

# 华安现金富利投资基金 2011 年半年度报告摘要

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年八月二十九日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半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 2011 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                     |                   |                  |
|---------------------|-------------------|------------------|
| 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          | 6,012,740,284.55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<br>份额总额 | 2,054,071,417.45份 | 3,958,668,867.1份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | <p>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。</p>  |
| 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：<br/>                     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        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 冯颖                    | 赵会军                 |
|         | 联系电话 | 021-38969999          | 010-66105799        |
|         | 电子邮箱 | fengying@huaan.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 4008850099            | 95588               |
| 传真      |      | 021-68863414          | 010-66105798        |

## 2.4 信息披露方式

|                          |                           |
|--------------------------|---------------------------|
| 登载基金半年度报告正文的<br>管理人互联网网址 | http://www.huaan.com.cn   |
| 基金半年度报告备置地点              | 上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期 (2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日) |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 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       | 37,451,973.88                         | 100,283,070.13   |
| 本期利润          | 37,451,973.88                         | 100,283,070.13   |
| 本期净值收益率       | 1.6274%                               | 1.7479%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 (2011 年 6 月 30 日)                |                  |
|               | 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      | 2,054,071,417.45                      | 3,958,668,867.10 |
| 期末基金份额净值      | 1.000                                 | 1.000            |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末 (2011 年 6 月 30 日)                |                  |
|               | 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       | 20.2558%                              | 3.9388%          |

注：1、本基金收益分配按月结转份额。

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1. 华安现金富利货币 A:

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

|          |          | ②       | 率③      | 率标准差    |          |         |
|----------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
|          |          |         |         | ④       |          |         |
| 过去一个月    | 0.2830%  | 0.0008% | 0.0411% | 0.0000% | 0.2419%  | 0.0008% |
| 过去三个月    | 0.8226%  | 0.0019% | 0.1233% | 0.0001% | 0.6993%  | 0.0018% |
| 过去六个月    | 1.6274%  | 0.0020% | 0.2176% | 0.0002% | 1.4098%  | 0.0018% |
| 过去一年     | 2.7235%  | 0.0026% | 0.3991% | 0.0002% | 2.3244%  | 0.0024% |
| 过去三年     | 7.0030%  | 0.0048% | 1.2661% | 0.0003% | 5.7369%  | 0.0045% |
| 自基金成立起至今 | 20.2558% | 0.0049% | 4.5487% | 0.0005% | 15.7071% | 0.0044% |

## 2. 华安现金富利货币 B:

| 阶段       | 份额净值<br>收益率① | 净值收益<br>率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①—③     | ②—④     |
|----------|--------------|-------------------|--------------------|---------------------------|---------|---------|
| 过去一个月    | 0.3029%      | 0.0008%           | 0.0411%            | 0.0000%                   | 0.2618% | 0.0008% |
| 过去三个月    | 0.8828%      | 0.0019%           | 0.1233%            | 0.0001%                   | 0.7595% | 0.0018% |
| 过去六个月    | 1.7479%      | 0.0020%           | 0.2176%            | 0.0002%                   | 1.5303% | 0.0018% |
| 过去一年     | 2.9698%      | 0.0026%           | 0.3991%            | 0.0002%                   | 2.5707% | 0.0024% |
| 自基金成立起至今 | 3.9388%      | 0.0029%           | 0.5865%            | 0.0001%                   | 3.3523% | 0.0028% |

