深证 300 指数（LOF）、华安稳固收益债券、华安可转债债券、华安信用四季红债券、华安科技动力股票、华安香港精选股票（QDII）、华安大中华升级股票（QDII）等 24 只开放式证券投资基金，管理资产规模达到 795.34 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		
黄勤	本基金的基金经理，固定收益部总监	2007-05-16	-	9 年	经济学硕士，持有基金从业人员资格证书，15 年银行、基金从业经历。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理公司，曾任固定收益部债券投资经理，2007 年 5 月起担任本基金的基金经理，2009 年 4 月起同时担任华安强化收益债券型基金的基金经理。2011 年 12 月起同时担任华安信用

					四季红债券型证券投资基金的基金经理。
杨柳	本基金的基金经理助理	2009-12-16	-	9 年	金融学硕士，9 年保险、基金从业经历。曾先后在平安保险资产营运中心、太平人寿投资部从事流动性管理及债券交易工作。2005 年 8 月加入华安基金管理有限公司，任集中交易部高级交易员。2009 年 12 月起担任本基金的基金经理助理。

注：1、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。

2、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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安现金富利投资基金基金合同》、《华安现金富利证券投资基金招募说明书》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，除因 6 月份基金份额大幅下降导致 6 月 30 日本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 外，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

公司旗下不同基金、包括特定客户账户对同一证券进行交易的业务，均纳入《交易端公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易，公司《交易端公平交易管理办法-交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”，不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配，实现公平交易。本报告期内，场内业务的公平交易运作良好，未出现异常情况。

对于场外交易，公司制定《交易端公平交易管理办法-银行间业务》等制度对其进行规范，执行情况良好，未出现异常情况。

公司合规监察稽核部负责对各账户公平交易的事后监察，风险管理部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为货币型投资基金，其投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异。目前，华安旗下基金没有与本基金风格相同的基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

2011 年没有出现异常交易。

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

2011 年，世界经济在艰难的复苏中蹒跚而行，主权债务危机升级蔓延，经济下行风险凸显。欧元区财政和金融风险交替上升，增长前景不容乐观。欧美各国在本年度不断释放流动性，数量宽松和大规模购买资产操作等措施再出江湖，全球金融市场震荡加剧。

在这样的外部环境之下，本年度中国经济也面临沉重压力，一方面是国内通胀持续徘徊在高位，另一方面是宏观调控导致银根持续紧缩，对金融市场和实体都产生了显著的影响。上半年央行连续六次上调了存款准备金率，并两次上调了存贷款基准利率，四季度货币政策转为“预调微调”，下调存款准备金率 0.5 个百分点，暂停三年央票发行，并下调了一年央票发行利率。本年度一年央票发行利率较上年末上行 98 个 BP 至 3.4875%，全年货币市场反复出现脉冲式波动，波动区间也显著加大。

本年度内货币市场多次出现较大起伏，本基金积极调整组合资产，提高组合流动性，有效缓解资金面紧张给组合带来的流动性冲击，同时也降低了货币市场波动给组合带来的利率风险；适当通过组合结构调整来提高季末的组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

华安富利投资基金收益率及规模变化：

1、华安现金富利货币 A

投资回报：3.5206% 比较基准：0.4697%

期初规模：17.22 亿 期末规模：45.02 亿

2、华安现金富利货币 B

投资回报：3.7680% 比较基准：0.4697%

期初规模：72.57 亿 期末规模：138.90 亿

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012 年，世界经济仍面临诸多不确定性，一方面欧债危机仍将持续，欧元区经济难有起色，另一方面可能出现的地缘政治风险、各主要国家大选进程、以及复杂国际政治形势都使得原本就不乐观的世界经济陡增变数。

中国经济前景仍将比较复杂，未来经济整体增速将取决于外部环境和国内政

策放松这两个因素。2012 年实体经济增速总体回落，通胀保持下行趋势，政策导向从过去的“控通胀”逐步转为“稳增长”，上半年或将继续下调准备金率，但大规模放松的可能性不大。预计在目前政策导向下，信贷增长将有所恢复，货币状况将得以逐步缓解，预期货币市场利率中枢将稳步下行。

