

**华安现金富利投资基金**  
**2015 年年度报告**  
**2015 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：二〇一六年三月二十八日

## §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 2016 年 3 月 22 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 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | 2         |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | 5         |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>          | 7         |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 错误！未定义书签。 |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | 12        |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 12        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 14        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 14        |
| 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             | 16        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 17        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 17        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 18        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 20        |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明        | 错误！未定义书签。 |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | 20        |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 20        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 20        |
| 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      | 20        |
| <b>§6 审计报告</b>                          | 21        |
| 6.1 管理层对财务报表的责任                         | 21        |
| 6.2 注册会计师的责任                            | 21        |
| 6.3 审计意见                                | 21        |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | 22        |
| 7.1 资产负债表                               | 22        |
| 7.2 利润表                                 | 23        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 25        |
| 7.4 报表附注                                | 26        |
| <b>§8 投资组合报告</b>                        | 51        |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 51        |
| 8.2 债券回购融资情况                            | 51        |
| 8.3 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 53        |
| 8.4 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      | 53        |
| 8.5“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离           | 54        |
| 8.6 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   | 54        |

|                                        |                  |
|----------------------------------------|------------------|
| 8.7 投资组合报告附注 .....                     | 54               |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>              | <b>55</b>        |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....            | 55               |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人 .....                 | 错误！未定义书签。        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....         | 55               |
| 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....              | 错误！未定义书签。        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>             | <b>56</b>        |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                | <b>56</b>        |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                 | 56               |
| 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 ..... | 56               |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....      | 57               |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                   | 57               |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....            | 57               |
| 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 .....    | 57               |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....           | 57               |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....            | 58               |
| 11.9 其他重大事件 .....                      | 59               |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>        | <b>错误！未定义书签。</b> |
| <b>§13 备查文件目录 .....</b>                | <b>64</b>        |
| 13.1 备查文件目录 .....                      | 64               |
| 13.2 存放地点 .....                        | 64               |
| 13.3 查阅方式 .....                        | 64               |

## §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            |                     |
| 基金主代码           | 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      | 39,671,126,603.30 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 | 2,591,072,074.22 份  | 37,080,054,529.08 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 | <p>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。</p> <p>1、资产配置策略：</p> <p>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。</p> <p>2、其它操作策略：</p> <p>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</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |
| 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<br>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        |
| 注册地址        |      | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层 | 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层、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 | 朱学华                      | 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 层、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(特殊普通合伙) | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 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 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 | 2015 年        |                | 2014 年        |                | 2013 年        |                |
|---------------|---------------|----------------|---------------|----------------|---------------|----------------|
|               | 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       | 59,699,920.87 | 426,318,272.19 | 96,908,067.22 | 244,949,268.12 | 99,882,967.62 | 355,409,475.11 |
| 本期利润          | 59,699,920.87 | 426,318,272.19 | 96,908,067.22 | 244,949,268.12 | 99,882,967.62 | 355,409,475.11 |
| 本期净值收益率       | 3.4078%       | 3.6561%        | 4.4721%       | 4.7218%        | 3.8845%       | 4.1339%        |

| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末          |                   | 2014 年末          |                   | 2013 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      | 2,591,072,074.22 | 37,080,054,529.08 | 4,782,057,280.71 | 15,413,779,695.69 | 1,936,392,682.84 | 5,125,616,075.45 |
| 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  | 2015 年末          |                   | 2014 年末          |                   | 2013 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       |
| 累计净值收益率       | 42.9899%         | 24.9274%          | 38.2782%         | 20.5214%          | 32.3596%         | 15.0878%         |

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。

## 3.2 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 | 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      | 0.6880%  | 0.0023%     | 0.0882%    | 0.0000%       | 0.5998%  | 0.0023% |
| 过去六个月      | 1.3491%  | 0.0025%     | 0.1764%    | 0.0000%       | 1.1727%  | 0.0025% |
| 过去一年       | 3.4078%  | 0.0035%     | 0.3500%    | 0.0000%       | 3.0578%  | 0.0035% |
| 过去三年       | 12.2279% | 0.0040%     | 1.0500%    | 0.0000%       | 11.1779% | 0.0040% |
| 过去五年       | 24.9351% | 0.0050%     | 2.6598%    | 0.0002%       | 22.2753% | 0.0048% |
| 自基金合同生效起至今 | 42.9899% | 0.0058%     | 6.2709%    | 0.0005%       | 36.7190% | 0.0053% |

#### 2. 华安现金富利货币 B:

| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|    |          |             |            |               |     |     |

|            |          |         |         |         |          |         |
|------------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去三个月      | 0.7484%  | 0.0023% | 0.0882% | 0.0000% | 0.6602%  | 0.0023% |
| 过去六个月      | 1.4712%  | 0.0025% | 0.1764% | 0.0000% | 1.2948%  | 0.0025% |
| 过去一年       | 3.6561%  | 0.0035% | 0.3500% | 0.0000% | 3.3061%  | 0.0035% |
| 过去三年       | 13.0370% | 0.0041% | 1.0500% | 0.0000% | 11.9870% | 0.0041% |
| 过去五年       | 22.2942% | 0.0040% | 1.9398% | 0.0002% | 20.3544% | 0.0038% |
| 自基金合同生效起至今 | 24.9274% | 0.0046% | 2.3087% | 0.0002% | 22.6187% | 0.0044% |

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。

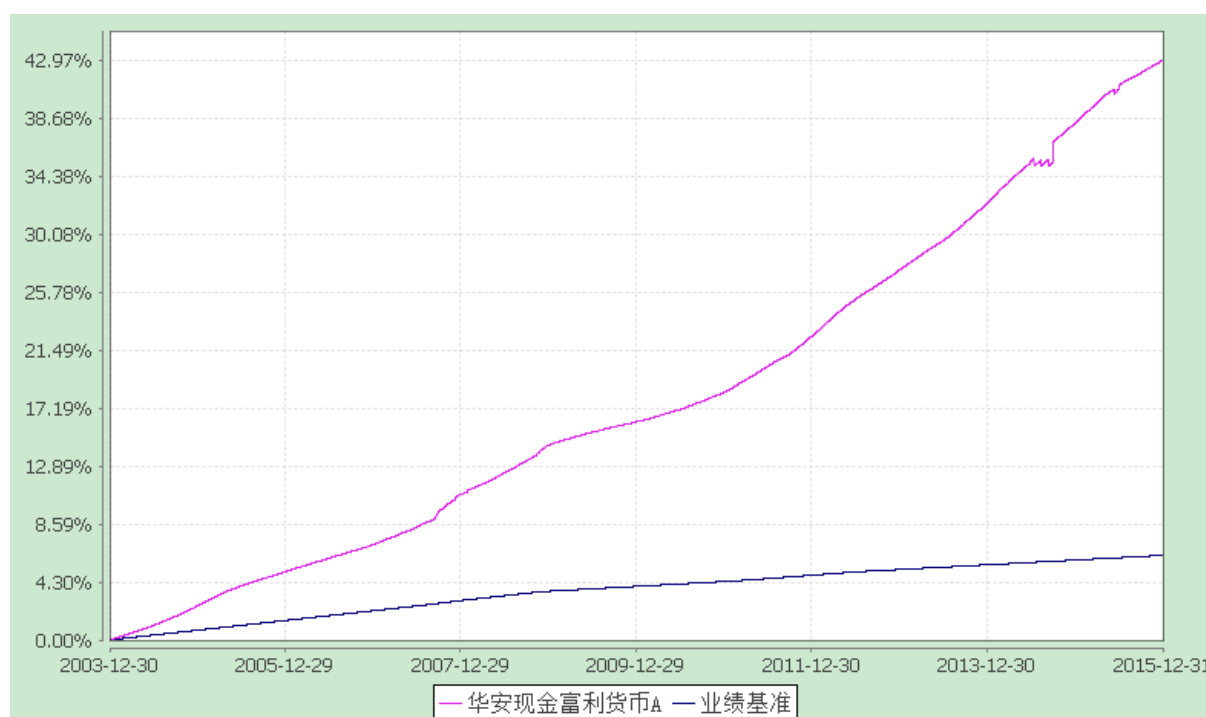
### 3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 华安现金富利投资基金