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

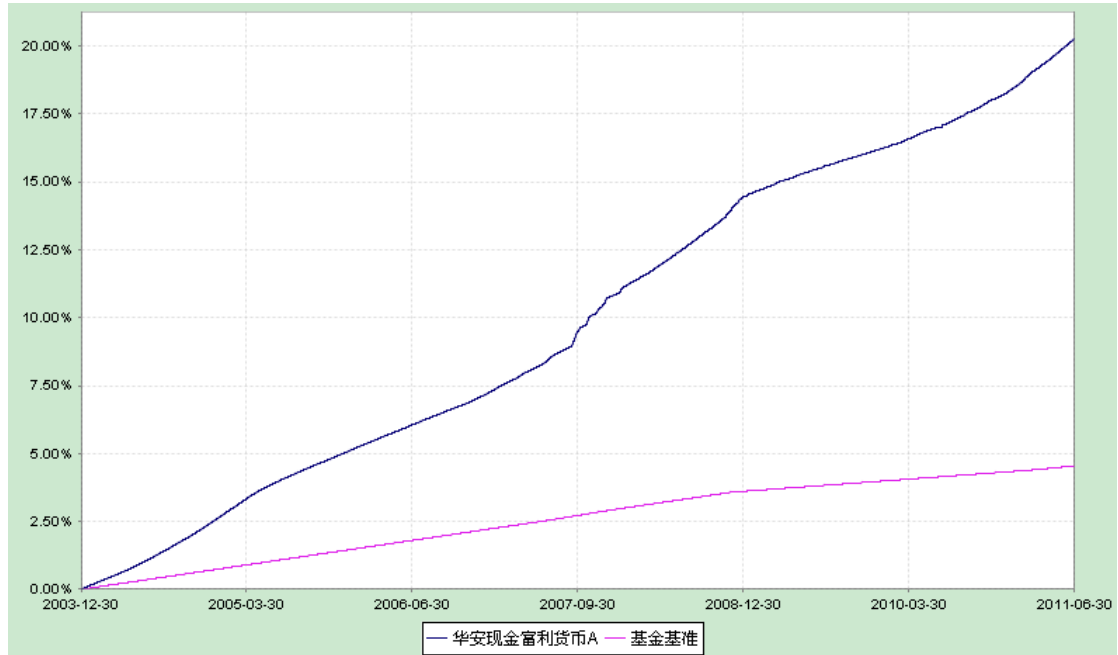
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 华安现金富利投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

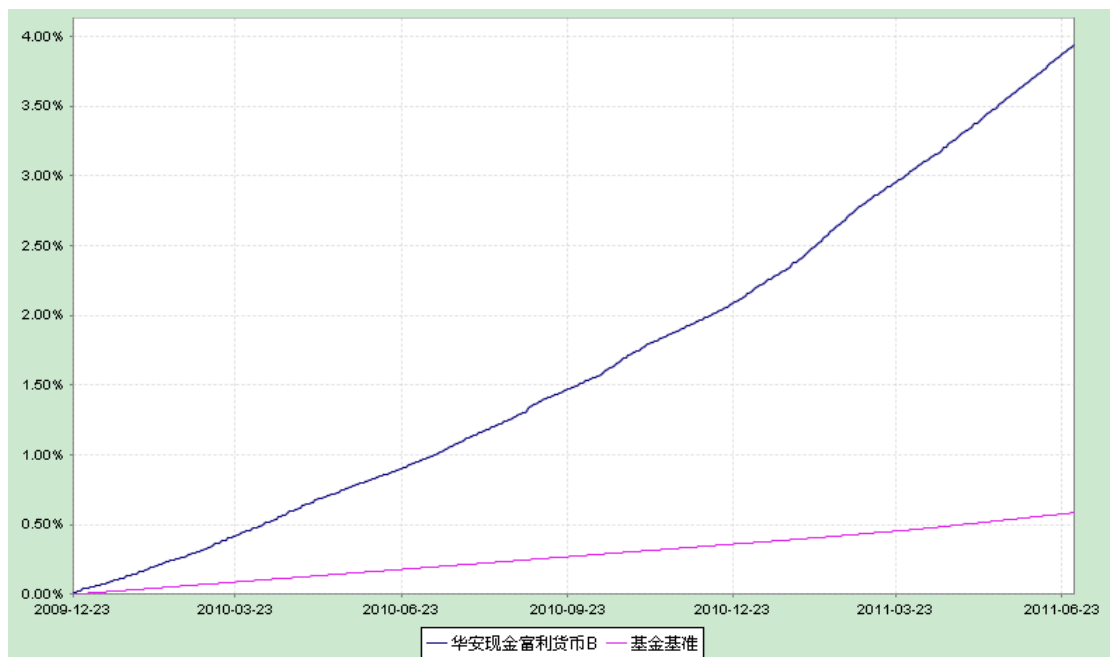
##### 1、华安现金富利货币 A

(2003 年 12 月 30 日至 2011 年 6 月 30 日)



