

华安汇财通货币市场基金

2014 年年度报告摘要

2014 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：二〇一五年三月三十日

§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 2015 年 3 月 25 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2014 年 7 月 17 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安汇财通货币
基金主代码	000709
交易代码	000709
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年7月17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	321,923,253.76份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求本金安全、确保资产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。
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	人民币七天通知存款利率（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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱鲲	蒋松云
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798

2.4 信息披露方式

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层、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	2014 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	4,605,018.01
本期利润	4,605,018.01
本期净值收益率	1.8256%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末
期末基金资产净值	321,923,253.76
期末基金份额净值	1.0000

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金合同于 2014 年 7 月 17 日生效。

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

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
过去三个月	1.0426%	0.0027%	0.3403%	0.0000%	0.7023%	0.0027%
自基金合同生效起至今	1.8256%	0.0024%	0.6214%	0.0000%	1.2042%	0.0024%

注：1、本基金业绩比较基准：同期七天通知存款利率（税后）。

2、本基金合同于 2014 年 7 月 17 日生效。

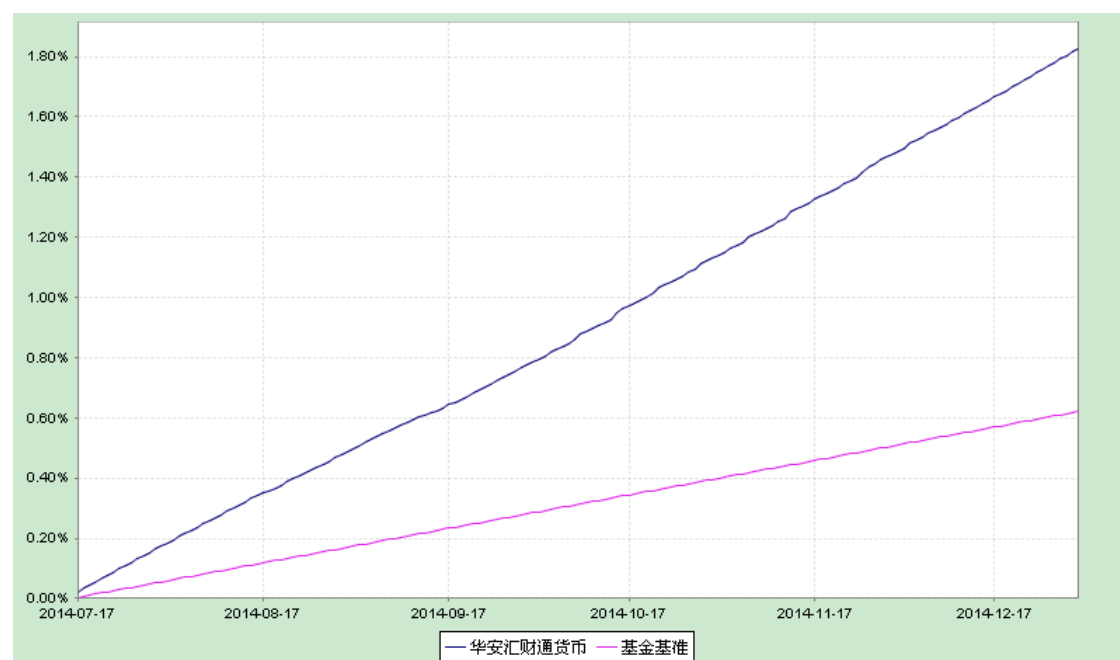
3、根据本基金合同的有关规定：本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：现金，通知存款，短期融资券，一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，剩余期限（或回售期限）在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。