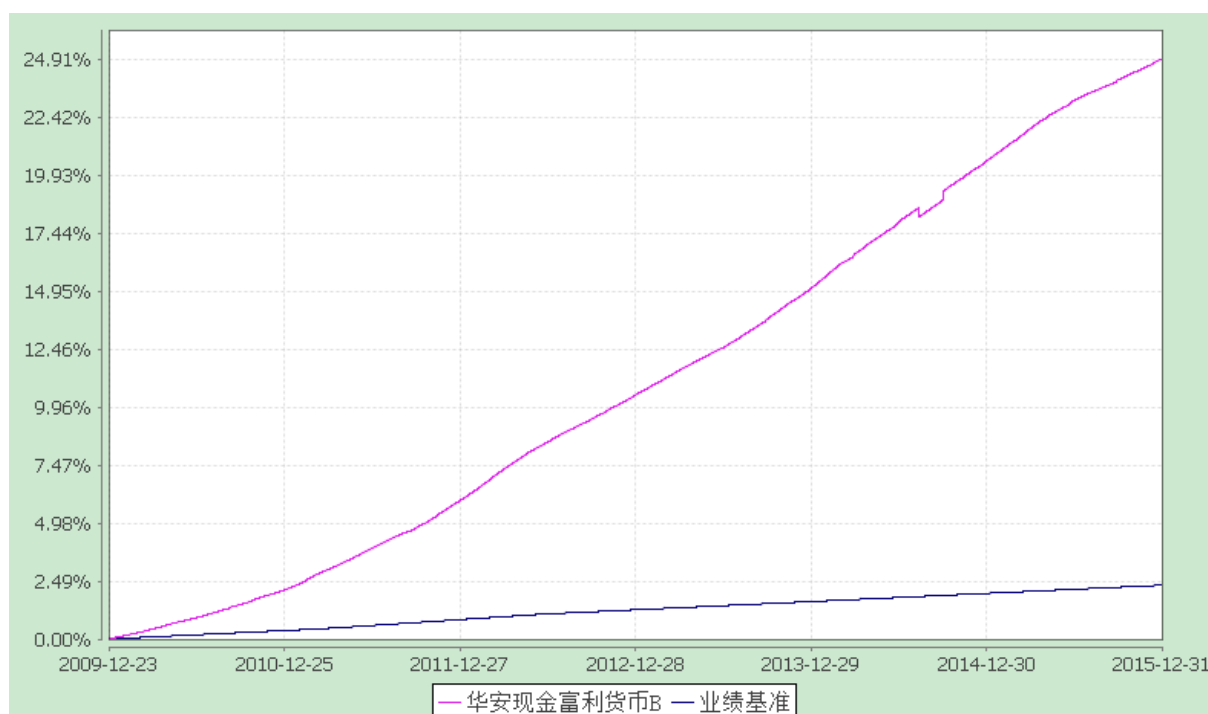
自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2003 年 12 月 30 日至 2015 年 12 月 31 日)

#### 1、华安现金富利货币 A



#### 2、华安现金富利货币 B



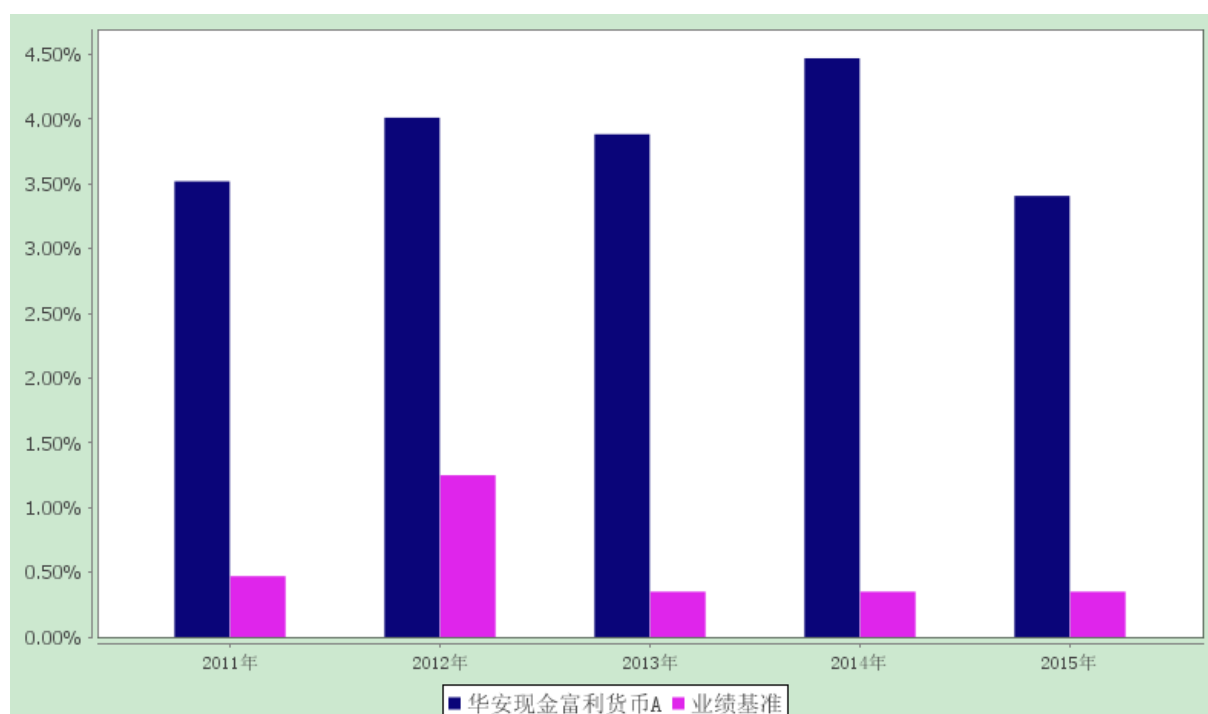
注：自 2009 年 12 月 23 日起，本基金实行销售服务费分级收费方式，分设两级基金份额：A 级基金份额和 B 级基金份额。详情请参阅相关公告。