## 2、华安现金富利货币 B

(2009 年 12 月 23 日至 2011 年 6 月 30 日)



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

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2011 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭 2 只封闭式证券投资基金，华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安上证 180ETF、上证 180ETF 联接基金、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证龙头 ETF、上证龙头 ETF 联接基金、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安国际配置、华安香港精选股票、华安大中华升级股票等 22 只开放式基金，管理资产规模达到 755.14 亿人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务                | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|-------------------|-----------------|------|--------|---|
|    |                   | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 黄勤 | 本基金的基金经理，固定收益部总经理 | 2007-05-16      | -    | 9 年    | 经济学硕士，持有基金从业人员资格证书，15 年银行、基金从业经历。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理公司，曾任固定收益部债券投资经理，2007 年 5 月起担任本基金的基金经理，2009 年 4 |



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

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安现金富利投资基金基金合同》、《华安现金富利证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，除因 6 月份基金份额大幅下降导致 6 月 30 日本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 外，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

对于场内交易，公司《交易端公平交易管理办法-交易所业务》规定不同基

金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”，不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配，实现公平交易。本报告期内，场内业务的公平交易运作良好，未出现异常情况。

对于场外交易，公司制定《交易端公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金（账户）参与新股询价与申购业务管理办法》等制度对其进行规范，执行情况良好，未出现异常情况。

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

#### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

无。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

美国经济数据表现不乐观，收入增长、支出增长均呈现疲弱、消费和房地产仍在萎缩。欧元区核心和边缘国家 PMI 连续走低，边缘国家进入衰退，拖累整个欧元区经济，市场继续关注希腊等国家主权债务风险的蔓延。

中国经济方面，实体经济增长放缓，货币和信贷增长继续疲弱，通胀数据持续攀升。本季度期内央行连续六次上调了存款准备金率，并两次上调存贷款基准利率，一年央票发行利率较上季末上行 99 个 BP 至 3.4982%，为了收紧市场流动性、对抗通胀，央行连续采取包括加息、提高准备金率等一揽子政策手段，货币市场出现反复波动，货币市场利率中枢不断抬升。

在上述环境下，本基金积极调整组合资产，提高组合流动性，有效缓解资金面紧张给组合带来的流动性冲击，同时也降低了货币市场波动给组合带来的利率风险；适当通过组合结构调整提高组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

华安富利投资基金收益率及规模变化：

##### 1、华安现金富利货币 A

投资回报：1.6274% 比较基准：0.2176%

期初规模：17.22 亿 期末规模：20.54 亿

##### 2、华安现金富利货币 B

投资回报：1.7479% 比较基准：0.2176%

期初规模：72.57 亿 期末规模：39.59 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

美国经济方面，未来几个季度经济增长仍不乐观，需求不足是经济增长走弱的主要原因，而油价走低尚不足以改善消费走弱的情况，鉴于整体经济的疲态和金融市场的风险，因此政府需要保持刺激措施的灵活性。欧元区经济增长将进一步减退；希腊或在今年内出现偿付问题，并将风险蔓延到其他边缘国家。

中国经济方面，紧缩政策对经济增长的拖累作用逐渐显现，通胀在年内将缓步回落。但在全球食品价格向上、国内负利率情况并无消失的背景下，通胀风险仍然存在。中国经济依然面临着通胀在加速、增长在减速的双重压力，未来政策取向尤为关键。我们预期货币政策在年内转身的可能性较低，但政策出台频率会较上半年有所降低。预计三季度资金面较二季度有所改善，货币市场利率中枢将逐步回落。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化