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

华安汇财通货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

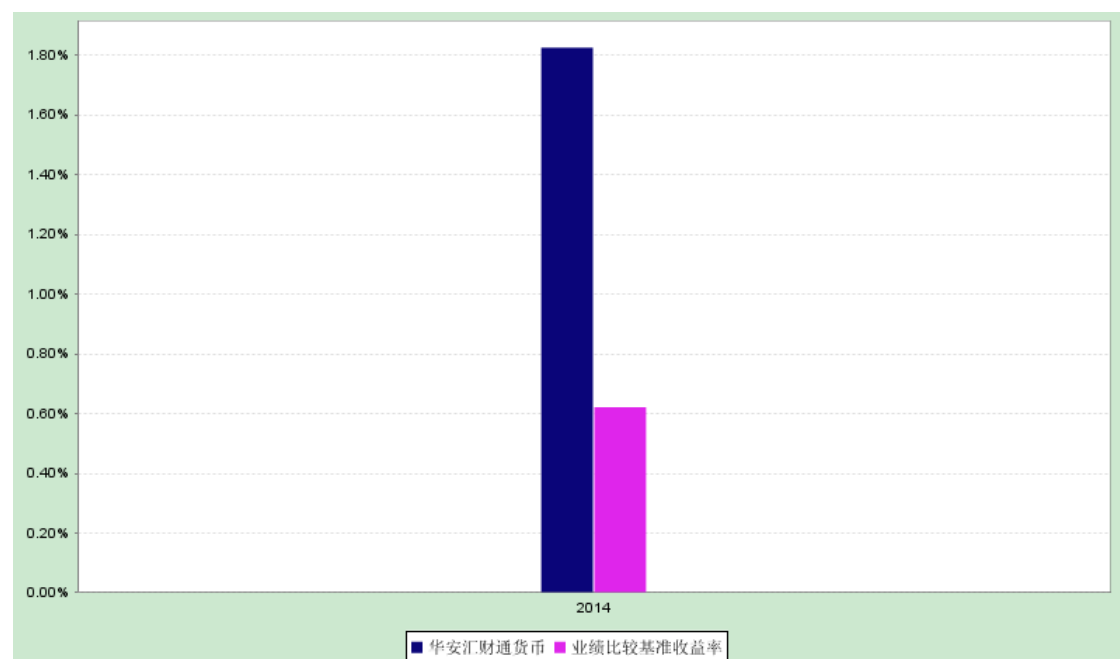
（2014 年 7 月 17 日至 2014 年 12 月 31 日）



3.2.3 自基金合同生效以来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

华安汇财通货币市场基金

合同生效日以来净值收益率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：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。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

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
2014 年	4,605,018.01	-	-	4,605,018.01	-

合计	4,605,018.01	-	-	4,605,018.01	-
----	--------------	---	---	--------------	---

§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 2014 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、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、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证 300 指数基金（LOF）、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安七日鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费股票、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易（ETF）、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化指数、华安年年红债券、华安生态优先股票、华安中证细分地产 ETF、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF 联接、华安高分红指数增强、华安中证细分医药 ETF 联接等 54 只开放式基金。管理资产规模达到 885 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贺涛	本基金的基金经理、固定收益部副总监	2014-07-17	-	17 年	金融学硕士（金融工程方向），17 年证券、基金从业经历。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。2008 年 4 月起担任华安稳定收益债券型证券投资基金的基金经理。2011 年 6 月起同时担任华安可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 12 月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013

					年 6 月起同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部助理总监。2013 年 8 月起担任固定收益部副总监。2013 年 10 月起同时担任华安现金富利投资基金、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。2014 年 7 月起同时担任本基金的基金经理。
张晟刚	本基金的基金经理	2014-07-17	2014-08-30	15 年	硕士研究生，15 年银行、证券行业从业经验。曾在中国银行上海分行、伦敦分行、总行交易中心担任高级交易员、高级经理等职务。2012 年 11 月加入华安基金管理有限公司。2013 年 1 月起担任华安日日鑫货币市场基金及华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理；2013 年 3 月起担任华安纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。2013 年 5 月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2013 年 10 月起同时担任华安现金富利投资基金、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。2014 年 7 月起同时担任本基金的基金经理。2014 年 8 月从华安基金离职。
朱才敏	本基金的基金经理	2014-11-20	-	7 年	金融工程硕士，具有基金从业资格证书，7 年基金行业从业经历。2007 年 7 月应届生毕业进入华安基金，历任金融工程部风险管理员、产品经理、固定收益部研究员、基金经理助理等职务。2014 年 11 月起同时担任本基金、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、华安双债添利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。
孙丽娜	本基金的基金经理	2014-08-30	-	4 年	硕士研究生，4 年债券、基金行业从业经验。曾任上海国际货币经纪公司债券经纪人。2010 年 8 月加入华安基金管理有限公司，先后担任债券交易员、基金经理助理。2014 年 8 月起担任本基金及华安日日鑫货币市场基金、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。