### 3.2.3 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

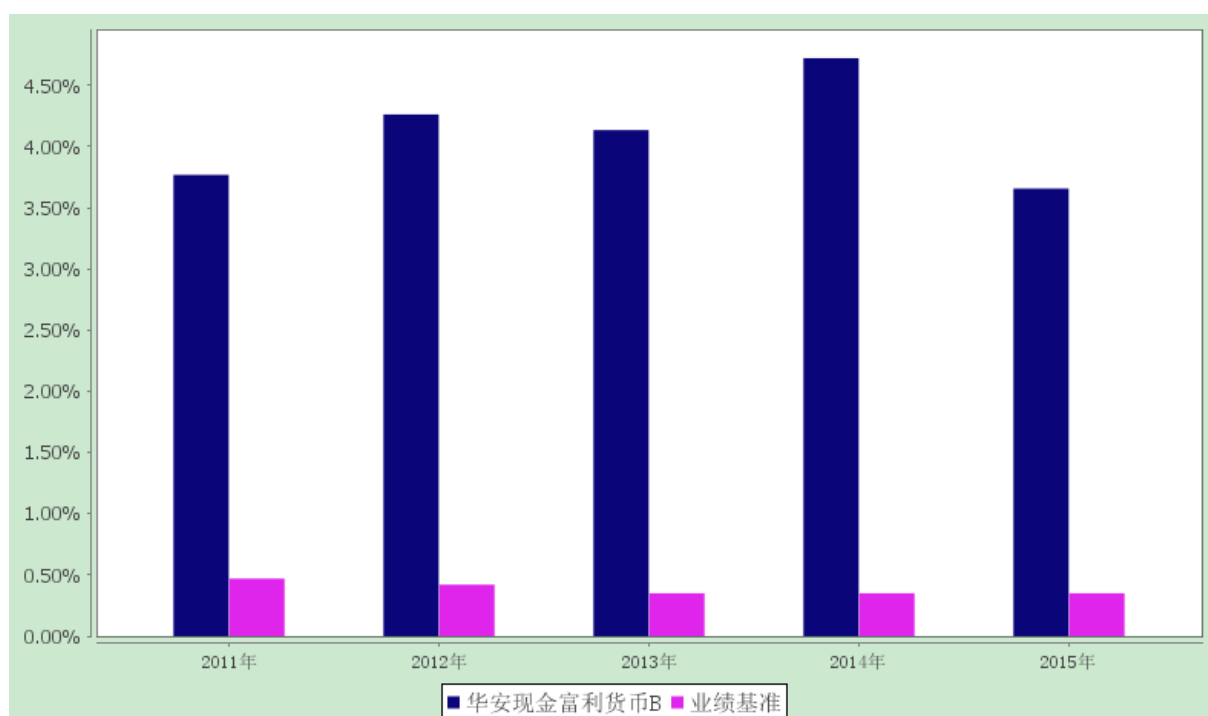
华安现金富利投资基金

过去五年基金净值收益率与业绩比较基准收益率的对比图

#### 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

华安现金富利货币 A：

单位：人民币元

| 年度   | 已按再投资<br>形式转实收<br>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 |
|------|----------------------|---------------|----------------|----------------|----|
| 2013 | 95,826,330.82        | 11,251,383.07 | -7,194,746.27  | 99,882,967.62  | -  |
| 2104 | 89,530,034.70        | 9,737,104.12  | -2,359,071.60  | 96,908,067.22  | -  |
| 2015 | 58,264,289.19        | 10,254,908.05 | -8,819,276.37  | 59,699,920.87  | -  |
| 合计   | 243,620,654.71       | 31,243,395.24 | -18,373,094.24 | 256,490,955.71 | -  |

华安现金富利货币 B：

单位：人民币元

| 年度 | 已按再投资<br>形式转实收 | 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 |
|----|----------------|---------------|----------|----------|----|
|    |                |               |          |          |    |

|      | 基金             |                |               |                  |   |
|------|----------------|----------------|---------------|------------------|---|
| 2013 | 327,512,836.16 | 31,875,827.05  | -3,979,188.10 | 355,409,475.11   | - |
| 2014 | 205,945,827.06 | 32,713,960.73  | 6,289,480.33  | 244,949,268.12   | - |
| 2015 | 345,338,061.73 | 54,440,829.12  | 26,539,381.34 | 426,318,272.19   | - |
| 合计   | 878,796,724.95 | 119,030,616.90 | 28,849,673.57 | 1,026,677,015.42 | - |

## §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 2015 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、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、华安上证龙头企业 ETF 联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证 300 指数（LOF）、华安科技动力混合、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、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、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 量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分地产 ETF、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济股票、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、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华

安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合等 71 只开放式基金。管理资产规模达到 1558.45 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<br>(助理) 期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|----|----------------------------------|----------------------|------|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                  | 任职日期                 | 离任日期 |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 贺涛 | 本基金的<br>基金经<br>理、固定<br>收益部总<br>监 | 2013-10-08           | -    | 18 年       | 金融学硕士（金融工程方向），18 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 月起同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理。2015 年 2 月起担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起担任固定收益部总监。2015 年 5 月起担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 9 月起担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 12 月起，同时担任华安乐惠保本混 |

|     |          |            |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----|----------|------------|---|-----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          |            |   |     | 合型证券投资基金的基金经理。                                                                                                                                                                                                                                    |
| 孙丽娜 | 本基金的基金经理 | 2014-10-30 | - | 5 年 | 硕士研究生，5 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 月起担任华安日日鑫货币市场基金及华安汇财通货币市场基金、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 月起同时担任本基金的基金经理。2015 年 2 月起担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安添颐养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。 |

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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易

执行机会。(1) 交易所二级市场业务, 遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则, 实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2) 交易所一级市场业务, 投资组合经理按意愿独立进行业务申报, 集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签, 则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配, 且以公司名义获得, 则投资部门在合规监察员监督参与下, 进行公平协商分配。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则, 先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群, 发布询价需求和结果, 做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标, 则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向, 交易员以此进行投标, 以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配, 且以公司名义获得, 则投资部门在风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% 的次数为 1 次, 未出现异常交易。原因是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%。从同向交易统计检验和实际检查

的结果来看，未发现异常。

#### 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

2015 年，全球经济复苏出现分化，主要发达经济体经济基本面和货币政策出现明显背离，美联储基于对经济复苏、充分就业和通胀的信心，启动加息周期；欧元区继续推进量化宽松政策，对经济的刺激效应进一步凸显，消费信心回升，PMI 数据和行业景气指数趋势改善；相反，新兴经济体国家纷纷开启经济转型升级之路，但整体缺乏出色表现，综合领先指标进一步走弱。其中，三季度全球金融市场的震荡加剧在一定程度上增加了经济进一步复苏的难度，尤其是 8 月份人民币汇改引发了全球金融市场的极度动荡，波及新兴市场的货币贬值潮、原油和权益市场的巨震，加剧资金外流的恐慌预期。目前国内经济依旧处于下行周期，工业企业经济利润指标显著下降，工业增速和投资增速均出现下滑，反映出投资疲软。尽管内需处于相对稳定的阶段，但并不能抵消制造业低迷带给国内经济稳增长的压力，依靠政府投资的基础设施建设投资因地方债务控制，其上升幅度也相对有限，另外，进出口数据的疲软进一步推动了经济下行的压力。央行在 2015 年多次降准降息，同时频繁使用各类货币政策工具对中短期流动性进行调节，并逐步构建利率走廊模式，以维持市场流动性宽松的格局。在经济基本面疲软和宽松货币政策推动下，银行间流动性总体较为充裕，回购利率保持在低位水平，中长端收益率出现大幅下行，曲线更加平坦化，信用利差和期限利差进一步收窄。

本报告期内，我们勤勉尽责，稳健操作，在保证组合流动性安全的前提下，通过灵活配置组合的资产结构，甄选优质个券，控制存款银行资质，科学管理现金流分布，维持组合适当的剩余期限和稳健的杠杆水平，适时根据市场变化做出调整，灵活把握市场投资机会，为持有人获得了可观的组合收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年华安富利投资收益率及规模变化：