华安富利将关注新形势下各类资产的投资价值，在保持较高流动性前提下积极调整资产配置比例，优化组合结构，继续为投资者提供安全、高效的现金管理工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察工作从保障基金合规运作、维护基金份额持有人利益出发，对公司基金投资、基金销售、后台运行及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，根据相关法规的变化和业务发展的需要，进一步完善公司内控机制，在深化员工的合规意识的同时，推动公司风险控制机制的完善与优化，强化各项法规和管理制度的落实。

工作重点集中于以下几个方面：

(1) 继续深化“主动合规”的管理理念，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密等方面的合规培训和检查，保持公司良好的内控环境和合规文化。

(2) 根据《基金管理公司公平交易指导意见》的相关要求，牵头修订公司《公平交易管理制度》及配套办法，并将相关管控措施要求落实到相关部门。

(3) 坚持做好投资研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查，同时提高在基金新产品开发、新业务推进中合规及风险控制方面的支持力度。

(4) 推动落实公司投资业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险发生的概率。

(5) 有计划地对公司投资研究、销售等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，进一步强化了对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经验的描述

(1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：首席投资官、基金投资部总经理、研究发展部总经理、固定收益部总经理、金融工程部总经理、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责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；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

尚志民，工商管理硕士，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理，现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理，华安基金管理有限公司首席投资官。

李炳旺先生，研究生学历，24 年基金业工作经验。曾任台湾国际证券投资信托股份有限公司信息技术部暨注册登记部经理、台湾摩根富林明证券投资信托股份有限公司市场部经理、注册登记部协理、信息技术部副总经理、综合规划部副总经理，2011 年 8 月 24 日离职，离任前华安基金管理有限公司副总裁。

杨明，投资研究部总监，研究生学历，12 年金融、证券、基金从业经验，曾在上海银行工作。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任投资研究部总监。

宋磊，投资研究部联席总监，工学硕士，曾在大鹏证券、上海申银万国证券研究所从事证券研究工作，2000 年 2 月加入华安基金管理有限公司，在基金研究发展部从事化工行业研究，现任华安动态灵活配置混合基金经理、投资研究部联席总监。

黄勤，固定收益部总经理，经济学硕士。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理有限公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安现金富利货币、华安强化收益债券、华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部总监。

许之彦，金融工程部总经理，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安中国 A 股增强指数、华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头 ETF 和华安上证龙头 ETF 联接，华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理，指数投资部总监。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，现任基金运营部

总经理。

（2）托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

（3）会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.8 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，每月集中支付收益。本报告期华安现金富利货币 A 累计收益分配金额 70,728,934.90 元，华安现金富利货币 B 累计收益分配金额 194,632,419.24 元。

§ 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

2011 年，本基金托管人在对华安现金富利投资基金的托管过程中，严格遵守《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》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年，华安现金富利投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安现金富利投资基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润

分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安现金富利投资基金 2011 年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2012)第 20643 号

华安现金富利投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安现金富利投资基金(以下简称“华安现金富利基金”)的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是华安现金富利基金的基金管理人华安基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基

础。

6.3 审计意见

我们认为，上述华安现金富利基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华安现金富利基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 汪棣、金毅

上海市湖滨路
202 号普华永道中心 11 楼
2012-03-26

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安现金富利投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	6,819,893,234.40	2,735,800,831.26
结算备付金		-	8,007,727.27
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	3,184,299,044.06	4,049,429,134.36
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,184,299,044.06	4,049,429,134.36
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	7,018,732,939.77	2,016,204,814.51
应收证券清算款		-	-

