

华安现金富利投资基金 2006 年年度报告

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

签发日期：二〇〇七年三月三十一日

目 录

一、	重要提示	3
二、	基金产品概况	3
1、	基金概况	3
2、	基金的投资	3
3、	基金管理人	4
4、	基金托管人	4
5、	信息披露	5
6、	其他有关资料	5
三、	主要财务指标和基金净值表现	5
1、	主要财务指标	5
2、	净值表现	5
3、	基金收益分配情况	5
四、	管理人报告	7
1、	基金经理	7
2、	基金运作合规性声明	7
3、	基金经理工作报告	8
4、	基金内部监察报告	8
五、	托管人报告	10
六、	财务会计报告	12
	(一)、资产负债表	12
	(二)、经营业绩表	13
	(三)、收益分配表	14
	(四)、净值变动表	14
	(五)、会计报表附注	14
七、	投资组合报告	23
	(一) 报告期末基金资产组合	23
	(二) 报告期债券回购融资情况	23
	(三) 基金投资组合平均剩余期限	24
	(四) 报告期末债券投资组合	25
	(五) “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	26
	(六) 资产支持证券投资组合	26
	(七) 投资组合报告附注	26
八、	基金份额持有人户数和持有人结构	27
九、	开放式基金份额变动	27
十、	重大事件	27
十一、	备查文件目录	33

一、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。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 2007 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

二、基金产品概况

1、基金概况

基金名称:	华安现金富利投资基金
基金简称:	华安现金富利
交易代码:	040003
深交所行情代码:	160403
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
期末基金份额总额:	6,104,018,440.11 份
基金存续期:	不定期

2、基金的投资

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多种数量模型工具,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。

3、基金管理人

基金管理人：	华安基金管理有限公司
注册地址：	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼
办公地址：	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼
邮政编码	200120
法定代表人：	王成明
信息披露负责人：	冯颖
联系电话：	021-58881111
传真：	021-68863414
电子邮箱：	fengying@huanan.com.cn
客户服务热线：	40088-50099、021-68604666

4、基金托管人

基金托管人：	中国工商银行股份有限公司
--------	--------------

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码：100032
法定代表人：姜建清
信息披露负责人：蒋松云
联系电话：010-66106912
传真：010-66106904
电子邮箱：songyun.jiang@icbc.com.cn

5、信息披露

信息披露报纸：中国证券报、上海证券报、证券时报
管理人互联网地址：<http://www.huaan.com.cn>
报告置备地点：上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

6、其他有关资料

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所有限公司
办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
登记注册机构：华安基金管理有限公司
办公地点：上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

三、主要财务指标和基金净值表现

1、主要财务指标

财务指标	2006 年	2005 年	2004 年
基金本期净收益：	460,881,659.17	983,192,997.93	245,445,717.98
期末基金资产净值：	6,104,018,440.11	33,477,950,271.18	16,613,072,926.39
期末基金份额净值：	1.000	1.000	1.000
本期净值收益率：	1.9042%	2.4646%	2.5125%
累计净值收益率：	7.0565%	5.0561%	2.5293%

*注：本基金收益分配按月结转份额

提示：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、净值表现

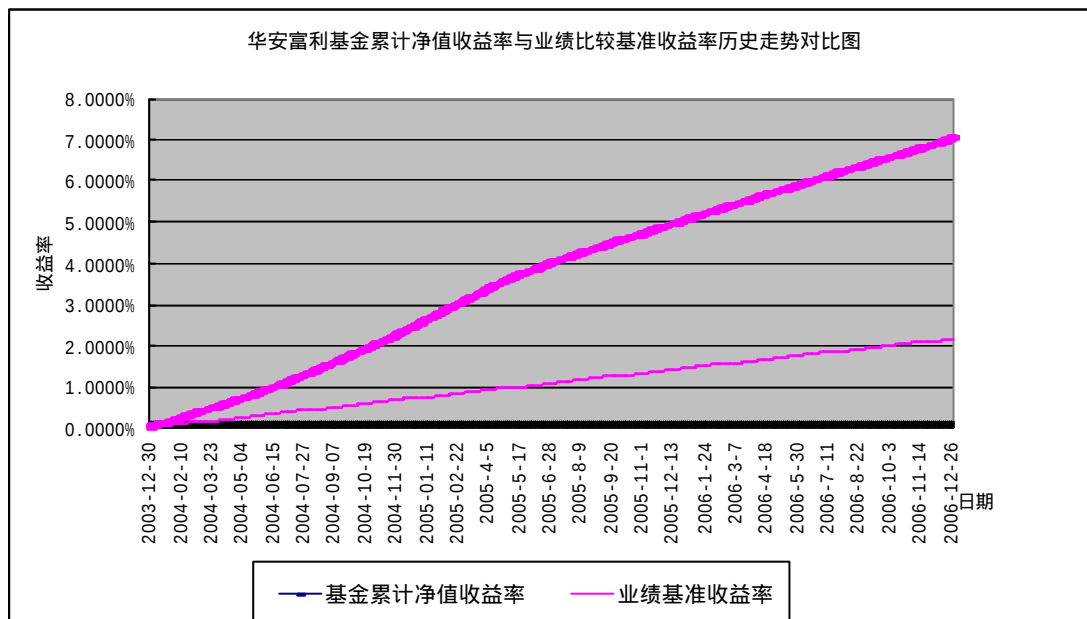
A、历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	基金净值 收益率	基金净值 收益率标 准差	业绩比较 基准收益 率	业绩比较基 准收益率标 准差	-	-
过去 3 个月	0.4779%	0.0012%	0.1815%	0.0000%	0.2964%	0.0012%

过去 6 个月	0.9461%	0.0013%	0.3630%	0.0000%	0.5831%	0.0013%
过去 1 年	1.9042%	0.0019%	0.7200%	0.0000%	1.1842%	0.0019%
过去 3 年	7.0390%	0.0020%	2.1620%	0.0000%	4.8770%	0.0020%
自基金合同 生效起至今	7.0565%	0.0020%	2.1659%	0.0000%	4.8906%	0.0020%