无。

## 2、估值政策重大变化对基金资产净值及本报告期损益的影响

无。

## 3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

### (1) 公司方面

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

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

#### 相关人员专业胜任能力及工作经历：

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

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

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

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

总经理。

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

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本基金的估值。

#### 5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金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 37,451,973.88 元，华安现金富利货币 B 累计收益分配金额 100,283,070.13 元。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011 年上半年，本基金托管人在对华安现金富利投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年上半年，华安现金富利投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安现金富利投资基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安现金富利投资基金 2011 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：华安现金富利投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 本期末<br>2011 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2010 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：            |                        |                          |
| 银行存款            | 713,273,877.91         | 2,735,800,831.26         |
| 结算备付金           | -                      | 8,007,727.27             |
| 存出保证金           | -                      | -                        |
| 交易性金融资产         | 4,939,595,095.22       | 4,049,429,134.36         |
| 其中：股票投资         | -                      | -                        |
| 基金投资            | -                      | -                        |
| 债券投资            | 4,939,595,095.22       | 4,049,429,134.36         |
| 资产支持证券投资        | -                      | -                        |
| 衍生金融资产          | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产        | 1,429,893,504.84       | 2,016,204,814.51         |
| 应收证券清算款         | -                      | -                        |
| 应收利息            | 69,819,952.93          | 44,013,963.84            |
| 应收股利            | -                      | -                        |
| 应收申购款           | 14,097,395.93          | 173,596,473.52           |
| 递延所得税资产         | -                      | -                        |
| 其他资产            | -                      | 10,000.00                |
| 资产总计            | 7,166,679,826.83       | 9,027,062,944.76         |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>             | <b>上年度末</b>              |
|                 | <b>2011 年 6 月 30 日</b> | <b>2010 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          | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款       | 1,129,998,835.00       | -                        |
| 应付证券清算款         | -                      | -                        |
| 应付赎回款           | 4,539,091.63           | 33,064,376.71            |
| 应付管理人报酬         | 2,577,480.39           | 1,737,629.79             |
| 应付托管费           | 781,054.71             | 526,554.52               |
| 应付销售服务费         | 606,673.93             | 405,530.35               |
| 应付交易费用          | 63,802.56              | 37,458.72                |
| 应交税费            | 3,587,183.78           | 3,365,300.78             |
| 应付利息            | 156,986.91             | -                        |
| 应付利润            | 11,433,286.75          | 8,303,078.68             |
| 递延所得税负债         | -                      | -                        |
| 其他负债            | 195,146.62             | 389,100.00               |
| 负债合计            | 1,153,939,542.28       | 47,829,029.55            |
| 所有者权益：          |                        |                          |

|            |                  |                  |
|------------|------------------|------------------|
| 实收基金       | 6,012,740,284.55 | 8,979,233,915.21 |
| 未分配利润      | -                | -                |
| 所有者权益合计    | 6,012,740,284.55 | 8,979,233,915.21 |
| 负债和所有者权益总计 | 7,166,679,826.83 | 9,027,062,944.76 |

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 6,012,740,284.55 份，其中华安现金富利货币 A 类份额总额 2,054,071,417.45 份，华安现金富利货币 B 类份额总额 3,958,668,867.10 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安现金富利投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至<br>2011 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至<br>2010 年 6 月 30 日 |
|------------------------|--|---|
| <b>一、收入</b>            | <b>163,053,826.83</b>                    | <b>84,020,787.65</b>                          |
| 1. 利息收入                | 155,235,274.91                           | 72,672,271.47                                 |
| 其中：存款利息收入              | 49,122,374.98                            | 19,916,720.85                                 |
| 债券利息收入                 | 70,638,819.78                            | 45,772,314.40                                 |
| 资产支持证券利息收入             | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入             | 35,474,080.15                            | 6,983,236.22                                  |
| 其他利息收入                 | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      | 7,818,551.92                             | 11,348,516.18                                 |
| 其中：股票投资收益              | -  | -   |
| 基金投资收益                 | -  | -   |
| 债券投资收益                 | 7,818,551.92                             | 11,348,516.18                                 |
| 资产支持证券投资               | -  | -   |
| 收益                     | -  | -   |
| 衍生工具收益                 | -  | -   |
| 股利收益                   | -  | -   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -  | -   |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -  | -   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | -  | -   |
| <b>减：二、费用</b>          | <b>25,318,782.82</b>                     | <b>20,873,758.13</b>                          |