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《华安汇财通货币市场基金基金合同》、《华安汇财通货币市场基金招募说明书》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，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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、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同投标意向一一对应。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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的情况共出现了 32 次。原因：各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖数量极少，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，也未发现有异常。

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

美国经济在商业投资大幅增长、房地产市场持续回暖以及消费和出口增长等因素的共同驱动下强劲反弹，失业率大幅下降、从上年末的 6.7% 降至 2014 年末的 5.6%，在此背景下，美联储于 2014 年 11 月宣布结束量化宽松政策。欧元区经济弱于预期，通缩压力不断加大，实际内需下降明显，失业率居高不下，虽然欧央行出台了一系列宽松货币政策，但仍未能提振欧元区经济。日本经济受消费税率上调等因素影响，经济增速明显回落，消费和投资信心低迷，物价水平面临较大下行压力。新兴市场经济体增长普遍放缓，在美国货币政策回归正常化、地缘政治风险增大、国际油价大幅下跌、结构性问题凸显的背景下，部分新兴市场经济体面临资本外流风险。

国内经济延续 2013 年以来的调整态势，经济下行压力增加，在外需疲弱、内需持续回落、制造业去产能、房地产投资增速下滑等因素的共同作用下，2014 年 GDP 全年增长 7.4%，较 2013 年下降 0.3 个百分点。与此同时，受国际大宗商品价格下跌和内需疲弱等影响，PPI、CPI 持续走低，均处于近 5 年来的低位，通缩风险加大。央行基本退出常态化外汇干预，放宽人民币兑美元汇率日内波动区间，受美联储退出 QE 和央行降息等事件的影响，人民币兑美元汇率一改单边升值走势，双边波动加剧，人民币结汇需求减弱，外汇占款大幅下降，截止 2015 年 1 月已连续两月出现千亿级别的净减少，央行通过公开市场操作、SLF、MLF、定向降准、再贷款、PSL 和降准等多种方式注入基础货币，货币市场流动性整体较为宽裕，

但货币市场利率在 IPO、年末等部分时间节点仍阶段性走高。

债券市场全年在基本面和流动性的双重驱动下走出了一波牛市行情。一季度债市收益率下行，季末受“保增长”以及流动性边际收紧预期的影响，长久期债券出现调整，收益率曲线呈现陡峭化形态；在信托、公司债和中小企业私募债违约事件增多的影响下，市场信用风险偏好下降，中低等级产业债信用利差扩大，城投债因享受隐性国家信用而收益率下行。二季度债市在“宽货币”和“严监管”的双重驱动下继续演绎牛市行情，中长端收益率加速下行；中高等级短融和有政府信用背书的城投债仍然是信用债市场上交投的热点。三季度在国内经济重新下行的推动下，债券市场继续呈现牛市特征，收益率曲线平坦化下行，信用利差继续压缩。债券市场在四季度前段呈现快牛行情，后段受资金面趋紧以及中证登质押新规影响进入震荡市，收益率曲线平坦化下行，信用利差有所扩大。全年来看，收益率曲线平坦化下行，长端国开债下行幅度超过 170BP，短端下行 150BP 左右；信用利差出现分化，中高等级有所收窄，低等级则明显扩大。货币市场方面，银行间隔夜和 7 天回购日平均利率较上年分别下行 56BP 和 49BP 至 2.78%和 3.63%；长期限资金价格也有所下降，1 月 Shibor 较上年下行 23BP 至 4.58%。

本报告期内，汇财通逐步完成建仓，资产配置以中高等级短融和定存为主，适当运用杠杆，通过较高票息收入和积极的价差操作赚取超额收益。通过审慎和积极的管理，在把握流动性的基础上，积极努力为投资者赚取较高收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