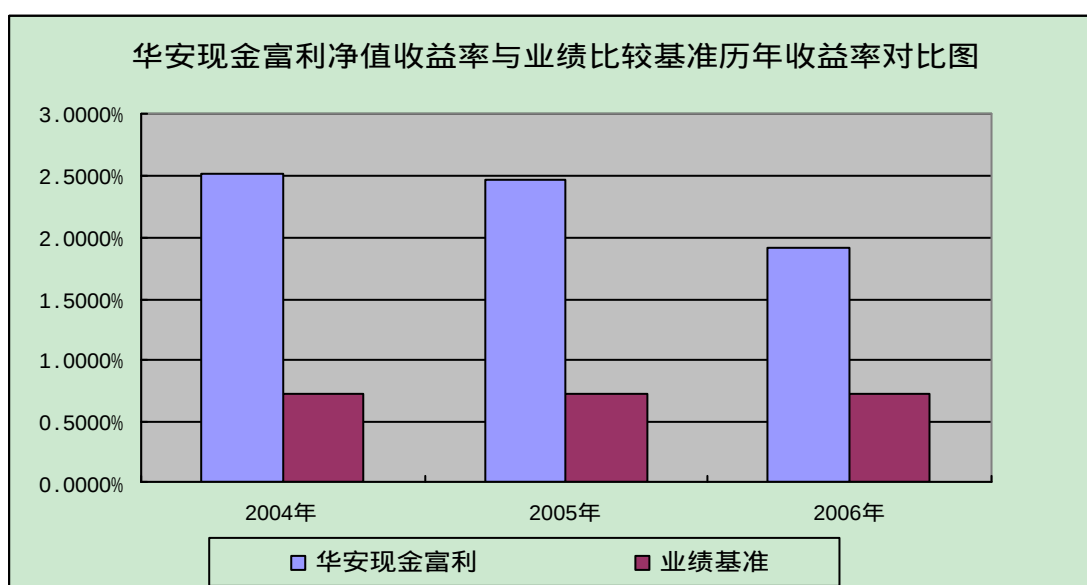
*注：本基金收益分配按月结转份额

B、自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比



C、图示基金过往三年每年的净值收益率

基金过往三年每年的净值收益率与同期业绩比较基准收益率对比图



3、基金收益分配情况

年度	收益分配金额	备注
2006 年度	460,881,659.17	
2005 年度	983,192,997.93	
2004 年度	245,445,717.98	

四、 管理人报告

1、基金管理人及基金经理情况

A. 基金管理人

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、上海国际信托投资有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海广电（集团）有限公司和上海沸点投资发展有限公司。

截至 2006 年 12 月 31 日，公司旗下共管理了基金安信、基金安顺、基金安久、基金安瑞 4 只封闭式证券投资基金，华安创新、华安中国 A 股、华安富利、华安宝利、180ETF、华安宏利、华安国际配置 7 只开放式基金，管理人民币资产 265.61 亿元，美元资产 1.98 亿美元。

B. 基金经理

项廷锋 先生：管理学博士，8 年证券从业经历。1999 年 6 月进入华安基金管理公司研究发展部从事行业研究，当年 10 月调入基金投资部负责华安旗下基金的债券部分资产的投资与研究；自 2003 年 12 月起担任华安现金富利投资基金基金经理。

2、基金运作合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安富利投资基金基金合同》、《华安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。但由于 10 月份开始，华安富利基金出现持续大额赎回，规模大幅下降，存在着一定的流动性压力，为了保护广大投资者的利益，公司一方面利用市场回购利率上升的有利时机，加大减券力度；另一方面在股东的支持下，采取积极措施化解了流动性风险，保护了投资者的利益。在此期间，出现了正回购比例、存续期超过一年的以 7 天回购利率为基准的浮息券、持有同一商业银行发行的次级债、存放在没有托管资格的商业银行的定期存款超过法规及相关规定比例的情形，但至 12 月末，所有的指标均已调整合规。除此之外，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

3、基金经理工作报告

(1) 2006 年华安富利运作回顾

表1 2006年富利投资收益率及规模变化

投资回报	1.9042%	比较基准	0.7200%
期初规模	334.78亿	期末规模	61.04亿

A、货币市场运行

2006 年，央行面对“加息”、“升值”、“新股 IPO”三大因素的交互作用，适时地两次加息、三次上调准备金比率、四次定向发行央票，并辅以灵活的公开市场操作，基本实现了货币市场的相对平稳运行。

1 月至 9 月，随着固定资产投资、信贷持续超预期增长或增长率高位运行，经济呈现局部过热特征，央行适时地两次加息。期间，市场存在强烈的货币紧缩预期，一年期央行票据发行参考利率因此逐级走高。

9 月以后，随着固定资产投资、信贷增长率的持续下降，经济局部过热现象有所缓解，市场的加息预期开始弱化，一年期央行票据发行参考利率开始温和下行，并稳定在 2.8% 不到的水平。

源于人民币升值而引发的市场过度富裕的流动性贯穿 2006 年全年，成为左右货币市场走势的又一重要因素。随着贸易顺差叠创新高，人民币升值的压力，在预期与现实相互作用下日益强化，准备金比率第一次成了常规的货币调控工具。