###### 1. 华安现金富利货币 A

投资回报：3.4078% 比较基准：0.3500%

期初规模：47.82 亿 期末规模：25.91 亿

###### 2. 华安现金富利货币 B

投资回报：3.6561% 比较基准：0.3500%

期初规模：154.14 亿 期末规模：370.80 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

短期内，人民币贬值和国际化受到较大阻力和压力，但是前期美元指数一路高歌，采取盯紧策略的人民币汇率存在高估现象，贬值预期依然存在，未来汇率双向波动难免加剧；国内经济方面，1 月份国内银行信贷金额远超市场预期、房地产减税政策出台、巨额地方债务置换等释放融资限制有所松动信号，稳增长预期有所强化，但是去产能、去库存和去杠杆的结构性问题不解决，经济下行压力依然不减，因此，预计未来供给侧改革和需求侧刺激将两手抓，攻守兼备，防止经济出现断崖式下行。基于实体经济尚未出现复苏拐点，通胀依然处于低位徘徊，央行预计将继续实施稳健的货币政策，增加短期货币工具操作频率，维持货币市场适当的流动性。整体上看，债券市场的估值分化仍然会持续：一方面实际资质较好的品种估值仍然安全，而另一方面，产能过剩行业以及实际资质较弱的品种仍然将承受信用风险和估值风险双重压力，高低等级利差将继续扩大。

我们将继续重视组合的流动性风险，将基金资产安全和收益稳定的重要性置于对高收益的追求之上，组合维持适度的久期策略，灵活操作捕捉市场投资机会；同时，我们将跟踪债券的信用风险，定期梳理组合持仓券种，资产配置向中高等级品种倾斜。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，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核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、销售适用性等方面的合规培训和内部审计，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

（2）强化内控建设，持续进行投资管理人员合规培训，坚守“三条底线”；

（3）做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。

(4) 推动落实公司投资、运营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) 按照法规的要求, 做好旗下各只基金的信息披露工作, 做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

(6) 有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核, 强化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: 总经理助理(分管投资研究)、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:

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、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经理助理、基金投资部兼全球投资部总监。

赵 敏：研究生学历。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作，历任华安基金管理有限公司综合管理部总经理、电子商务部总经理、上海营销总部总经理，现任华安基金管理有限公司总经理助理。

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、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，现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 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。

#### 4.8 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 59,699,920.87 元，华安现金富利货币 B 累计收益分配金额 426,318,272.19 元。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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投资运作遵规守信、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 2015 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(2016)第 20872 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 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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(特殊普通合伙)中国注册会计师

单 峰 周 祎

上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

2015-03-23

## §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：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产       | 附注号     | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产：      |         | -                       | -                        |
| 银行存款     | 7.4.7.1 | 13,835,694,100.19       | 7,321,605,287.05         |
| 结算备付金    |         | 1,904,761.90            | 1,000,000.00             |
| 存出保证金    |         | -                       | -                        |
| 交易性金融资产  | 7.4.7.2 | 9,729,378,219.29        | 4,803,424,504.45         |
| 其中：股票投资  |         | -                       | -                        |
| 基金投资     |         | -                       | -                        |
| 债券投资     |         | 9,729,378,219.29        | 4,803,424,504.45         |
| 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 | 15,631,331,046.97       | 7,459,887,589.82         |
| 应收证券清算款  |         | -                       | -                        |
| 应收利息     | 7.4.7.5 | 99,137,654.83           | 126,547,790.23           |
| 应收股利     |         | -                       | -                        |
| 应收申购款    |         | 456,995,260.85          | 547,864,786.05           |
| 递延所得税资产  |         | -                       | -                        |
| 其他资产     | 7.4.7.6 | -                       | 40,800.00                |

|                   |            |                                 |                                  |
|-------------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产总计</b>       |            | <b>39,754,441,044.03</b>        | <b>20,260,370,757.60</b>         |
| <b>负债和所有者权益</b>   | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2014 年 12 月 31 日</b> |
| 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             |            | 38,094,604.60                   | 41,073,365.90                    |
| 应付管理人报酬           |            | 5,549,896.22                    | 2,379,070.11                     |
| 应付托管费             |            | 1,681,786.71                    | 720,930.32                       |
| 应付销售服务费           |            | 447,718.73                      | 543,119.67                       |
| 应付交易费用            | 7.4.7.7    | 204,700.77                      | 118,566.47                       |
| 应交税费              |            | -                               | -                                |
| 应付利息              |            | -                               | -                                |
| 应付利润              |            | 36,945,733.70                   | 19,225,628.73                    |
| 递延所得税负债           |            | -                               | -                                |
| 其他负债              | 7.4.7.8    | 390,000.00                      | 473,100.00                       |
| <b>负债合计</b>       |            | <b>83,314,440.73</b>            | <b>64,533,781.20</b>             |
| <b>所有者权益：</b>     |            | -                               | -                                |
| 实收基金              | 7.4.7.9    | 39,671,126,603.30               | 20,195,836,976.40                |
| 未分配利润             | 7.4.7.10   | -                               | -                                |
| <b>所有者权益合计</b>    |            | <b>39,671,126,603.30</b>        | <b>20,195,836,976.40</b>         |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |            | <b>39,754,441,044.03</b>        | <b>20,260,370,757.60</b>         |

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 39,671,126,603.30 份，其中 A 级基金份额总额 2,591,072,074.22 份，B 级基金份额总额 37,080,054,529.08 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华安现金富利投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|----------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |          | <b>566,987,235.15</b>                     | <b>390,545,825.43</b>                          |
| 1.利息收入                |          | 538,283,957.10                            | 362,983,035.38                                 |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11 | 249,827,198.49                            | 186,959,440.88                                 |
| 债券利息收入                |          | 185,754,793.31                            | 138,621,349.37                                 |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资产收入            |          | 102,701,965.30                            | 37,402,245.13                                  |
| 其他利息收入                |          | -                                         | -                                              |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 28,696,361.38                             | 27,562,790.05                                  |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12 | -                                         | 0.00                                           |
| 基金投资收益                |          | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13 | 28,696,361.38                             | 27,562,790.05                                  |
| 资产支持证券投资收益            |          | -                                         | -                                              |
| 衍生工具收益                |          | -                                         | -                                              |
| 股利收益                  | 7.4.7.14 | -                                         | -                                              |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.15 | -                                         | -                                              |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -                                         | -                                              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.16 | 6,916.67                                  | -                                              |
| <b>减：二、费用</b>         |          | <b>80,969,042.09</b>                      | <b>48,688,490.09</b>                           |
| 1. 管理人报酬              | 7.4.7.17 | 49,053,565.95                             | 25,128,409.79                                  |
| 2. 托管费                | 7.4.7.17 | 14,864,717.00                             | 7,614,669.55                                   |
| 3. 销售服务费              |          | 5,573,822.72                              | 6,123,384.95                                   |
| 4. 交易费用               | 7.4.7.18 | 100.00                                    | -                                              |
| 5. 利息支出               |          | 10,955,299.58                             | 9,351,421.49                                   |

|                     |          |                       |                       |
|---------------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | 10,955,299.58         | 9,351,421.49          |
| 6. 其他费用             | 7.4.7.19 | 521,536.84            | 470,604.31            |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | <b>486,018,193.06</b> | <b>341,857,335.34</b> |
| 减：所得税费用             |          | -                     | -                     |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | <b>486,018,193.06</b> | <b>341,857,335.34</b> |