投资回报：1.8256% 比较基准：0.6214%

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 2015 年，美国经济继续向好，可能在下半年实现首次加息，欧日经济复苏仍存在较大不确定性，面临经济增长乏力和通胀下行问题，新兴经济体仍面临调整压力和资金外流风险。大宗商品价格预计仍将低位徘徊，加之内需疲弱、产能过剩，国内通胀面临下行压力。从“三驾马车”看，固定资产投资增速在制造业投资去产能和地产投资远未改善的背景下，又面临基建投资资金来源不确定的问题，消费和进出口增长预计稳中趋降，因此判断国内经济增长下行压力仍然较大。一月份社会融资总量和 M2 增速双双创历史新低，人民币有效汇率升值，通胀下行导致实际利率维持高位，国内货币条件偏紧；与此同时，在国内经济不振和美国加息预期影响下，人民币兑美元汇率贬值预期不改，外汇占款预计仍将维持低位甚至持续负增长。因此预计货币政策仍将维持宽松，预计债券市场上半年延续牛市行情，下半年在经过半年的政策刺激后，随着经济动能的回升逐渐进入震荡行情，收益率曲线有望陡峭化，信用利差继续分化，中高等级信用利差继续收窄，低等级则继续扩大。

操作方面，我们将积极关注债市的投资机会，特别是中高评级短融，甄选个券进行配置和波段操作。同时也会关注逆回购和定存的价格走势，把握利率冲高时点锁定收益。在控制组合流动性和安全性风险的基础上，为投资者积极赚取高收益。

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

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历的描述

(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、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、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，首席投资官，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副总裁、首席投资官。

翁启森，基金投资部兼全球投资部总监，工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现华安香港精选、华安大中华升级基金的基金经理，、华安宏利股票型基金、华安大国新经济股票型基金的基金经理，华安基金管理有限公司总裁助理、基金投资部兼全球投资部总监。

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，现任华安优选的基金经理，投资研究部总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安稳定收益债券基金、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债添利债券基金、的基金经理，固定收益部副总监。华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安汇财通货币、华安年年红的基金经理，固定收益部副总监。

许之彦，指数投资部总监，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）、华安易富黄金 ETF 及联接基金的基金经理，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。

4.7 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，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。本报告期华安汇财通货币累计收益分配金额 4,605,018.01 元。

4.8 报告期内管理人对基金持有人数或资产净值预警情形的说明

无。

§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

本报告期内，本基金托管人在对华安汇财通货币市场基金的托管过程中，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

本报告期内，华安汇财通货币市场基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安汇财通货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本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汇财通货币市场基金 2014 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

本报告期基金财务报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师边卓群、濮晓达签字出具了安永华明（2015）审字第 60971571_B17 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安汇财通货币市场基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014年12月31日
资 产：	
银行存款	81,119,552.91
结算备付金	100,500.00
存出保证金	-

交易性金融资产	193,053,346.00
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	193,053,346.00
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	88,401,012.60
应收证券清算款	-
应收利息	3,027,944.24
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	2,500.00
资产总计	365,704,855.75
负债和所有者权益	本期末 2014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	43,399,734.90
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	69,191.62
应付托管费	12,813.23
应付销售服务费	64,066.26
应付交易费用	21,035.56
应交税费	-
应付利息	5,760.42
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	209,000.00
负债合计	43,781,601.99
所有者权益：	
实收基金	321,923,253.76
未分配利润	-
所有者权益合计	321,923,253.76
负债和所有者权益总计	365,704,855.75

注：（1）报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 321,923,253.76 份。

（2）本基金合同于 2014 年 7 月 17 日生效。

7.2 利润表

会计主体：华安汇财通货币市场基金

本报告期：2014 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年7月17日（基金合同生效日）至2014年12月31日
一、收入	5,788,504.58
1. 利息收入	5,587,982.82
其中：存款利息收入	3,498,032.87
债券利息收入	1,460,851.04
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	629,098.91
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	200,521.76
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	200,521.76
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-
减：二、费用	1,183,486.57
1. 管理人报酬	313,277.42
2. 托管费	58,014.35
3. 销售服务费	290,071.71
4. 交易费用	-
5. 利息支出	303,083.74
其中：卖出回购金融资产支出	303,083.74
6. 其他费用	219,039.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	4,605,018.01
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	4,605,018.01