而 4 月启动的新股 IPO 造成银行间市场资金大转移导致了严重的结构失衡，货币市场短期品种利率因此而剧烈波动。

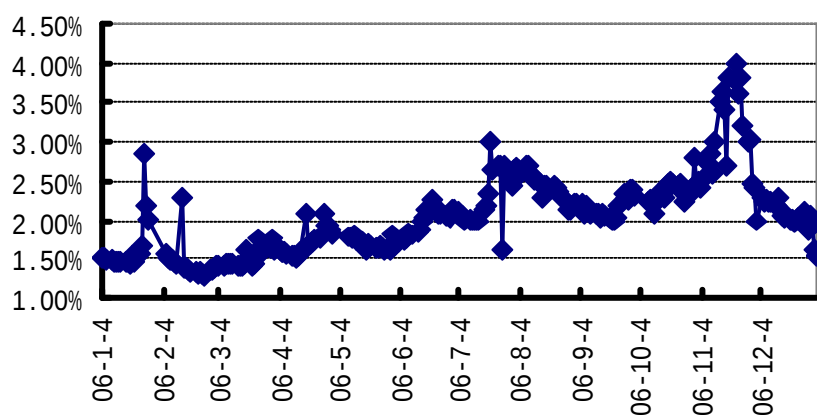


图1 银行间市场 R007 利率走势 资料来源：α 债券分析系统

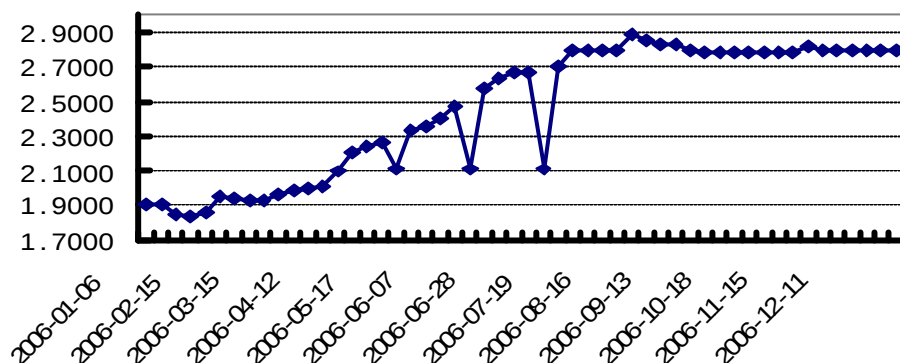


图2 一年期央行票据发行参考利率走势 资料来源：α 债券分析系统

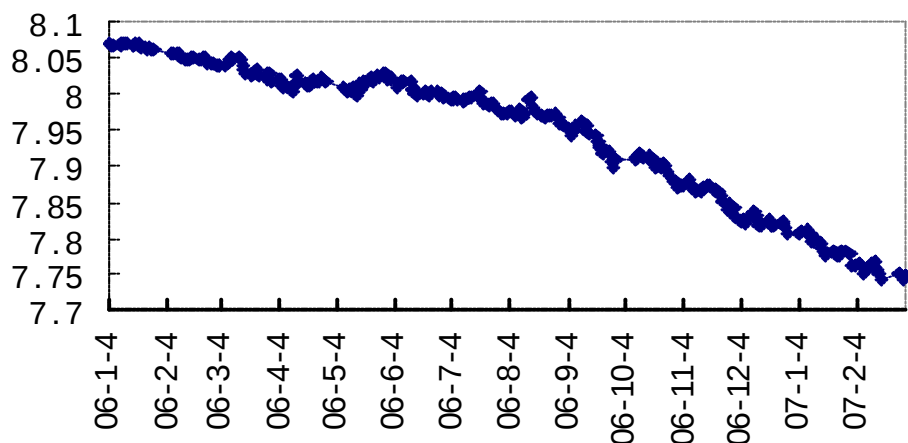


图3 2006 年人民币兑美元走势 资料来源：[//www.chinamoney.com.cn/](http://www.chinamoney.com.cn/)

B、基金管理

2006 年的基金管理状况可分为两个阶段：

第一阶段，1--9 月份，华安富利基金不仅有效地克服了受央行货币政策调控、新股 IPO 密集发行等造成的基金规模大起大落、资金紧张等不利因素，而且在风险管理方面，通过依托内部自主开发的信用风险评级系统的支持，及时规避了部分企业的短期融资券引发的基金投资信用风险，确保了华安富利基金的平稳运行。

第二阶段，公司 10 月中旬发生的突发事件，给富利基金流动性管理造成很大的压力。为了保护广大投资者的利益，维护市场和整个行业的稳定，在监管部门、公司股东以及托管银行的大力支持和全力配合下，公司采取积极有效的措施，抓住回购市场利率大幅上升的有利时机，加大减持浮息债的力度，有效化解了基金组合的流动性风险。2006 年 12 月下旬，基金规模趋于稳定、投资组合更为合理、日常管理平稳有序。

（2）2007 年展望

2007 年货币市场仍将带有 2006 年货币市场运行的痕迹。源于投资反弹引发的加息预期、源于人民币升值而衍生的流动性过剩以及源于新股 IPO 对货币市场利率的扰动，仍将主导货币市场的运行。

基于对上述三大因素的预期，我们倾向于：货币市场收益率曲线短端到新股 IPO 支撑，中长端受到人民币升值压力的压制，货币市场的收益率曲线仍较扁平，但总体较 2006 年有所抬高；加息可能阶段性地引起收益率曲线的型变。

就富利管理而论，我们将进一步强化基金的现金管理定位，突出流动性风险管理在基金日常管理中的核心地位。在确保基金资产安全的大前提下，合理配置基金资产，捕捉、把握因新股 IPO 对货币市场利率运行可能出现的扰动机会，实现基金持有人现金管理收益的最大化。

4、基金内部监察报告

本报告期内，监察工作以保障公司合规运作、维护基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部对公司后台运行、基金运作、基金销售及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，同时推动公司风险控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实。

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

- （1）组织员工进行法律法规的学习，强化员工合规经营和风险控制意识；
- （2）根据法律法规和监管规定的要求，推动公司和相关部门修订完善公司内控制度；
- （3）完善投资交易系统控制功能，提高合规监察效率；
- （4）开展基金运作稽核检查工作，通过定期检查、不定期抽查等工作方法，加强公司运作合规性控管。

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，充分保障基金份额持有人的合法权益。

五、托管人报告

2006 年度，本托管人在对华安现金富利基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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应尽的义务。

2006 年度，华安现金富利基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安现金富利基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金收益分配、基金费用开支等问题上，基本遵循《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。

2006 年度，华安现金富利基金因证券市场波动或基金规模变动发生过不符合有关法规或基金合同中所规定的投资比例限制的情况，出现过异常交易的情况，我行及时向华安基金管理公司发送提示函件，华安基金管理公司在规定时间内及时对投资组合进行了调整。

本托管人依法对华安基金管理有限公司在 2006 年度所编制和披露的华安现金富利基金年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投

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。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2007 年 3 月 23 日

六、 审计报告

普华永道中天审字(2007)第 20208 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”)会计报表，包括 2006 年 12 月 31 日的资产负债表、2006 年度的经营业绩表和基金净值变动表以及会计报表附注。

一、 管理层对会计报表的责任

按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《华安现金富利投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制会计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) 设计、实施和维护与会计报表编制相关的内部控制，以使会计报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
- (3) 作出合理的会计估计。

二、 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对会计报表发表审计意见。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职业道德规范，计划和实施审计工作以对会计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，以获取有关会计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会计报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与会计报表编制相关的内部控制，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，以及评价会计报表的总体列报。