### 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 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）                        | 20,195,836,976.40                           | -               | 20,195,836,976.40  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                           | 486,018,193.06  | 486,018,193.06     |
| 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）      | 19,475,289,626.90                           | -               | 19,475,289,626.90  |
| 其中：1.基金申购款                             | 117,652,350,671.13                          | -               | 117,652,350,671.13 |
| 2.基金赎回款                                | -98,177,061,044.23                          | -               | -98,177,061,044.23 |
| 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） | -                                           | -486,018,193.06 | -486,018,193.06    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 39,671,126,603.30                           | 0.00            | 39,671,126,603.30  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 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）                        | 7,062,008,758.29   | -               | 7,062,008,758.29   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                  | 341,857,335.34  | 341,857,335.34     |
| 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）      | 13,133,828,218.11  | -               | 13,133,828,218.11  |
| 其中：1.基金申购款                             | 69,973,494,065.44  | -               | 69,973,494,065.44  |
| 2.基金赎回款                                | -56,839,665,847.33 | -               | -56,839,665,847.33 |
| 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） | -                  | -341,857,335.34 | -341,857,335.34    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 20,195,836,976.40  | -               | 20,195,836,976.40  |

报表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 2016 年 3 月 23 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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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 2015 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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。

本基金目前以交易目的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其他各类应收款项等。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其他各类应付款项等。

### 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，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的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，以避免债券投资的账面价值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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 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账面价值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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 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 类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。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值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收益科目，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，不需要披露分部信息。

#### 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[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。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(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支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

#### 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<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 305,694,100.19          | 61,605,287.05            |
| 定期存款           | 13,530,000,000.00       | 7,260,000,000.00         |
| 存款期限 1 个月以内    | 1,350,000,000.00        | 5,340,000,000.00         |
| 存款期限 1-3 个月(含) | 9,100,000,000.00        | 300,000,000.00           |
| 存款期限 3 个月以上    | 3,080,000,000.00        | 1,620,000,000.00         |
| 其他存款           | -                       | -                        |
| 合计             | 13,835,694,100.19       | 7,321,605,287.05         |

注：1. 定期存款的存款期限为定期存款的票面存期。

2. 本基金本期发生定期存款提前支取的情况，适用利率不变。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 |       | 本期末<br>2015 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 | 9,729,378,219.29         | 9,742,801,100.00 | 13,422,880.71 | 0.0338  |
|    | 合计    | 9,729,378,219.29         | 9,742,801,100.00 | 13,422,880.71 | 0.0338  |
| 项目 |       | 上年度末<br>2014 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 | 4,803,424,504.45         | 4,800,638,000.00 | -2,786,504.45 | -0.0138 |
|    | 合计    | 4,803,424,504.45         | 4,800,638,000.00 | -2,786,504.45 | -0.0138 |

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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日  |           |
|-------|--------------------------|-----------|
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返市场 | 15,631,331,046.97        | -         |
| 合计    | 15,631,331,046.97        | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返市场 | 7,459,887,589.82         | -         |
| 合计    | 7,459,887,589.82         | -         |

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 23,281.02               | 18,919.18                |
| 应收定期存款利息   | 17,655,531.16           | 54,678,901.25            |
| 应收其他存款利息   | -                       | -                        |
| 应收结算备付金利息  | 942.81                  | 495.00                   |
| 应收债券利息     | 68,704,966.78           | 66,188,515.50            |
| 应收买入返售证券利息 | 12,752,933.06           | 5,646,794.28             |
| 应收申购款利息    | -                       | 14,165.02                |
| 其他         | -                       | -                        |
| 合计         | 99,137,654.83           | 126,547,790.23           |

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|-------|-------------------------|--------------------------|
| 其他应收款 | -                       | 40,800.00                |
| 待摊费用  | -                       | -                        |
| 合计    | -                       | 40,800.00                |

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 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 | 204,700.77              | 118,566.47               |
| 合计          | 204,700.77              | 118,566.47               |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | -                       | -                        |
| 其他应付款       | -                       | -                        |
| 预提费用        | 390,000.00              | 473,100.00               |
| 银行手续费       | -                       | -                        |
| 合计          | 390,000.00              | 473,100.00               |

#### 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<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |
|----|-----------------------------|
|----|-----------------------------|

|               | 基金份额（份）            | 账面金额               |
|---------------|--------------------|--------------------|
| 上年度末          | 4,782,057,280.71   | 4,782,057,280.71   |
| 本期申购          | 11,649,172,816.06  | 11,649,172,816.06  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -13,840,158,022.55 | -13,840,158,022.55 |
| 本期末           | 2,591,072,074.22   | 2,591,072,074.22   |

华安现金富利货币 B

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |                    |
|---------------|-----------------------------|--------------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额               |
| 上年度末          | 15,413,779,695.69           | 15,413,779,695.69  |
| 本期申购          | 106,003,177,855.07          | 106,003,177,855.07 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -84,336,903,021.68          | -84,336,903,021.68 |
| 本期末           | 37,080,054,529.08           | 37,080,054,529.08  |

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           | 59,699,920.87  | -     | 59,699,920.87  |
| 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        | -59,699,920.87 | -     | -59,699,920.87 |
| 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           | 426,318,272.19  | -     | 426,318,272.19  |
| 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        | -426,318,272.19 | -     | -426,318,272.19 |
| 本期末            | -               | -     | -               |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月<br>31 日 |
|-----------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 660,710.19                                | 415,913.18                                     |
| 定期存款利息收入  | 248,845,838.73                            | 186,191,619.89                                 |
| 其他存款利息收入  | -                                         | -                                              |
| 结算备付金利息收入 | 120,642.96                                | 112,429.39                                     |
| 其他        | 200,006.61                                | 239,478.42                                     |
| 合计        | 249,827,198.49                            | 186,959,440.88                                 |

#### 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<br>2015年1月1日至2015年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12月<br>31日 |
|----------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 17,072,611,536.56               | 12,526,076,250.39                    |

|                        |                   |                   |
|------------------------|-------------------|-------------------|
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 16,766,297,714.85 | 12,355,145,902.18 |
| 减：应收利息总额               | 277,617,460.33    | 143,367,558.16    |
| 买卖债券差价收入               | 28,696,361.38     | 27,562,790.05     |

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.16 股利收益

无。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

无。

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2015年1月1日至2015年12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                           | -                                |
| 其他收入    | 6,916.67                    | -                                |
| 合计      | 6,916.67                    | -                                |

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015年1月1日至2015年12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | -                           | -                                |
| 银行间市场交易费用 | 100.00                      | -                                |
| 合计        | 100.00                      | -                                |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期<br>2015年1月1日至2015年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12月31日 |
|--------|---------------------------------|----------------------------------|
| 审计费用   | 141,000.00                      | 119,600.00                       |
| 信息披露费  | 240,000.00                      | 240,000.00                       |
| 银行汇划费用 | 103,663.89                      | 73,889.51                        |
| 账户维护费  | 36,672.95                       | 36,350.00                        |
| 其他     | 200.00                          | 764.80                           |
| 合计     | 521,536.84                      | 470,604.31                       |

#### 7.4.7.21 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，不需要披露分部信息。

#### 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

宣告日                      分配收益所属期间

2016 年度

— 第 1 号收益支付公告 2016/01/12                      2015/12/14-2016/01/11

— 第 2 号收益支付公告 2016/02/16                      2016/01/12-2016/02/15

— 第 3 号收益支付公告 2016/03/14                      2016/02/16-2015/03/13

#### 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(“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            |

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。

##### 7.4.10.2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<br>2015年1月1日至2015年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12月31<br>日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 49,053,565.95                   | 25,128,409.79                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,069,984.90                    | 2,558,881.91                         |

注：支付基金管理人华安基金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<br>2015年1月1日至2015年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12月31<br>日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 14,864,717.00                   | 7,614,669.55                         |