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安汇财通货币市场基金

本报告期：2014 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014年7月17日（基金合同生效日）至2014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）	251,657,902.48	-	251,657,902.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,605,018.01	4,605,018.01
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）	70,265,351.28	-	70,265,351.28
其中：1. 基金申购款	705,382,469.01	-	705,382,469.01
2. 基金赎回款	-635,117,117.73	-	-635,117,117.73
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）	-	-4,605,018.01	-4,605,018.01
五、期末所有者权益（基金净值）	321,923,253.76	-	321,923,253.76

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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：章国富，会计机构负责人：陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安汇财通货币市场基金(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[2014]607 号《关于核准华安汇财通货币市场基金募集的批复》的核准，由华安基金管理有限公司作为管理人于 2014 年 7 月 7 日到 2014 年 7 月 10 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2014）验字第 60971571_B07 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2014 年 7 月 17 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 251,603,578.39 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 54,324.09 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 251,657,902.48 元，折合 251,657,902.48 份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构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。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：现金，通知存款，短期融资券，一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，剩余期限（或回售期限）在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据，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。

法律法规或监管机构允许货币市场基金投资其他货币市场基金或同业存单的，在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的前提下，本基金可参与其他货币市场基金或同业存单的投资，不需召开份额持有人大会，具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

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：人民币七天通知存款利率（税后）。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《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<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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2014年12月31日的财务状况以及2014年7月17日（基金合同生效日）至2014年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2014年7月17日（基金合同生效日）起至2014年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金的金融资产分类为交易类金融资产及贷款和应收款项，在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债，以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

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

(1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资；

债券投资按实际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，对于贴息债券，应作为债券投资成本；

卖出银行间同业市场交易的债券，于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(2) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金金融工具的估值方法具体如下：

1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

2) 债券投资

基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

3) 回购协议

(1) 基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

(2) 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

4) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值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价格估值；

(2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合。其中，对于偏离度的绝对值达到或超过 0.50%的情形，基金管理人应编制并披露临时报告；

(3) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 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、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、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。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会基金部通知(2006)22 号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定，因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担；

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价

款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.9 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.27% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率逐日计提；

(3) 基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) 本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3) “每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理；

(4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5) 本基金每日收益支付只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；投资人在每日收益支付时，若当日净收益大于零，则增加投资人基金份额；若当日净收益等于零，则保持投资人基金份额不变；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日净收益小于零，缩减投资人基金份额；

(6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，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，继续免征营业税和企业所得税；

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。

7.4.6.2 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

7.4.7 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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
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
上海锦江国际投资管理有限公司	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
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年7月17日（基金合同生效日）至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	313,277.42
其中：支付销售机构的客户维护费	4,738.43

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.27%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.27\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年7月17日（基金合同生效日）至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	58,014.35

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
华安基金管理有限公司	229,623.56
合计	229,623.56

注：基金销售服务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：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2014 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日	
基金合同生效日（2014 年 7 月 17 日）持有的基金份额		-
报告期间申购/买入总份额		50,621,657.59
报告期间因拆分变动份额		-
减：报告期间赎回/卖出总份额		-
报告期末持有的基金份额		50,621,657.59
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例		15.72%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,119,552.91	45,472.81

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.9 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 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金融资产款余额人民币 43,399,734.90 元，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
011481004	14 淮南矿 SCP004	2015-01-05	99.95	100,000	9,995,371.11
011488003	14 豫投资 SCP003	2015-01-05	99.98	100,000	9,997,965.12
011499069	14 宁城建 SCP001	2015-01-05	99.97	60,000	5,998,221.43
041456046	14 青国投 CP001	2015-01-05	100.40	100,000	10,039,623.88
041456061	14 陕交建 CP003	2015-01-05	99.96	100,000	9,995,501.69
合计		-	-	460,000	46,026,683.23

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 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证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 公允价值

7.4.10.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债, 其因剩余期限不长, 公允价值与账面价值相若。

7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层次的余额, 属于第二层次的余额为人民币 193,053,346.00 元, 无属于第三层次余额。

7.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的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。

7.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2015 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§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	193,053,346.00	52.79
	其中: 债券	193,053,346.00	52.79
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	88,401,012.60	24.17
	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	81,220,052.91	22.21
4	其他各项资产	3,030,444.24	0.83
	合计	365,704,855.75	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	8.47	
	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	43,399,734.90	13.48
	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