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。

三、 审计意见

我们认为，上述会计报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《华安现金富利投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在

所有重大方面公允反映了华安现金富利基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天

注册会计师

会计师事务所有限公司

汪 棣

中国·上海市

注册会计师

2007 年 3 月 23 日

陈 宇

七、财务会计报告

(除特殊注明外, 单位: 人民币元)

(一)、资产负债表

项 目	附注	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7(1)	1,242,760,786.36	10,904,221,187.54
清算备付金		4,004,570.47	154,541,951.93
应收证券清算款		0.00	0.00
应收利息	7(2)	43,725,477.20	126,586,708.51
应收申购款		108,270,449.07	128,452,879.70
其他应收款	7(5)	22,283.00	628,337.00
股票投资市值		0.00	0.00
其中: 股票投资成本		0.00	0.00
债券投资市值		4,908,101,000.17	24,890,598,930.58
其中: 债券投资成本		4,908,101,000.17	24,890,598,930.58
权证投资市值		0.00	0.00
其中: 权证投资成本		0.00	0.00
买入返售证券		619,200,000.00	7,502,650,000.00
待摊费用	7(3)	0.00	0.00
其他资产		0.00	0.00
资产合计		<u>6,926,084,566.27</u>	<u>43,707,679,995.26</u>
负债:			
应付证券清算款		0.00	846,415,412.41
应付赎回款		15,378,422.28	10,334,676.46
应付销售服务费		1,128,326.84	8,344,149.49
应付管理人报酬		1,489,391.50	11,014,277.26

应付托管费		451,330.75	3,337,659.77
应付利息		595,200.64	2,346,975.12
应付佣金		0.00	0.00
应付收益		5,652,241.76	36,690,903.57
其他应付款	7(6)	1,216,712.39	91,170.00
卖出回购证券款		796,000,000.00	9,311,000,000.00
预提费用	7(7)	154,500.00	154,500.00
负债合计		<u>822,066,126.16</u>	<u>10,229,729,724.08</u>
所有者权益：			
实收基金	7(8)	6,104,018,440.11	33,477,950,271.18
未实现利得	7(9)	0.00	0.00
未分配收益		0.00	0.00
持有人权益合计		<u>6,104,018,440.11</u>	<u>33,477,950,271.18</u>
负债和所有者权益合计		<u>6,926,084,566.27</u>	<u>43,707,679,995.26</u>

所附附注为本会计报表的组成部分

(二)、经营业绩表

项 目	附注	2006年度	2005年度
收入：			
债券差价收入	7(10)	-21,514,131.96	233,227,651.95
债券利息收入		408,638,500.71	757,694,078.38
存款利息收入	7(11)	106,611,288.26	81,617,250.37
买入返售证券收入		68,326,473.06	281,113,973.19
其他收入	7(12)	138,640,000.00	0.00
收入合计		<u>700,702,130.07</u>	<u>1,353,652,953.89</u>
费用：			
基金管理人报酬	6(3)	80,838,396.71	136,953,736.99
基金托管费	6(3)	24,496,483.91	41,501,132.58
基金销售服务费	6(3)	61,241,209.58	103,752,831.18
卖出回购证券支出		70,568,969.50	84,237,936.24
其他费用	7(13)	2,675,411.20	4,014,318.97
其中：信息披露费		300,000.00	340,000.00
审计费用		150,000.00	154,000.00
费用合计		<u>239,820,470.90</u>	<u>370,459,955.96</u>
基金净收益		<u>460,881,659.17</u>	<u>983,192,997.93</u>
加：未实现估值增值变动数		0.00	0.00
基金经营业绩		<u>460,881,659.17</u>	<u>983,192,997.93</u>

所附附注为本会计报表的组成部分

(三)、收益分配表

项 目	附注	2006年度	2005年度
本期基金净收益		460,881,659.17	983,192,997.93
加：期初未分配收益		0.00	0.00
加：本期申购基金单位的损益平准金		0.00	0.00
减：本期赎回基金单位的损益平准金		0.00	0.00
可供分配基金净收益		460,881,659.17	983,192,997.93
减：本期已分配基金净收益 7(14)		460,881,659.17	983,192,997.93
期末基金未分配净收益		0.00	0.00

所附附注为本会计报表的组成部分

(四)、净值变动表

项 目	附注	2006年度	2005年度
一、期初基金净值		33,477,950,271.18	16,613,072,926.39
二、本期经营活动：			
基金净收益		460,881,659.17	983,192,997.93
未实现估值增值变动数		0.00	0.00
经营活动产生的基金净值变动数		460,881,659.17	983,192,997.93
三、本期基金单位交易：			
基金申购款		95,289,863,046.89	180,675,036,101.13
基金赎回款		122,663,794,877.96	163,810,158,756.34
基金单位交易产生的基金净值变动数		-27,373,931,831.07	16,864,877,344.79
四、本期向持有人分配收益		460,881,659.17	983,192,997.93
五、期末基金净值		6,104,018,440.11	33,477,950,271.18

所附附注为本会计报表的组成部分

(五)、会计报表附注

1. 基金的基本情况

募集申请的核准机构：中国证券监督管理委员会
核准文号：证监基金字[2003] 135 号
核准文件名称：《关于同意设立华安现金富利投资基金的批复》
基金运作方式：契约型开放式
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
基金合同生效日：2003 年 12 月 30 日



基金合同生效日的基金份额：4,253,745,531.90

基金募集期间：2003 年 12 月 14 日至 2003 年 12 月 28 日

募集资金总额：4,253,247,721.00

募集资金的银行存款利息（折算为投资者的基金份额）：497,810.90

募集期间相关费用明细及节余：本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司承担，与本基金无关。

验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

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、央行票据、回购协议等。

2. 基本会计假设

本年度会计报表的编制遵守基本会计假设。

3. 主要会计政策、会计估计及其变更

(1). 编制基金会计报表所遵循的主要会计制度及其他有关规定

本基金的会计报表按《证券投资基金会计核算办法》编制，会计报表披露的方式则是根据中国证券监督管理委员会颁布并于 2004 年 7 月 1 日起实施的《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 4 号《基金投资组合报告的编制及披露》、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》进行编制及披露。

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《华安现金富利投资基金基金合同》和中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