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 × 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<br>2015年1月1日至2015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         | 898,309.63                       | 1,195,956.35 | 2,094,265.98 |
| 中国工商银行         | 1,412,335.34                     | 7,940.30     | 1,420,275.64 |
| 合计             | 2,310,644.97                     | 1,203,896.65 | 3,514,541.62 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2014年1月1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         | 1,057,930.44                     | 479,548.51   | 1,537,478.95 |
| 中国工商银行         | 1,731,763.02                     | 6,811.37     | 1,738,574.39 |
| 合计             | 2,789,693.46                     | 486,359.88   | 3,276,053.34 |

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                     |                |                    |       |      |                      |                |
|------------------------|----------------|--------------------|-------|------|----------------------|----------------|
| 2015年1月1日至2015年12月31日  |                |                    |       |      |                      |                |
| 银行间市场<br>交易的各关<br>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                 | -              | 324,629,74<br>7.48 | -     | -    | 5,303,700,000.<br>00 | 327,988.3<br>3 |
| 上年度可比期间                |                |                    |       |      |                      |                |
| 2014年1月1日至2014年12月31日  |                |                    |       |      |                      |                |
| 银行间市场<br>交易的各关<br>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                 | 301,530,428.63 | 484,956,68<br>3.56 | -     | -    | -                    | -              |

#### 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

份额单位：份

| 项目           | 本期                    |                | 上年度可比期间               |                |
|--------------|-----------------------|----------------|-----------------------|----------------|
|              | 2015年1月1日至2015年12月31日 |                | 2014年1月1日至2014年12月31日 |                |
|              | 华安现金富利货币<br>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      |
| 期初持有的基金份额    | -                     | 220,508,257.42 | -                     | -              |
| 期间申购/买入总份额   | 50,000,000.00         | 50,000,000.00  | 272,000,000.00        | 328,508,257.42 |
| 期间因拆分变动份额    | -                     | -              | -                     | -              |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | 50,000,000.00         | 270,508,257.42 | 272,000,000.00        | 108,000,000.00 |

|                   |   |   |   |                |
|-------------------|---|---|---|----------------|
| 期末持有的基金份额         | - | - | - | 220,508,257.42 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | - | - | 1.09%          |

注：基金管理人华安基金公司在本年度申购本基金 A 级和 B 级基金份额的交易委托申银万国证券股份有限公司办理，无申购费。

#### 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<br>2015年12月31日 |                          | 华安现金富利货币A上年度末<br>2014年12月31日 |                      |
|--------------------|-----------------------------|--------------------------|------------------------------|----------------------|
|                    | 持有的<br>基金份额                 | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额                  | 持有的基金份额占<br>基金总份额的比例 |
| 上海光通信公司            | -                           | -                        | -                            | -                    |
| 上海电气集团财务<br>有限责任公司 | -                           | -                        | -                            | -                    |

注：无。

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<br>2015年12月31日 |                          | 华安现金富利货币B上年度末<br>2014年12月31日 |                          |
|-----------------------|-----------------------------|--------------------------|------------------------------|--------------------------|
|                       | 持有的<br>基金份额                 | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额                  | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 上海光通信公司               | 10,104,657.16               | 0.03%                    | 19,381,850.14                | 0.13%                    |
| 上海电气集团财务<br>有限责任公司    | 13,444,360.33               | 0.03%                    | 107,705,078.21               | 0.70%                    |
| 上海国际信托有限<br>公司        | 200,000,000.00              | 0.50%                    | -                            | -                        |
| 华安未来资产管理<br>(上海) 有限公司 | 30,000,000.00               | 0.08%                    | -                            | -                        |

#### 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<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014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 | 305,694,100.19              | 660,710.19 | 61,605,287.05                    | 415,913.18 |

注：1.本基金的活期银行存款由基金托管人 中国工商银行 保管，按银行同业利率或约定利率计息。

2.本期利息收入含存放于基金托管人中国工商银行的定期存款利息收入。

3.本基金本期末未持有存放于基金托管人中国工商银行的定期存款。

#### 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<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动  | 本期利润分<br>配合计  | 备注 |
|------------------|-------------------|---------------|---------------|----|
| 58,264,289.19    | 10,254,908.05     | -8,819,276.37 | 59,699,920.87 | A级 |

##### 2、华安现金富利货币 B

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动  | 本期利润分<br>配合计   | 备注 |
|------------------|-------------------|---------------|----------------|----|
| 345,338,061.73   | 54,440,829.12     | 26,539,381.34 | 426,318,272.19 | B级 |

注：本基金在本年度累计分配收益 486,018,193.06 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金

403,602,350.92 (附注 7.4.7.9)，计入应付收益科目 17,720,104.97 元。

#### **7.4.12 期末（2015 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**

截至报告期末 2015 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**

截至报告期末 2015 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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行 中国工商银行，其他定期存款存放在具有托管资格的中信银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、深圳发展银行股份有限公司、浦东发展银行股份有限公司、天津银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、民生银行股份有限公司及恒丰银行股份有限公司，因而与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，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，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<br>2015年12月31日 | 上年末<br>2014年12月31日 |
|--------|--------------------|--------------------|
| A-1    | 2,359,884,350.48   | 2,619,664,422.63   |
| A-1 以下 | -                  | -                  |
| 未评级    | 7,133,976,788.56   | 1,878,698,205.61   |

|    |                  |                  |
|----|------------------|------------------|
| 合计 | 9,493,861,139.04 | 4,498,362,628.24 |
|----|------------------|------------------|

注：未评级债券为政策性金融债和短期融资券。

#### 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<br>2015年12月31日 | 上年末<br>2014年12月31日 |
|--------|--------------------|--------------------|
| AAA    | 10,107,661.00      | 89,979,669.56      |
| AAA 以下 | -                  | -                  |
| 未评级    | 225,409,419.25     | 215,082,206.65     |
| 合计     | 235,517,080.25     | 305,061,876.21     |

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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。此外本基金还可以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发行的证券不得超过该证券的 10%。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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<br>2015 年 12 月<br>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                       | 13,835,694,100.19 | -                | -     | -                 | 13,835,694,100.19 |
| 结算备付金                      | 1,904,761.90      | -                | -     | -                 | 1,904,761.90      |
| 交易性金融资产                    | 8,659,534,718.09  | 1,069,843,501.20 | -     | -                 | 9,729,378,219.29  |
| 买入返售金融资产                   | -                 | -                | -     | 15,631,331,046.97 | 15,631,331,046.97 |
| 应收利息                       | -                 | -                | -     | 99,137,654.83     | 99,137,654.83     |
| 应收申购款                      | -                 | -                | -     | 456,995,260.85    | 456,995,260.85    |
| 其他资产                       | -                 | -                | -     | -                 | -                 |
| 资产总计                       | 22,497,133,580.18 | 1,069,843,501.20 | -     | 16,187,463,962.65 | 39,754,441,044.03 |