应收利息	7.4.7.5	81,094,243.72	44,013,963.84
应收股利		-	-
应收申购款		1,323,679,122.19	173,596,473.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	10,000.00
资产总计		18,427,698,584.14	9,027,062,944.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,315,595.41	33,064,376.71
应付管理人报酬		2,648,657.93	1,737,629.79
应付托管费		802,623.58	526,554.52
应付销售服务费		543,348.43	405,530.35
应付交易费用	7.4.7.7	87,248.48	37,458.72
应交税费		3,642,483.78	3,365,300.78
应付利息		-	-
应付利润		23,011,914.22	8,303,078.68
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	404,100.00	389,100.00
负债合计		35,455,971.83	47,829,029.55
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	18,392,242,612.31	8,979,233,915.21
未分配利润	7.4.7.	-	-

	10		
所有者权益合计		18,392,242,612.31	8,979,233,915.21
负债和所有者权益总计		18,427,698,584.14	9,027,062,944.76

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 18,392,242,612.31 份，其中华安现金富利货币 A 类份额总额 4,502,316,916.62 份，华安现金富利货币 B 类份额总额 13,889,925,695.69 份。

7.2 利润表

会计主体：华安现金富利投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年 12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年 12月31日
一、收入		314,362,977.46	177,834,909.34
1. 利息收入		317,072,165.13	155,927,161.81
其中：存款利息收入	7. 4. 7. 11	110,914,437.32	45,550,900.99
债券利息收入		134,875,429.73	100,133,690.98
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		71,282,298.08	10,242,569.84
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,709,187.67	21,907,747.53
其中：股票投资收益	7. 4. 7. 12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7. 4. 7. 13	-2,709,187.67	21,907,747.53
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
衍生工具收益	7. 4. 7. 14	-	-
股利收益	7. 4. 7. 15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7. 4. 7. 16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7. 4. 7. 17	-	-
减：二、费用		49,001,623.32	41,150,240.36
1. 管理人报酬		24,064,656.54	22,876,998.73
2. 托管费		7,292,320.16	6,932,423.98
3. 销售服务费		5,625,655.58	5,471,997.21
4. 交易费用	7. 4. 7. 18	390.00	-
5. 利息支出		11,478,473.55	5,357,186.20
其中：卖出回购金融资产支出		11,478,473.55	5,357,186.20
6. 其他费用	7. 4. 7. 19	540,127.49	511,634.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		265,361,354.14	136,684,668.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		265,361,354.14	136,684,668.98

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安现金富利投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	8,979,233,915.21	-	8,979,233,915.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	265,361,354.14	265,361,354.14
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）	9,413,008,697.10	-	9,413,008,697.10
其中：1. 基金申购款	57,695,516,369.19	-	57,695,516,369.19
2. 基金赎回款	-48,282,507,672.09	-	-48,282,507,672.09
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）	-	-265,361,354.14	-265,361,354.14

五、期末所有者权益（基金净值）	18,392,242,612.31	-	18,392,242,612.31
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	14,108,236,100.20	-	14,108,236,100.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	136,684,668.98	136,684,668.98
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）	-5,129,002,184.99	-	-5,129,002,184.99
其中：1. 基金申购款	42,310,813,913.88	-	42,310,813,913.88
2. 基金赎回款	-47,439,816,098.87	-	-47,439,816,098.87
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）	-	-136,684,668.98	-136,684,668.98
五、期末所有者权益（基金净值）	8,979,233,915.21	-	8,979,233,915.21

报告附注为财务报表的组成部分

本报告从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：李勍，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安现金富利投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第 135 号《关于同意华安现金富利投资基金设立的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安现金富利投资基金基金契约》(后更名为《华安现金富利投资基金基金合同》)发起，并于 2003 年 12 月 30 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,253,247,721.00 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 190 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《关于华安现金富利货币基金实施基金份额分级的公告》，自 2009 年