(2). 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。

(3). 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(4). 记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。债券投资采用摊余成本法计价，同时按公允价值进行估值监控。除此之外，所有报表项目均以历史成本计价。

(5). 基金资产的估值原则

本基金的债券投资采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在剩余期限内平均摊销。本基金不采用市场利率或上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率或交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子定价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。

如有确凿证据表明按上述方法进行计价不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法计价。

(6). 证券投资的成本计价方法 - 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资；买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。买入贴息债券无需单独核算应收利息。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/(损失)；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(7). 收入的确认和计量

证券交易所交易的债券差价收入/(损失)于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入/(损失)于实际收到全部价款时确认。债券差价收入/(损失)按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

除银行次级债之外的债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额，并根据买入债券时溢价或折价的摊销数及应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税进行调整后的金额确认；银行次级债利息收入按债券票面价值与全额票面利率计算的金额，并根据买入债券时溢价或折价的摊销数进行调整后的金额确认。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提，其中定期存款利息收入采用到期协议利率逐日计提。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

(8). 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率逐日计提。

本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

(9). 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。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。

(10). 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额享有确认当日的分红权益。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收益科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。

(11). 重大会计差错的内容和更正金额。

无。

4. 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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (a) 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。
- (b) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (c) 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。

5. 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：

2007年度	宣告日	分配收益所属期间
第1号收益支付公告	2007/01/12	2006/12/12-2007/01/11
第2号收益支付公告	2007/02/13	2007/01/12-2007/02/12
第3号收益支付公告	2007/03/13	2006/02/13-2007/03/12

6. 关联方关系和关联方交易

(1). 关联人、关系、交易性质及法律依据列示

关 联 人	关 系	交易性质	法律依据
华安基金管理有限公司	基金管理人	提取管理费	基金合同
	基金发起人	提取销售服务费	

	基金注册与过户登记人		
	基金销售机构		
中国工商银行股份有限公司*	基金托管人	提取托管费	基金合同
	基金代销机构	提取销售服务费	
		银行间市场债券 成交通知单	
		买卖及回购交易	
上海国际信托投资有限公司	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		
上海广电(集团)有限公司	基金管理人的股东		
上海沸点投资发展有限公司	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		

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2). 关联方交易

本报告期与通过关联方席位进行的交易：无。

上年度 2005 年度与通过关联方席位进行的交易：无。

本报告期与关联方进行银行间市场债券买卖和回购交易情况：

关 联 人	买入债券 结算金额	卖出债券 结算金额	买入返售证券	利息收入	卖出回购证券	利息支出
中国工商银行股份有限公司	144,440,601,975.64	148,339,224,397.77	0.00	0.00	28,974,700,000.00	11,254,645.18

上年度 2005 年与关联方进行银行间市场债券买卖和回购交易情况：

关 联 人	买入债券 结算金额	卖出债券 结算金额	买入返售证券	利息收入	卖出回购证券	利息支出
中国工商银行股份有限公司	1,960,517,504.35	890,653,652.17	0.00	0.00	13,958,800,000.00	7,473,799.98

(3). 关联方报酬

基金管理人的报酬

本基金应支付基金管理人管理费，按前一日基金资产净值的 0.33% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。



本基金在本报告期间需支付基金管理费 80,838,396.71 元。(2005 年：136,953,736.99 元。)

基金托管费

本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

本基金在本报告期间需支付基金托管费 24,496,483.91 元。(2005 年：41,501,132.58 元。)

基金销售服务费

支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华安基金管理有限公司，再由华安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。

本基金在 2006 年度需向关联方支付的基金销售服务费如下：

关联方名称	2006 年度	2005 年度
华安基金管理有限公司	3,605,949.56	7,110,599.33
中国工商银行股份有限公司	25,234,936.72	37,797,621.40
合计	28,840,886.28	44,908,220.73

由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，并按银行同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 242,760,786.36 元(2005 年：3,204,221,187.54 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 13,790,605.79 元(2005 年：20,728,262.07 元)。

(4). 基金各关联方投资本基金的情况

基金管理公司运用固有资金投资本基金的情况：

2006 年度基金管理公司投资本基金的情况：

关联人	年初数		本年增持 份额	本年减持 份额	年末数		适用费率
	持有份额	持有比例			持有份额	持有比例	
华安基金管理有 限公司	-	-	-	-	-	-	-

2005 年度基金管理有限公司投资本基金的情况：

关联人	年初数		本年增持 份额	本年减持 份额	年末数		适用费率
	持有份额	持有比例			持有份额	持有比例	
华安基金管理有 限公司	-	-	-	-	-	-	-

关联方持有的基金份额：无。

7. 基金会计报表重要项目的说明

(1). 银行存款

明细项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
活期存款	242,760,786.36	3,204,221,187.54
定期存款	1,000,000,000.00	7,700,000,000.00
合计	1,242,760,786.36	10,904,221,187.54

(2). 应收利息明细：

明细项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
活期存款利息	71,834.43	1,089,928.05
定期存款利息	15,460,275.07	57,844,945.39
结算备付金利息	1,982.31	76,498.29
债券利息	25,043,886.23	42,989,382.21
买入返售证券利息	3,147,499.16	24,585,954.57
合计	43,725,477.20	126,586,708.51

(3). 待摊费用明细：

明细项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
信息披露费	0.00	0.00
审计费用	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

(4). 投资估值增值明细：

明细项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
债券估值增值余额	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

(5). 其他应收款：

明细项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
------	------------------	------------------



应收代垫的证券结算风险金	22,283.00	628,337.00
合计	22,283.00	628,337.00

(6). 其他应付款明细：

明细项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应付银行间结算费用	84,180.00	91,170.00
应付银行间交易费用	361,989.65	0.00
应付税金	770,542.74	0.00
合计	1,216,712.39	91,170.00

(7). 预提费用明细：

明细项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
信息披露费	0.00	0.00
审计费用	150,000.00	150,000.00
债券托管账户维护费	4,500.00	4,500.00
合计	154,500.00	154,500.00

(8). 实收基金变动明细：

明细项目	2006 年度	2005 年度
期初数	33,477,950,271.18	16,613,072,926.39
加：本期因申购的增加数	95,289,863,046.89	180,675,036,101.13
减：本期因赎回的减少数	122,663,794,877.96	163,810,158,756.34
期末数	6,104,018,440.11	33,477,950,271.18