8.3 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%。

8.4 基金投资组合平均剩余期限

8.4.1 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	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	5

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。

8.4.2 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	53.63	13.48
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	18.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	6.21	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	9.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-

	浮动利率债		
5	180 天(含)—397 天 (含)	24.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	112.66	13.48

8.5 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	19,997,365.00	6.21
	其中：政策性金融债	19,997,365.00	6.21
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	173,055,981.00	53.76
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	193,053,346.00	59.97
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	041464028	14 连城投 CP001	100,000	10,073,196.23	3.13
2	041456046	14 青国投 CP001	100,000	10,039,623.88	3.12
3	140410	14 农发 10	100,000	10,005,546.22	3.11
4	071440004	14 东吴证券 CP004	100,000	9,999,537.69	3.11
5	071442004	14 西部证券 CP004	100,000	9,999,319.00	3.11
6	071415012	14 申万 CP012	100,000	9,998,320.05	3.11
7	011488003	14 豫投资 SCP003	100,000	9,997,965.12	3.11
8	071422011	14 齐鲁证券 CP011	100,000	9,997,914.61	3.11
9	011499041	14 徐工 SCP002	100,000	9,997,363.32	3.11
10	011499069	14 宁城建 SCP001	100,000	9,997,035.71	3.11

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.18%
报告期内偏离度的最低值	-0.17%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.09%

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 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 本报告期内本基金不存在剩余期限小于 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。

8.9.3 本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	3,027,944.24
4	应收申购款	-
5	其他应收款	2,500.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,030,444.24

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

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
8,542	37,687.11	187,517,737.76	58.25%	134,405,516.00	41.75%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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基金	1,100,954.49	0.34199%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年7月17日)基金份额总额	251,657,902.48
本报告期期初基金份额总额	251,657,902.48
本报告期基金总申购份额	705,382,469.01
减：本报告期基金总赎回份额	635,117,117.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	321,923,253.76

注：申购含红利再投份额。

§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) 2014年9月15日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司董事长变更公告，朱仲群先生不再担任本基金管理人的董事长，由朱学华先生担任本基金管理人的董事长、法定代表人以及党总支书记。

(2) 2014年9月17日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司总经理变更公告，李勃先生不再担任本基金管理人的总经理，由董事长朱学华先生代任本基金管理人的总经理。

(3) 2014年12月24日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告，童威先生新任本基金管理人的副总经理。

(4) 2014年8月30日，基金管理人发布了华安汇财通货币市场基金基金经理变更公告，张晟刚先生不再担任本基金的基金经理，聘任孙丽娜女士担任本基金的基金经理，与贺涛先生共同管理本基金。

(5) 2014年11月20日，基金管理人发布了华安汇财通货币市场基金基金经理变更公告，增聘朱才敏女士担任本基金的基金经理，与贺涛先生、孙丽娜女士共同管理本基金。

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：

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

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。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 50,000.00 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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、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	
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财富里昂证券有限责任公司 (华信证券)	1	-	-	-	-	-
川财证券经纪有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国金证券有限责任公司上海 中山南路证券营业部	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
开源证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	2	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
世纪证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	-
中天证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

中国中投证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财富里昂证券有限责任公司 (华信证券)	-	-	-	-	-	-
川财证券经纪有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
广发华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国金证券有限责任公司上海 中山南路证券营业部	-	-	383,300,000.00	93.60%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	-	-	-	-	-	-

上海证券有限责任公司	-	-	26,200,000.00	6.40%	-	-
世纪证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
中天证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

注：1、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、本报告期内，本基金新增安信证券、财富里昂、川财证券、东北证券、东兴证券、高华证券、广发华福、广发证券、国都证券、国泰君安、国信证券、恒泰证券、宏源证券、华创证券、华融证券、华泰证券、开源证券、民生证券、世纪证券、西部证券、信达证券、兴业

证券、中国银河证券、长城证券、招商证券、中国国际金融、中天证券、中信证券、中银国际证券各 1 个席位；新增国金证券、民族证券、齐鲁证券、上海证券、中投证券各 2 个席位。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

华安基金管理有限公司
二〇一五年三月三十日