12 月 23 日起, 本基金将基金份额分为 A 级和 B 级, 不同级别的基金份额适用不同费率的销售服务费; 并根据投资者基金交易账户所持有份额数量是否不低于 500 万份进行不同级别基金份额的判断和处理。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《华安现金富利投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为价格波动幅度和信用风险低并具有高度流动性的短期金融工具, 如银行定期存款、协议存款或大额存单、剩余期限不超过 397 天的短期债券、中央银行票据、期限在一年以内的债券回购、银行承兑汇票、经银行背书的商业承兑汇票或中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。本基金目前投资工具主要包括银行存款、短期债券(含央行票据)、回购协议等。本基金的业绩比较基准为银行个人活期储蓄税前利率。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2012 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安现金富利投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年度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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出

售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，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；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致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，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额自下一工作日起享有基金的分配权益，赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分配权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付利润科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。具体收益分配政策请参见相关基金合同中的相关章节。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	19,893,234.40	85,800,831.26
定期存款	6,800,000,000.00	2,650,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月(含)	6,500,000,000.00	2,650,000,000.00
存款期限 3 个月以上	300,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计	6,819,893,234.40	2,735,800,831.26

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	3,184,299,044.06	3,179,900,800.00	-4,398,244.06	-0.0239
	合计	3,184,299,044.06	3,179,900,800.00	-4,398,244.06	-0.0239
项目		上年度末 2010 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	4,049,429,134.36	4,048,745,000.00	-684,134.36	-0.0076
	合计	4,049,429,134.36	4,048,745,000.00	-684,134.36	-0.0076

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2011年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	-	-
银行间买入返售证券	7,018,732,939.77	600,001,631.69
合计	7,018,732,939.77	600,001,631.69
项目	上年度末 2010年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	-	-
银行间买入返售证券	2,016,204,814.51	-
合计	2,016,204,814.51	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日						
	债券	债券	约定	估值单	数量（张）	估值	其中：已

	代码	名称	返售日	价		总额	出售或再质押总额
7天返售	1181283	11大唐集CP01	2012-01-04	100.32	1,000,000	100,320,000.00	-
8天返售	1181310	11宁高速CP01	2012-01-05	100.42	1,000,000	100,420,000.00	-
8天返售	1181183	11津城建CP01	2012-01-05	100.29	1,000,000	100,290,000.00	-
9天返售	1181281	11华谊CP01	2012-01-06	100.14	3,000,000	300,420,000.00	-
合计	-	-	-	-	6,000,000	601,450,000.00	-
项目	上年度末 2010年12月31日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量(张)	估值总额	其中: 已出售或再质押总额
	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-

7.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	4,363.40	9,721.23
应收定期存款利息	25,850,969.87	4,007,833.40
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	3,082.97
应收债券利息	47,395,820.56	38,553,684.98
应收买入返售证券利息	7,642,042.02	1,306,465.02
应收申购款利息	201,047.87	133,176.24
其他	-	-

合计	81,094,243.72	44,013,963.84
----	---------------	---------------

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
其他应收款	-	10,000.00
待摊费用	-	-
合计	-	10,000.00

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	87,248.48	37,458.72
合计	87,248.48	37,458.72

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	404,100.00	389,100.00
合计	404,100.00	389,100.00

7.4.7.9 实收基金

华安现金富利货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,721,805,120.53	1,721,805,120.53
本期申购	18,068,729,848.29	18,068,729,848.29
本期赎回（以“-”号填列）	-15,288,218,052.20	-15,288,218,052.20
本期末	4,502,316,916.62	4,502,316,916.62

华安现金富利货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	7,257,428,794.68	7,257,428,794.68
本期申购	39,626,786,520.90	39,626,786,520.90
本期赎回（以“-”号填列）	-32,994,289,619.89	-32,994,289,619.89
本期末	13,889,925,695.69	13,889,925,695.69

注：申购含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调减份额。

7.4.7.10 未分配利润

华安现金富利货币 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
上年度末	-	-	-
本期利润	70,728,934.90	-	70,728,934.90
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	-70,728,934.90	-	-70,728,934.90
本期末	-	-	-