(9). 未实现利得明细：

本年度内和上年度内未实现利得无发生额，期末余额为零。

(10). 卖出债券：

明细项目	2006 年度	2005 年度
卖出债券成交总额	362,720,481,380.43	92,262,388,857.04
减：成本总额	361,395,488,659.07	91,756,144,093.71
应收利息总额	1,346,506,853.32	273,017,111.38
债券差价收入	-21,514,131.96	233,227,651.95

(11). 存款利息收入：

明细项目	2006 年度	2005 年度
定期存款利息收入	91,303,329.68	57,885,445.39



通知存款利息收入	1,062,500.00	0.00
活期存款利息收入	13,790,605.79	20,728,262.07
结算备付金利息收入	454,852.79	3,003,542.91
合计	106,611,288.26	81,617,250.37

本基金于本年度发生一例定期存款到期前支取情况，未产生利息损失（2005 年：同）。

(12). 其他收入：

明细项目	2006 年度	2005 年度
其他收入	138,640,000.00	0.00
合计	138,640,000.00	0.00

本基金于本年度曾经遭遇大额赎回，在非正常市场状况下本基金债券交易发生了较重大的差价损失。为维护留存基金份额持有人的利益，本基金的基金管理人华安基金管理有限公司采取应急措施，动用公司的一般风险准备及自有资金弥补上述债券差价损失，相关补偿款项已全额支付本基金并计入其他收入（2005 年：无）。

(13). 其他费用：

明细项目	2006 年度	2005 年度
债券买卖及回购交易费用	2,207,411.20	3,462,318.97
信息披露费	300,000.00	340,000.00
审计费用	150,000.00	154,000.00
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他	0.00	40,000.00
合计	2,675,411.20	4,014,318.97

(14). 基金收益分配：

	2006 年度	2005 年度
累计收益分配金额	460,881,659.17	983,192,997.93

8. 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

(1) 本基金截止本报告期末流通受限的债券情况如下：

债券名称	数量	成本总额	估值方法	转让受限原因	流通受限期限
98三峡08	1,000,000	100,092,304.98	摊余成本	银行间未上市企业债	至 2007-1-18 到期

(2) 本基金截至 2006 年 12 月 31 日止从事银行间同业市场的债券回购交易形成



的卖出回购证券款余额 796,000,000.00 元(2005 年: 9,311,000,000.00 元), 系以如下债券作为质押:

债券名称	数量	成本总额	估值方法	转让受限原因	流通受限期限
04国开21	4,000,000	400,829,187.60	摊余成本	回购质押	2007-1-5
06进出04	3,000,000	298,662,328.98	摊余成本	回购质押	2007-1-4
06农发12	1,000,000	99,181,538.53	摊余成本	回购质押	2007-1-5
合计		798,673,055.11			

八、投资组合报告

(一) 报告期末基金资产组合

序号	资产组合	金额(元)	占总资产的比例
1	债券投资	4,908,101,000.17	70.86%
2	买入返售证券	619,200,000.00	8.94%
	其中: 买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00%
3	银行存款和清算备付金合计	1,246,765,356.83	18.00%
4	其他资产	152,018,209.27	2.19%
	合计	6,926,084,566.27	100.00%

注: 银行存款和清算备付金合计中包括 1,000,000,000.00 元商业银行定期存款投资。

(二) 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占资产净值的比例
1	报告期内债券回购融资余额	890,248,800,000.00	15.51%
	其中: 买断式回购融资		
2	报告期末债券回购融资余额	796,000,000.00	13.04%
	其中: 买断式回购融资		

报告期内货币市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的说明:

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例	原因	调整期
1	2006-1-4	27.51%	1月4日-7月20	已在规定期
2	2006-1-24	23.46%	日: 因赎回基金份额	限内调整合
3	2006-1-25	22.10%	额所引起	规
4	2006-2-6	21.51%		
5	2006-2-28	20.81%		
6	2006-4-20	20.09%		
7	2006-5-31	20.64%		
8	2006-7-18	27.79%		



9	2006-7-19	23.75%	
10	2006-7-20	20.04%	
11	2006-10-10	23.40%	10月10日-11月2日：由于华安富利基金出现持续大额赎回，正回购比例持续超过20%。
12	2006-10-11	22.30%	
13	2006-10-18	23.55%	
14	2006-10-19	24.31%	
15	2006-10-20	24.64%	
16	2006-10-23	21.74%	
17	2006-10-24	22.09%	
18	2006-10-25	31.66%	
19	2006-10-30	31.58%	
20	2006-11-1	28.74%	
21	2006-11-2	20.24%	
22	2006-11-7	25.38%	11月7日以后：由于华安富利基金出现持续大额赎回，规模大幅下降，按照当时的市场情况，卖出债券存在着一定的流动性压力，为了保护广大投资者的利益，公司一方面利用市场回购利率上升的有利时机，加大减券力度；另一方面在股东的支持下，采取积极有效的措施，化解了流动性风险，保护了投资者的利益。在此期间，正回购比例持续超过20%。
23	2006-11-8	33.91%	
24	2006-11-9	30.24%	
25	2006-11-10	30.43%	
26	2006-11-13	34.29%	
27	2006-11-14	34.83%	
28	2006-11-15	24.50%	
29	2006-11-16	32.27%	
30	2006-11-17	38.47%	
31	2006-11-20	39.59%	
32	2006-11-21	30.84%	
33	2006-11-22	31.03%	
34	2006-11-23	31.52%	
35	2006-12-4	21.77%	
36	2006-12-5	29.95%	
37	2006-12-6	39.57%	
38	2006-12-7	36.63%	
39	2006-12-8	37.11%	
40	2006-12-11	27.83%	
41	2006-12-12	28.00%	
42	2006-12-13	22.50%	
43	2006-12-14	22.60%	
44	2006-12-25	22.03%	
45	2006-12-26	22.39%	

(三) 基金投资组合平均剩余期限

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	129
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	179
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	64

报告期内投资组合平均剩余期限违规超过 180 天的说明：本报告期内无。

序号	发生日期	平均剩余期限（天）	原因	调整期
-	-	-	-	-

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	10.33%	13.04%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00%	
2	30 天(含)—60 天	10.78%	
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00%	
3	60 天(含)—90 天	16.09%	
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00%	
4	90 天(含)—180 天	48.20%	
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	14.60%	
5	180 天(含)—397 天(含)	25.58%	
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00%	
	合 计	110.98%	13.04%