|                            |                       |                      |
|----------------------------|-----------------------|----------------------|
| 1. 管理人报酬                   | 13,297,315.47         | 12,329,482.51        |
| 2. 托管费                     | 4,029,489.54          | 3,736,206.80         |
| 3. 销售服务费                   | 3,147,512.39          | 2,920,931.42         |
| 4. 交易费用                    | -                     | -                    |
| 5. 利息支出                    | 4,578,868.19          | 1,619,133.68         |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 4,578,868.19          | 1,619,133.68         |
| 6. 其他费用                    | 265,597.23            | 268,003.72           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>137,735,044.01</b> | <b>63,147,029.52</b> |
| 减：所得税费用                    | -                     | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>137,735,044.01</b> | <b>63,147,029.52</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安现金富利投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日      |                 |                    |
|--|--|-----------------|--------------------|
|  | 实收基金                                       | 未分配利润           | 所有者权益合计            |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 8,979,233,915.21                           | -               | 8,979,233,915.21   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 137,735,044.01  | 137,735,044.01     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -2,966,493,630.66                          | -               | -2,966,493,630.66  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 26,624,948,836.44                          | -               | 26,624,948,836.44  |
| 2. 基金赎回款                               | -29,591,442,467.10                         | -               | -29,591,442,467.10 |
| 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） | -  | -137,735,044.01 | -137,735,044.01    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 6,012,740,284.55                           | -               | 6,012,740,284.55   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日 |                 |                    |

|  | 实收基金               | 未分配利润          | 所有者权益合计            |
|--|--------------------|----------------|--------------------|
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 14,108,236,100.20  | -              | 14,108,236,100.20  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                  | 63,147,029.52  | 63,147,029.52      |
| 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）      | -8,538,122,392.50  | -              | -8,538,122,392.50  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 20,184,664,340.07  | -              | 20,184,664,340.07  |
| 2. 基金赎回款                               | -28,722,786,732.57 | -              | -28,722,786,732.57 |
| 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） | -                  | -63,147,029.52 | -63,147,029.52     |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 5,570,113,707.70   | -              | 5,570,113,707.70   |

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：李劼，主管会计工作负责人：李炳旺，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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 2011 年 8 月 26 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生变化。

##### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系              |
|------------------------|----------------------|
| 华安基金管理有限公司             | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构  |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 基金托管人、基金代销机构         |
| 上海光通信公司                | 受上海工业投资(集团)有限公司控制的公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.8.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.8.2 关联方报酬

###### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2011年1月1日至2011年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 13,297,315.47                  | 12,329,482.51                   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,285,059.73                   | 1,297,790.99                    |

注：支付基金管理人华安基金管理有限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。

###### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2011年1月1日至2011年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,029,489.54                   | 3,736,206.80                    |

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

###### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30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           |
|----------------|---------------------------------|------------|--------------|
| 华安基金管理有限公司     | 730,534.49                      | 249,688.79 | 980,223.28   |
| 中国工商银行         | 1,431,982.39                    | 19,653.98  | 1,451,636.37 |
| 合计             | 2,162,516.88                    | 269,342.77 | 2,431,859.65 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30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           |
| 华安基金管理有限公司     | 633,480.08                      | 224,357.47 | 857,837.55   |
| 中国工商银行         | 1,399,216.43                    | 19,264.26  | 1,418,480.69 |
| 合计             | 2,032,696.51                    | 243,621.73 | 2,276,318.24 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日对应级别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管理有限公司，再由华安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。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%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日对应级别基金资产净值 X 对应级别约定年费率 / 当年天数。