华安现金富利货币 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
上年度末	-	-	-
本期利润	194,632,419.24	-	194,632,419.24
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	-194,632,419.24	-	-194,632,419.24
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月 31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月 31日
活期存款利息收入	389,326.04	1,215,507.12
定期存款利息收入	109,691,567.54	43,657,191.41
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	26,797.26	133,246.04
其他	806,746.48	544,956.42
合计	110,914,437.32	45,550,900.99

7.4.7.12 股票投资收益

无。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年 12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12 月31日
卖出债券成交总额	6,282,299,667.99	9,235,583,463.70
减：卖出债券成本总额	6,195,385,353.99	9,135,159,561.63
减：应收利息总额	89,623,501.67	78,516,154.54
债券投资收益	-2,709,187.67	21,907,747.53

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

无。

7.4.7.16 公允价值变动收益

无。

7.4.7.17 其他收入

无。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
----	--------------------------	----------------------------------

	31日	
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	390.00	-
合计	390.00	-

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
审计费用	119,600.00	104,600.00
信息披露费	280,000.00	280,000.00
债券托管账户维护费	17,975.00	18,000.00
银行划款手续费	122,552.49	109,034.24
合计	540,127.49	511,634.24

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日后的收益分配事项如下：

宣告日 分配收益所属期间

2012 年度

—第 1 号收益支付公告 2012/01/12 2011/12/13-2012/01/11
—第 2 号收益支付公告 2012/02/14 2012/01/12-2012/02/13
—第 3 号收益支付公告 2012/03/13 2012/02/14-2012/03/12

7.4.9 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东

上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
上海光通信公司	受上海工业投资(集团)有限公司控制的公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月 31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	24,064,656.54	22,876,998.73
其中：支付销售机构的客户 维护费	2,158,096.52	2,414,457.69

注：支付基金管理人华安基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月 31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月 31日
当期发生的基金应支付的托	7,292,320.16	6,932,423.98

管费		
----	--	--

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B	合计
华安基金公司	1,347,901.44	456,637.15	1,804,538.59
中国工商银行	2,442,147.20	26,614.65	2,468,761.85
合计	3,790,048.64	483,251.80	4,273,300.44
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安现金富利货币A	华安现金富利货币B	合计
华安基金公司	1,247,546.33	422,642.71	1,670,189.04
中国工商银行	2,601,491.60	35,532.47	2,637,024.07
合计	3,849,037.93	458,175.18	4,307,213.11

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华安基金公司，再由华安基金公司计算并支付给各基金销售机构。A 级基金份额和 B 级基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%和 0.01%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

7.4.10.3 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 2011年1月1日至2011年12月31日			
银行间市场交	债券交易金额	基金逆回购	基金正回购

易的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	92,499,943.94	204,817,829.17	-	-	3,901,900,000.00	375,085.42
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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
中国工商银行	40,127,733.56	374,043,910.81	-	-	750,000,000.00	43,624.31

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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

华安现金富利货币 A

份额单位：份

关联方名称	华安现金富利货币A本期末 2011年12月31日		华安现金富利货币A上年度末 2010年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占A级基金份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占A级基金份额的比例
上海光通信公司	3,616,961.90	0.08%	-	-

华安现金富利货币 B

份额单位：份

关联方名称	华安现金富利货币B本期末 2011年12月31日		华安现金富利货币B上年度末 2010年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占B级基金份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占B级基金份额的比例
上海光通信公司	-	-	20,162,088.37	0.28%

注：1、上海光通信公司为受上海工业投资(集团)有限公司控制的公司。

2、在关联方持有的基金份额占基金总份额的比例中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

7.4.10.5 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	19,893,234.40	389,326.04	85,800,831.26	1,215,507.12

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业或协议利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

1、华安现金富利货币 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
62,148,846.12	7,833,724.69	746,364.09	70,728,934.90	-

2、华安现金富利货币B

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
158,588,199.11	22,081,748.68	13,962,471.45	194,632,419.24	-