(四) 报告期末债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占资产净值比例
1	国家债券	0.00	0.00%
2	金融债券	2,411,538,647.40	39.51%
	其中：政策性金融债	1,855,887,478.88	30.40%
3	央行票据	1,141,052,837.73	18.69%
4	企业债券	1,355,509,515.04	22.21%
5	其他	0.00	0.00%
	合 计	4,908,101,000.17	80.41%
	剩余存续期超过 397 天 的浮动利率债券	891,077,181.39	14.60%

2、基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张)		成本(元)	占资产净值比例 (%)
		自有投资	买断式回购		
1	04 建行 03 浮	5,446,500	0.00	555,651,168.52	9.10%
2	04 国开 21	5,000,000	0.00	501,036,484.50	8.21%
3	04 国开 17	3,800,000	0.00	382,565,682.80	6.27%
4	06 央票 48	3,500,000	0.00	345,099,569.24	5.65%
5	05 中信债 1	3,370,000	0.00	335,426,012.87	5.50%
6	06 进出 04	3,000,000	0.00	298,662,328.98	4.89%
7	06 农发 12	3,000,000	0.00	297,544,615.60	4.87%
8	06 农发 15	2,000,000	0.00	197,758,109.60	3.24%
9	06 央票 46	2,000,000	0.00	197,330,095.73	3.23%
10	06 央票 68	2,000,000	0.00	196,222,441.85	3.21%

(五) “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	2
报告期内偏离度的最高值	0.16%
报告期内偏离度的最低值	-0.25%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.08%

(六) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

(七) 投资组合报告附注

1、基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。

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声明

序号	发生日期	占基金资产 净值的比例	原因	调整期
1	2006-11-22	23.61%	由于华安富利基金出现持续大额赎回，规模大幅下降，按照当时的市场情况，卖出债券存在着一定的流动性压力，为了保护广大投资者的利益，公司一方面利用市场回购	已在规
2	2006-11-23	28.72%		定期限
3	2006-11-29	21.00%		内调整
4	2006-11-30	25.95%		合规
5	2006-12-1	33.56%		



6	2006-12-4	34.75%	利率上升的有利时机,加大减券力
7	2006-12-5	34.02%	度;另一方面在股东的支持下,采
8	2006-12-6	30.47%	取积极有效的措施,化解了流动性
9	2006-12-7	29.13%	风险,保护了投资者的利益。在此
10	2006-12-8	29.47%	期间,浮息债比例多次超过 20%。
11	2006-12-12	21.87%	

3、本报告期内需说明的证券投资决策程序

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。

4、其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	43,725,477.20
4	应收申购款	108,270,449.07
5	其他应收款	22,283.00
6	待摊费用	0.00
	合 计	152,018,209.27

九、基金份额持有人户数和持有人结构

基金份额持有人户数和持有人结构

项目	份额(份)	占总份额的比例
基金份额持有人户数	95,756(户)	-
平均每户持有基金份额	63,745.55	-
机构投资者持有的基金份额	1,908,635,168.91	31.27%
个人投资者持有的基金份额	4,195,383,271.20	68.73%

十、开放式基金份额变动

项目	份额(份)
基金合同生效日的基金份额总额	4,253,745,531.90
期初基金份额总额	33,477,950,271.18
加:本期申购基金份额总额	95,289,863,046.89
减:本期赎回基金份额总额	122,663,794,877.96
期末基金份额总额	6,104,018,440.11

十一、重大事件

(一)、基金份额持有人大会决议:无。

(二)、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). 2006 年 2 月 15 日，华安基金管理有限公司关于董事变更的公告，鉴于第二届董事会任期已经届满，经华安基金管理有限公司第十三次股东会议选举，产生由王成明先生、韩方河先生、辜昌基先生、俞妙根先生、顾培柱先生、张军先生、萧灼基先生、吴伯庆先生、夏大慰先生组成的第三届董事会，其中萧灼基先生，吴伯庆先生、夏大慰先生为独立董事。杜建国先生、缪恒生先生、柳亚男先生、陶晋先生、李华强先生、朱勇先生不再担任本公司董事。

(2). 2006 年 5 月 27 日，华安基金管理有限公司关于变更公司董事长的公告，经华安基金管理有限公司第三届董事会会议审议通过，并报中国证监会审核批准，免去杜建国先生董事长职务，由王成明先生代为履行公司董事长职务。

(3). 2006 年 8 月 19 日，华安基金管理有限公司关于由俞妙根先生代行董事长职务的公告，经华安基金管理有限公司第三届董事会审议通过，决定免除王成明先生公司代行董事长的职务，同时选举俞妙根先生代为履行公司董事长的职务。

(4). 2006 年 10 月 17 日，华安基金管理有限公司临时公告，接上级部门通知，公司总经理韩方河同志因涉嫌个人违纪，正在协助调查。对于上述事件，公司特澄清如下：一、上述调查仅涉及韩方河同志个人，与本公司及本公司旗下基金无关。二、公司在董事会的领导和大力支持下，目前公司的日常工作由常务副总经理邵杰军同志负责。本公司目前运作一切正常。

(5). 2006 年 11 月 7 日，华安基金管理有限公司临时公告，经股东会选举，徐建国先生、万才华先生任公司董事，王成明先生、韩方河先生不再担任公司董事；谢伟民先生、柳振铎先生任公司监事，韩国璋先生不再担任公司监事。经董事会选举，徐建国先生拟任公司董事长，俞妙根先生任公司副董事长，俞妙根先生不再担任代董事长；经华安基金管理有限公司监事会选举，谢伟民任公司监事长，陈涵不再担任监事长。经董事会审议，拟聘任俞妙根先生任公司总经理，韩方河先生不再担任公司总经理。上述董事、监事人员的变更按规定需报中国证监会备案，董事长的选举、总经理的聘任按规定尚需报中国证监会核准，在中国证监会核准程序没有完成之前，徐建国先生主持公司董事会工作，俞妙根先生主持公司日常工作。