|                                      |                   |                  |              |                   |                   |
|--------------------------------------|-------------------|------------------|--------------|-------------------|-------------------|
|                                      |                   |                  |              |                   | 044.03            |
| 负债                                   |                   |                  |              |                   |                   |
| 应付赎回款                                | -                 | -                | -            | 38,094,604.60     | 38,094,604.60     |
| 应付管理人报酬                              | -                 | -                | -            | 5,549,896.22      | 5,549,896.22      |
| 应付托管费                                | -                 | -                | -            | 1,681,786.71      | 1,681,786.71      |
| 应付销售服务费                              | -                 | -                | -            | 447,718.73        | 447,718.73        |
| 应付交易费用                               | -                 | -                | -            | 204,700.77        | 204,700.77        |
| 应付利润                                 | -                 | -                | -            | 36,945,733.70     | 36,945,733.70     |
| 其他负债                                 | -                 | -                | -            | 390,000.00        | 390,000.00        |
| 负债总计                                 | -                 | -                | -            | 83,314,440.73     | 83,314,440.73     |
| 利率敏感度缺口                              | 22,497,133,580.18 | 1,069,843,501.20 | -            | 16,104,149,521.92 | 39,671,126,603.30 |
| <b>上年度末<br/>2014 年 12 月<br/>31 日</b> | <b>6 个月以内</b>     | <b>6 个月-1 年</b>  | <b>1-5 年</b> | <b>不计息</b>        | <b>合计</b>         |
| 资产                                   |                   |                  |              |                   |                   |
| 银行存款                                 | 7,321,605,287.05  | -                | -            | -                 | 7,321,605,287.05  |
| 结算备付金                                | 1,000,000.00      | -                | -            | -                 | 1,000,000.00      |
| 交易性金融资产                              | 2,964,355,668.38  | 1,839,068,836.07 | -            | -                 | 4,803,424,504.45  |
| 买入返售金融资产                             | 7,459,887,589.82  | -                | -            | -                 | 7,459,887,589.82  |
| 应收利息                                 | -                 | -                | -            | 126,547,790.23    | 126,547,790.23    |
| 应收申购款                                | 9,515,100.11      | -                | -            | 538,349,685.94    | 547,864,786.05    |
| 其他资产                                 | 40,800.00         | -                | -            | -                 | 40,800.00         |
| 资产总计                                 | 17,756,404,445.36 | 1,839,068,836.07 | -            | 664,897,476.17    | 20,260,370,757.60 |
| 负债                                   |                   |                  |              |                   |                   |
| 应付赎回款                                | -                 | -                | -            | 41,073,365.90     | 41,073,365.90     |
| 应付管理人报酬                              | -                 | -                | -            | 2,379,070.11      | 2,379,070.11      |
| 应付托管费                                | -                 | -                | -            | 720,930.32        | 720,930.32        |

|         |                   |                  |   |                |                   |
|---------|-------------------|------------------|---|----------------|-------------------|
| 应付销售服务费 | -                 | -                | - | 543,119.67     | 543,119.67        |
| 应付交易费用  | -                 | -                | - | 118,566.47     | 118,566.47        |
| 应付利润    | -                 | -                | - | 19,225,628.73  | 19,225,628.73     |
| 其他负债    | -                 | -                | - | 473,100.00     | 473,100.00        |
| 负债总计    | -                 | -                | - | 64,533,781.20  | 64,533,781.20     |
| 利率敏感度缺口 | 17,756,404,445.36 | 1,839,068,836.07 | - | 600,363,694.97 | 20,195,836,976.40 |

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

#### 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<br>2015 年 12 月 31 日      | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | 减少约 799                      | 减少约 576                  |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 增加约 798                      | 增加约 578                  |

#### 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 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属于第二层次的余额为 9,729,378,219.29 元，无属于第一或第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第二层次 4,803,424,504.45 元，无属于第一或第三层次的余额)。

(ii) 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次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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。

(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            | 9,729,378,219.29  | 24.47         |
|    | 其中：债券             | 9,729,378,219.29  | 24.47         |
|    | 资产支持证券            | -                 | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 15,631,331,046.97 | 39.32         |
|    | 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      | 13,837,598,862.09 | 34.81         |
| 4  | 其他各项资产            | 556,132,915.68    | 1.40          |
| 5  | 合计                | 39,754,441,044.03 | 100.00        |

### 8.2 债券回购融资情况

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值比例 (%) |                |
|----|--------------|---------------|----------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 2.12          |                |
|    | 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

| 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  | 2015-01-06 | 22.77              | 因大额赎回造成 | 3 个交易日 |

### 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    | 63  |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 139 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 33  |

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 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                 | 44.08              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 4.13               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 32.09              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.03               | -                  |
| 4  | 90 天（含）—180 天          | 15.80              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 5  | 180 天（含）—397 天（含）      | 2.70               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 合计 |                        | 98.80              | -                  |

#### 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                 | -                | -            |
| 3  | 金融债券                 | 1,827,021,893.21 | 4.61         |
|    | 其中：政策性金融债            | 1,827,021,893.21 | 4.61         |
| 4  | 企业债券                 | 10,107,661.00    | 0.03         |
| 5  | 企业短期融资券              | 3,599,625,722.06 | 9.07         |
| 6  | 中期票据                 | -                | -            |
| 7  | 同业存单                 | 4,292,622,943.02 | 10.82        |
| 8  | 其他                   | -                | -            |
| 9  | 合计                   | 9,729,378,219.29 | 24.53        |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 10,107,661.00    | 0.03         |

#### 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  | 150311    | 15 进出 11      | 6,000,000 | 599,918,958.74 | 1.51         |
| 2  | 111507145 | 15 招行 CD145   | 6,000,000 | 595,680,332.52 | 1.50         |
| 3  | 111518071 | 15 华夏 CD071   | 6,000,000 | 595,680,332.52 | 1.50         |
| 4  | 111511321 | 15 平安 CD321   | 6,000,000 | 595,680,332.52 | 1.50         |
| 5  | 150211    | 15 国开 11      | 5,000,000 | 500,834,051.53 | 1.26         |
| 6  | 111507142 | 15 招行 CD142   | 4,000,000 | 397,328,044.79 | 1.00         |
| 7  | 150411    | 15 农发 11      | 3,000,000 | 300,684,309.76 | 0.76         |
| 8  | 111507135 | 15 招行 CD135   | 3,000,000 | 298,099,561.10 | 0.75         |
| 9  | 111519107 | 15 恒丰银行 CD107 | 3,000,000 | 297,960,258.31 | 0.75         |
| 10 | 111593345 | 15 盛京银行 CD103 | 3,000,000 | 297,772,155.84 | 0.75         |

## 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 | 6     |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.27% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.00% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.12% |

## 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

### 8.8.1 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。

**8.8.2 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。**

**8.8.3 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。**

### 8.8.4 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    | 99,137,654.83  |
| 4  | 应收申购款   | 456,995,260.85 |
| 5  | 其他应收款   | -              |
| 6  | 待摊费用    | -              |

|   |    |                |
|---|----|----------------|
| 7 | 其他 | -              |
| 8 | 合计 | 556,132,915.68 |

## §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 | 100,718  | 25,726.01      | 108,406,692.77    | 4.18%  | 2,482,665,381.45 | 95.82% |
| 华安现金富利货币 B | 288      | 128,750,189.34 | 35,554,654,203.50 | 95.89% | 1,525,400,325.58 | 4.11%  |
| 合计         | 101,006  | 392,760.10     | 35,663,060,896.27 | 89.90% | 4,008,065,707.03 | 10.10% |

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基金的情况

| 项目               | 份额级别       | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 华安现金富利货币 A | 2,420,651.13 | 0.09%    |
|                  | 华安现金富利货币 B | -            | -        |
|                  | 合计         | 2,420,651.13 | 0.01%    |

注：1、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）。

2、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。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 份额级别       | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 华安现金富利货币 A | -                 |
|                                | 华安现金富利货币 B | -                 |
|                                | 合计         | -                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 华安现金富利货币 A | 0                 |
|                                | 华安现金富利货币 B | 0                 |
|                                | 合计         | 0                 |

## §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         |
|---------------|-------------------|--------------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 4,782,057,280.71  | 15,413,779,695.69  |
| 本报告期基金总申购份额   | 11,649,172,816.06 | 106,003,177,855.07 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 13,840,158,022.55 | 84,336,903,021.68  |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                 | -                  |
| 本报告期期末基金份额总额  | 2,591,072,074.22  | 37,080,054,529.08  |