7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止报告期末 2011 年 12 月 31 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止报告期末 2011 年 12 月 31 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易

中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，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监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

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。

7.4.13.2 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同责任，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。

本公司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本基金的托管行 中国工商银行、具有基金托管资格的商业银行，因而与该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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年末 2010 年 12 月 31 日
A-1	1,874,131,852.49	2,332,164,763.59
A-1 以下	-	-
未评级	470,072,570.70	1,717,264,370.77
合计	2,344,204,423.19	4,049,429,134.36

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年末 2010 年 12 月 31 日
AAA	10,331,341.43	-
AAA 以下	-	-
未评级	829,763,279.44	-
合计	840,094,620.87	-

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。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 180 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。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%。本基金投资于一家公司发行的短期企业债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%。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 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	6,819,893,234.40	-	-	-	6,819,893,234.40
交易性金融资产	1,991,368,184.93	1,192,930,859.13	-	-	3,184,299,044.06
买入返售金融资产	7,018,732,939.77	-	-	-	7,018,732,939.77
应收利息	-	-	-	81,094,243.72	81,094,243.72
应收申购款	30,849,568.00	-	-	1,292,829,554.19	1,323,679,122.19
结算备付金	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	15,860,843,927.10	1,192,930,859.13	-	1,373,923,797.91	18,427,698,584.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,315,595.41	4,315,595.41
应付管理人报酬	-	-	-	2,648,657.93	2,648,657.93
应付托管费	-	-	-	802,623.58	802,623.58
应付销售服务费	-	-	-	543,348.43	543,348.43
应付交易费用	-	-	-	87,248.48	87,248.48
应交税费	-	-	-	3,642,483.78	3,642,483.78
应付利润	-	-	-	23,011,914.22	23,011,914.22
其他负债	-	-	-	404,100.00	404,100.00
负债总计	-	-	-	35,455,971.83	35,455,971.83
利率敏感度缺口	15,860,843,927.10	1,192,930,859.13	-	1,338,467,826.08	18,392,242,612.31
上年度末2010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	2,735,800,831.26	-	-	-	2,735,800,831.26
交易性金融资产	2,575,427,531.24	1,474,001,603.12	-	-	4,049,429,134.36
买入返售金融资产	2,016,204,814.51	-	-	-	2,016,204,814.51
应收利息	-	-	-	44,013,963.84	44,013,963.84
应收申购款	-	-	-	173,596,473.52	173,596,473.52
结算备付金	8,007,727.27	-	-	-	8,007,727.27
其他资产	-	-	-	10,000.00	10,000.00
资产总计	7,335,440,904.28	1,474,001,603.12	-	217,620,437.36	9,027,062,944.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	33,064,376.71	33,064,376.71
应付管理人报酬	-	-	-	1,737,629.79	1,737,629.79
应付托管费	-	-	-	526,554.52	526,554.52
应付销售服务费	-	-	-	405,530.35	405,530.35
应付交易费用	-	-	-	37,458.72	37,458.72
应交税费	-	-	-	3,365,300.78	3,365,300.78
应付利润	-	-	-	8,303,078.68	8,303,078.68
其他负债	-	-	-	389,100.00	389,100.00
负债总计	-	-	-	47,829,029.55	47,829,029.55

利率敏感度缺口	7,335,440,904.28	1,474,001,603.12	-	169,791,407.81	8,979,233,915.21
---------	------------------	------------------	---	----------------	------------------

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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：人民币万元）	
		本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 331	增加约 164
	市场利率上升 25 个基点	减少约 324	减少约 164

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层次金融工具公允价值

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 3,184,299,044.06 元，无属于第一或第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第二层级 4,049,429,134.36 元，无属于第一或第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	3,184,299,044.06	17.28
	其中：债券	3,184,299,044.06	17.28
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	7,018,732,939.77	38.09
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	600,001,631.69	3.26
3	银行存款和结算备付金合计	6,819,893,234.40	37.01
4	其他各项资产	1,404,773,365.91	7.62
	合计	18,427,698,584.14	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	4.76
	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	-	-
	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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	44
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	124
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