(6). 2007 年 3 月 22 日，本基金管理人发布如下临时公告，根据《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》的规定，经华安基金管理有限公司股东会议决议，同意张军先生因个人原因辞去本公司董事职务。上述人员的变更已报中国证监会上海证监局备案。

2、本基金托管人重大人事变动如下：

2006 年，本基金托管人中国工商银行的专门基金托管部门发生的高管人事变动：无。

(三)、本报告期涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项：无。

(四)、基金投资策略的改变：无。

(五)、基金收益分配事项：

2006 年 1 月 1 日

至 2006 年 12 月 31 日

本报告期累计收益分配金额 460,881,659.17

本基金在本报告期内共进行了 12 次基金收益集中支付并结转为基金份额：

	收益支付日
第 1 次	2006 年 1 月 11 日
第 2 次	2006 年 2 月 13 日
第 3 次	2006 年 3 月 13 日
第 4 次	2006 年 4 月 11 日
第 5 次	2006 年 5 月 11 日
第 6 次	2006 年 6 月 12 日
第 7 次	2006 年 7 月 11 日
第 8 次	2006 年 8 月 11 日
第 9 次	2006 年 9 月 11 日
第 10 次	2006 年 10 月 11 日
第 11 次	2006 年 11 月 13 日
第 12 次	2006 年 12 月 11 日

(六)、基金改聘为其审计的会计师事务所情况：本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况：150,000.00 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。

(七)、基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形，包括稽查或处罚的次数、原因及结论，如监管部门提出整改意见的，应简单说明整改情况：无。

(八)、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或者超过 0.5% 的情况：本报告期内无。

项 目	发生日期	偏离度	披露报刊	披露日期
报告期内偏离度的绝对值 在 0.5%（含）以上	-	-	-	-

(九)、本报告期间租用证券公司席位情况如下：

1. 报告期内租用证券公司席位的变更情况：

新增席位：

券商名称	上交所席位数	深交所席位数
国泰君安证券股份有限公司	1	0

退租席位：无

2. 交易成交量及佣金情况：

(1). 席位数量和佣金情况：

券商名称	租用席位数量	佣金	占佣金总量比例
中银国际证券有限责任公司	1	-215,781.50	100%

国泰君安证券股份有限公司	1	-	-
合 计	2	-215,781.50	100%

(2). 债券及回购交易情况：

券商名称	债券成交量	占总成交 总量比例	回购成交量	占总成交 总量比例
中银国际证券有限责任公司	-	-	19,198,700,000.00	100%
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-
合 计	-	-	19,198,700,000.00	100%

3. 券商专用席位选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易席位供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 资历雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营行为规范；
- (3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (5) 证券研究或市场研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、个股分析、基金市场分析等各方面研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

4. 券商专用席位选择程序：

- (1) 对席位候选券商的综合服务进行评估
由研究发展部等部门组织相关人员依据上述席位选择标准和《券商服务评价办法》，对候选席位的券商服务质量和综合实力进行评估。
- (2) 填写《新增席位申请审核表》
研究发展部等部门汇总对各候选席位券商的综合评估结果，择优选出拟新增席位，填写《新增席位申请审核表》，对拟新增席位的必要性和合规性进行阐述。
- (3) 候选席位名单提交分管副总经理审批
公司分管副总经理对研究发展部等部门提交的《新增席位申请审核表》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《证券交易席位使用协议》，并通知基金托管人。

(十)、其他重大事项：



1. 变更基金份额发售机构：

公告事项	披露日期
1) 华安基金管理有限公司关于变更基金代销机构的公告,根据华安基金管理有限公司与中信建投证券有限责任公司、华夏证券股份有限公司 2005 年 12 月签署的协议书,自即日起,中信建投将作为华夏证券开放式基金业务的继承人,原华夏证券与华安基金签订的所有代销协议中应由华夏证券享有和承担的权利义务,均变更为由中信建投享有和承担,华夏证券不再享有和承担原代销协议规定的任何权利义务。	2006 年 1 月 12 日
2) 华安基金管理有限公司关于在交通银行开通基金转换业务的公告	2006 年 1 月 14 日
3) 华安基金管理有限公司关于新增渤海证券有限责任公司为华安现金富利投资基金代销机构的公告	2006 年 2 月 10 日
4) 华安基金管理有限公司关于新增国海证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	2006 年 3 月 7 日
5) 华安基金管理有限公司关于新增中信银行为华安现金富利投资基金代销机构的公告	2006 年 5 月 20 日
6) 华安基金管理有限公司关于开通“华安-浦发银基通”基金电子直销业务的公告	2006 年 6 月 20 日
7) 华安基金管理有限公司关于开通上海浦东发展银行网上银行办理“华安-浦发银基通”基金电子直销业务的公告	2006 年 7 月 25 日
8) 关于华安现金富利投资基金通过中国工商银行股份有限公司开办“利添利”账户理财的公告	2006 年 8 月 30 日
9) 华安基金管理有限公司关于新增中信万通证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	2006 年 12 月 25 日

2. 其他重大事项：

公告事项	披露日期
1) 华安基金管理有限公司关于本公司旗下开放式基金春节长假期间暂停交易的提示性公告	2006 年 1 月 23 日
2) 华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金“五一”长假前暂停申购及基金转换转入交易提示的公告	2006 年 4 月 25 日
3) 华安基金管理有限公司关于开通全国统一客户服务号码的公告,公司自 2006 年 6 月 20 日起正式开通全国统一客户服务号码 40088-50099 (长途话费由本公司支付),客户通过固定电话、小灵通和手机均可拨打。本公司原客户服务号码 021-68604666 仍可继续使用。	2006 年 6 月 20 日
4) 华安基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告,可以投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券。	2006 年 6 月 28 日
5) 华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金“十一”长假前暂停申购及基金转换转入交易提示的公告	2006 年 9 月 22 日
6) 华安基金管理有限公司关于修改旗下基金基金合同的公告,对收益分配条款和基金份额持有人大会表决条款作出修改。	2006 年 12 月 21 日



- 7) 华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金“春节”长假前暂停申购及基金转换转入交易提示的公告 2007 年 2 月 8 日

上述作为临时公告披露的重大事项均刊登于《上海证券报》、《证券时报》以及《中国证券报》上。



十二、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；
- 9、上述文件的存放地点和查阅方式如下：
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>。
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
2007 年 3 月 31 日