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）2015 年 3 月 7 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，尚志民先生不再担任本基金管理人的副总经理。

（2）2015 年 6 月 30 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，秦军先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(3) 2015 年 7 月 11 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司高级管理人员变更公告，童威先生新任本基金管理人的总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 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 141,000.00 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<br>单元<br>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 |    |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中银国际证券股份有限公司 | 2              | -    | -            | -         | -          | -  |

#### 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 | 成交金额 | 占当期回 | 成交金额 | 占当期权证 |

|                  |   | 券成交总<br>额的比例 |                       | 购成交总<br>额的比例 |   | 成交总额的<br>比例 |
|------------------|---|--------------|-----------------------|--------------|---|-------------|
| 国泰君安证券<br>股份有限公司 | - | -            | 18,926,00<br>0,000.00 | 100.00%      | - | -           |
| 中银国际证券<br>股份有限公司 | - | -            | -                     | -            | - | -           |

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旗下部分基金参加中国工商银行基金定期定额投资优惠活动的公告            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-01-05 |
| 2  | 华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金暂停大额申购大额转换转入及大额定期定额投资的公告       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-01-12 |
| 3  | 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公告                         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-01-13 |
| 4  | 华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金“春节”假期前暂停大额申购及大额转换转入及大额定期定额的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-02-10 |
| 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公告                         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-02-12 |
| 6  | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京增财基金销售为代销机构并参加费率优惠活动的公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-03-06 |
| 7  | 华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告                                | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-03-07 |
| 8  | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告              | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-03-12 |
| 9  | 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公告                         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-03-12 |
| 10 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金调整单笔最低申购金额、最低赎回份额和最低保留余额限制的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-03-13 |
| 11 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加太平洋证券为代销机构的公告                    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-03-18 |
| 12 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告                   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-03-31 |
| 13 | 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公告                         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-04-14 |
| 14 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平                                  | 《上海证券报》、《证券时                | 2015-04-08 |

|    |                                               |                             |            |
|----|-----------------------------------------------|-----------------------------|------------|
|    | 台暂停部分基金通过支付宝渠道申购、定期定额投资业务的公告                  | 报》、《中国证券报》和公司网站             |            |
| 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公告                  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-05-12 |
| 16 | 关于华安旗下部分基金增加天天基金为销售机构的公告                      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-05-28 |
| 17 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-05-29 |
| 18 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中国农业银行费率优惠活动的公告             | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-05-29 |
| 19 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台开展机构客户认购、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》和公司网站 | 2015-06-02 |
| 20 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加汇付天下为销售机构的公告              | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-06-02 |
| 21 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金在官方京东店开展认购费率优惠活动的公告         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-06-10 |
| 22 | 华安基金管理有限公司关于在京东电商平台开通华安基金官方旗舰店基金网上直销业务的公告     | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-06-10 |
| 23 | 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公告                  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-06-12 |
| 24 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-06-12 |
| 25 | 华安基金管理有限公司关于华安现金富利投资基金恢复大额申购、大额转换转入及定期定额投资的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-06-23 |
| 26 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告               | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-06-26 |
| 27 | 华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-06-29 |
| 28 | 华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告                         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-06-30 |

|    |                                                 |                             |            |
|----|-------------------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 29 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泉州银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-07-01 |
| 30 | 华安基金管理有限公司关于公司及高管投资旗下基金相关事宜的公告                  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-07-07 |
| 31 | 华安现金富利投资基金基金暂停大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资的公告           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-07-08 |
| 32 | 华安基金管理有限公司高级管理人员变更公告                            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-07-11 |
| 33 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加同花顺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》和公司网站 | 2015-07-14 |
| 34 | 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公告                    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-07-14 |
| 35 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加一路财富为销售机构并参加费率优惠的公告         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-07-16 |
| 36 | 关于华安现金富利投资基金调整单笔最低申购金额、最低赎回份额和最低保留余额限制的公告       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-07-22 |
| 37 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加恒天明泽为销售机构并参加费率优惠的公告         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-07-24 |
| 38 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海银基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-07-24 |
| 39 | 华安基金关于参加数米基金网费率优惠活动的公告                          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-08-05 |
| 40 | 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公告                    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-08-12 |
| 41 | 华安基金管理有限公司关于中信浙江并入中信证券期间基金业务安排的提示性公告            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-08-12 |
| 42 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中金公司优惠活动的公告                   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-08-19 |
| 43 | 华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台延长“赎回转认购”交易费率优惠活动时间         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-08-20 |

|    | 的公告                                      | 司网站                         |            |
|----|------------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 44 | 华安基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告               | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-08-22 |
| 45 | 关于华安旗下基金调整单笔最低申购金额的公告                    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-08-27 |
| 46 | 华安现金富利投资基金暂停大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-08-27 |
| 47 | 华安基金管理有限公司关于参加国都证券费率优惠的公告                | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-08-28 |
| 48 | 华安基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告（数米）       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-08-28 |
| 49 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长机构客户认购、申购费率优惠时间的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-09-02 |
| 50 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-09-11 |
| 51 | 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公告             | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-09-14 |
| 52 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加平安证券费率优惠活动的公告          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-09-22 |
| 53 | 华安现金富利投资基金暂停大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-09-23 |
| 54 | 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公告             | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-10-13 |
| 55 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加陆金所为销售机构的公告          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-10-19 |
| 56 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加富济财富为销售机构并参加费率优惠的公告  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-10-26 |
| 57 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加乐融多源为销售机构并参加费率优惠的公告  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-10-26 |
| 58 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增                      | 《上海证券报》、《证券时                | 2015-10-26 |

|    |                                                        |                             |            |
|----|--------------------------------------------------------|-----------------------------|------------|
|    | 加上海联泰资产管理有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告                         | 报》、《中国证券报》和公司网站             |            |
| 59 | 华安基金管理有限公司关于参加长量基金费率优惠的公告                              | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-10-30 |
| 60 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加大泰金石投资管理有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-11-04 |
| 61 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加诺亚正行优惠活动的公告                          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-11-07 |
| 62 | 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公告                           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-11-12 |
| 63 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加盈米为销售机构并参加费率优惠活动的公告                | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-11-13 |
| 64 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宏信证券为销售机构的公告                       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-11-23 |
| 65 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加利得为销售机构并参加费率优惠活动的公告                | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-11-25 |
| 66 | 华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台延长“赎回转认购”交易费率优惠活动时间公告              | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-11-27 |
| 67 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加君德为销售机构并参加费率优惠活动的公告                | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-12-02 |
| 68 | 华安基金管理有限公司关于参加京东费率优惠活动的公告                              | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-12-03 |
| 69 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金调整单笔最低赎回份额、单笔最低转换转出份额和最低保留余额限制的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-12-10 |
| 70 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告                | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-12-10 |
| 71 | 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公告                           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-12-14 |
| 72 | 华安现金富利投资基金暂停大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资的公告                    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-12-25 |

|    |                                                        |                             |            |
|----|--------------------------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 73 | 华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告                | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-12-25 |
| 74 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中国农业银行费率优惠活动的公告                      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-12-31 |
| 75 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东亚银行（中国）有限公司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》和公司网站 | 2015-12-31 |
| 76 | 华安基金管理有限公司 29 关于旗下部分基金开通并参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-12-31 |
| 77 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金因指数熔断交易规则实施调整开放时间的公告                   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-12-31 |

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](http://www.huaan.com.cn) 上披露。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华安现金富利投资基金基金合同》；
- 2、《华安现金富利投资基金招募说明书》；
- 3、《华安现金富利投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准华安现金富利投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则。

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇一六年三月二十八日