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 180 天。

8.3.2 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	55.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.35	-
2	30 天(含)—60 天	20.66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.14	-
3	60 天(含)—90 天	4.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.78	-
4	90 天(含)—180 天	5.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天（含）	6.49	-
	其中：剩余存续期超过 397	-	-

	天的浮动利率债		
	合计	92.55	-

8.4 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	339,664,758.71	1.85
3	金融债券	960,171,091.43	5.22
	其中：政策性金融债	960,171,091.43	5.22
4	企业债券	10,331,341.43	0.06
5	企业短期融资券	1,874,131,852.49	10.19
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,184,299,044.06	17.31
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.5 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	1101088	11 央票 88	3,500,000	339,664,758.71	1.85
2	100230	10 国开 30	2,100,000	209,620,933.90	1.14
3	110212	11 国开 12	1,660,000	165,321,764.92	0.90
4	090205	09 国开 05	1,500,000	152,321,898.53	0.83
5	110414	11 农发 14	1,300,000	130,407,811.99	0.71
6	110221	11 国开 21	1,140,000	112,915,207.96	0.61
7	041160005	11 苏国信 CP001	1,000,000	100,998,472.06	0.55
8	1181317	11 中铝 CP02	1,000,000	100,403,561.65	0.55
9	041170001	11 光明 CP002	1,000,000	100,068,684.70	0.54
10	110402	11 农发 02	850,000	85,114,157.04	0.46

8.6 “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	53
报告期内偏离度的最高值	0.16%
报告期内偏离度的最低值	-0.39%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.16%

8.7 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。

8.8 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值 20%的情况说明

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例（%）	原因	调整期
1	2011-06-28	20.14	6 月份基金份额大幅下降	10 个工作日内调整合规。截至 2011 年 7 月 7 日本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本低于基金净值的 20%

8.9.3 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.4 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	81,094,243.72
4	应收申购款	1,323,679,122.19
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,404,773,365.91

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 现金 富利 货币 A	65,935	68,284.17	197,334,197.55	4.38%	4,304,982,719.07	95.62%
华安 现金 富利 货币 B	395	35,164,368.85	11,537,648,885.14	83.06%	2,352,276,810.55	16.94%
合计	66,330	277,283.92	11,734,983,082.69	63.80%	6,657,259,529.62	36.20%

注：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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	华安现金富利货币 A	8,061,291.55	0.179%
	华安现金富利货币 B	-	-

	合计	8,061,291.55	0.044%
--	----	--------------	--------

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，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分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安现金富利货币 A	华安现金富利货币 B
基金合同生效日(2003 年 12 月 30 日)基金份额总额	4,253,745,531.90	-
本报告期期初基金份额总额	1,721,805,120.53	7,257,428,794.68
本报告期基金总申购份额	18,068,729,848.29	39,626,786,520.90
减：本报告期基金总赎回份额	15,288,218,052.20	32,994,289,619.89
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,502,316,916.62	13,889,925,695.69

注：申购含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调减份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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、本基金管理人重大人事变动如下：

(1)2011 年 8 月 26 日，基金管理人发布了基金行业高级管理人员变更公告，李炳旺副总经理因个人原因辞职；

(2)2011 年 9 月 17 日，基金管理人发布了关于董事变更的公告，经本公司股东会审议通过，选举朱仲群先生、李勃先生为本公司董事，俞妙根先生、陈兵先生不再担任本公司董事；

(3)2011 年 9 月 17 日，基金管理人发布了关于基金行业高级管理人员变更公告，俞妙根董事长因个人原因辞职，由李勃总经理代任董事长职务；

(4)2011 年 9 月 24 日，基金管理人发布了关于基金行业高级管理人员变更公告，韩勇副总经理因个人原因辞职；

(5)2011 年 11 月 12 日，基金管理人发布了关于基金行业高级管理人员变更公告，邵杰军副总经理因个人原因辞职；

(6)2011 年 12 月 16 日，基金管理人发布了关于基金行业高级管理人员变更

公告，朱仲群先生任华安基金管理有限公司董事长。朱仲群先生经中国证监会核准取得高管任职资格。李勍总经理不再代行董事长职务。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：无。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 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。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况：119,600.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

11.7.2 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
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	4,483,200,000.00	100.00%	-	-

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；

（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副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《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、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

11.9 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	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金收益支付的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-01-12
2	华安现金富利投资基金“春节”长假前暂停申购（定期定额申购除外）及基金转换转入交易提示性公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-01-25
3	关于新增浙商证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-01-31
4	关于新增财达证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-02-14
5	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金收益支付的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-02-14
6	关于旗下基金在天相投资顾问有限公司开通定投业务的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-03-10
7	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金收益支付的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-03-14
8	关于新增哈尔滨银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-03-21
9	华安现金富利投资基金“清明节”长假前暂停大额申购及转换转入公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-03-26
10	关于新增民生证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-04-11
11	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金收益支付的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、	2011-04-12

		公司网站	
12	关于新增浙江稠州商业银行股份有限公司为基金代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-04-18
13	关于新增烟台银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-04-23
14	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金收益支付的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-05-12
15	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金收益支付的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-06-14
16	关于新增大连银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-06-30
17	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金收益支付的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-07-12
18	关于华安现金富利投资基金增加代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-07-22
19	关于旗下部分基金在中国邮政储蓄银行有限责任公司开通转换业务的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-07-22
20	关于旗下部分基金在中国邮政储蓄银行有限责任公司开通定期定额申购并参加定期定额申购费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-07-22
21	华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金收益支付的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-08-12
22	关于电子直销平台开通“利增利”基金电子交易业务的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-08-13
23	关于基金电子交易平台开通“通联支付”第三方支付业务的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2011-08-22
24	关于电子直销平台开展“定投申购费率	上海证券报、证券	2011-08-29

	优惠”活动的公告	时报、中国证券报、 公司网站	
25	关于基金电子交易平台农行结算渠道 申购费率优惠的公告	上海证券报、证券 时报、中国证券报、 公司网站	2011-09-01
26	关于变更开放式基金直销申购资金专 户的公告	上海证券报、证券 时报、中国证券报、 公司网站	2011-09-02
27	华安基金管理有限公司关于华安现金 富利投资基金收益支付的公告	上海证券报、证券 时报、中国证券报、 公司网站	2011-09-14
28	华安现金富利投资基金“国庆节”长假 前暂停大额申购及转换转入公告	上海证券报、证券 时报、中国证券报、 公司网站	2011-09-23
29	关于电子直销平台开通“余额转投货币 基金”电子交易业务的公告	上海证券报、证券 时报、中国证券报、 公司网站	2011-10-12
30	华安基金管理有限公司关于华安现金 富利投资基金收益支付的公告	上海证券报、证券 时报、中国证券报、 公司网站	2011-10-12
31	华安基金管理有限公司关于华安现金 富利投资基金收益支付的公告	上海证券报、证券 时报、中国证券报、 公司网站	2011-11-14
32	华安基金管理有限公司关于华安现金 富利投资基金收益支付的公告	上海证券报、证券 时报、中国证券报、 公司网站	2011-12-13
33	关于电子直销平台开通“智赢定投”基 金电子交易业务的公告	上海证券报、证券 时报、中国证券报、 公司网站	2011-12-15
34	关于华安现金富利投资基金“元旦”假 期前暂停大额申购及转换转入公告	上海证券报、证券 时报、中国证券报、 公司网站	2011-12-26

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准华安现金富利投资基金设立的文件；
- 2、《华安现金富利投资基金基金合同》；
- 3、《华安现金富利投资基金招募说明书》；
- 4、《华安现金富利投资基金托管协议》；
- 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
二〇一二年三月二十九日