#### 6.4.8.3 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<br>2011年1月1日至2011年6月30日      |        |               |       |      |       |      |
|---------------------------------|--------|---------------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的各关联方名称                  | 债券交易金额 |               | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                 | 基金买入   | 基金卖出          | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 中国工商银行                          | -      | 61,839,633.70 | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |        |               |       |      |       |      |
| 银行间市场交易的各关联方名称                  | 债券交易金额 |               | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                 | 基金买入   | 基金卖出          | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |

|        |               |                |   |   |                  |            |
|--------|---------------|----------------|---|---|------------------|------------|
|        |               |                | 额 | 入 |                  |            |
| 中国工商银行 | 30,059,499.86 | 111,026,154.10 | - | - | 1,770,000,000.00 | 151,602.73 |

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

###### 华安现金富利货币 A

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>2011年6月30日 |                          | 华安现金富利货币B上年度末<br>2010年12月31日 |                          |
|-------------|----------------------------|--------------------------|------------------------------|--------------------------|
|             | 持有的<br>基金份额                | 持有的基金份<br>额占基金总份<br>额的比例 | 持有的<br>基金份额                  | 持有的基金份<br>额占基金总份<br>额的比例 |
| 上海光通信<br>公司 | 13,236,108.32              | 0.33%                    | 20,162,088.37                | 0.28%                    |

注：1、上海光通信公司为受上海工业投资(集团)有限公司控制的公司。

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

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称                | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |            |
|----------------------|----------------------------|------------|---------------------------------|------------|
|                      | 期末余额                       | 当期利息收入     | 期末余额                            | 当期利息收入     |
| 中国工商银<br>行股份有限<br>公司 | 713,273,877.91             | 295,322.94 | 36,411,172.74                   | 971,063.90 |

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

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.9 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,129,998,835.00 元，如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码    | 债券名称      | 回购到期日      | 期末估值<br>单价 | 数量（张）      | 期末估值<br>总额       |
|---------|-----------|------------|------------|------------|------------------|
| 1001100 | 10 央票 100 | 2011-07-01 | 98.78      | 900,000    | 88,902,000.00    |
| 110212  | 11 国开 12  | 2011-07-01 | 100.22     | 1,300,000  | 130,286,000.00   |
| 110402  | 11 农发 02  | 2011-07-01 | 100.13     | 1,300,000  | 130,169,000.00   |
| 110221  | 11 国开 21  | 2011-07-01 | 100.18     | 1,500,000  | 150,270,000.00   |
| 080414  | 08 农发 14  | 2011-07-01 | 100.31     | 1,900,000  | 190,589,000.00   |
| 100209  | 10 国开 09  | 2011-07-01 | 100.28     | 4,400,000  | 441,232,000.00   |
| 合计      |           | -          | -          | 11,300,000 | 1,131,448,000.00 |

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截止报告期末 2011 年 6 月 30 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。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额               | 占基金总资产<br>的比例（%） |
|----|--------|------------------|------------------|
| 1  | 固定收益投资 | 4,939,595,095.22 | 68.92            |
|    | 其中：债券  | 4,939,595,095.22 | 68.92            |
|    | 资产支持证券 | -                | -                |



|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 2 | 买入返售金融资产          | 1,429,893,504.84 | 19.95  |
|   | 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      | 713,273,877.91   | 9.95   |
| 4 | 其他各项资产            | 83,917,348.86    | 1.17   |
| 5 | 合计                | 7,166,679,826.83 | 100.00 |

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例 (%)   |                |
|----|--------------|------------------|----------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 3.70             |                |
|    | 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 | 1,129,998,835.00 | 18.79          |
|    | 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。

## 7.3 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 7.4 基金投资组合平均剩余期限

### 7.4.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数  |
|-------------------|-----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 117 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 119 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 59  |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

### 7.4.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金 | 各期限负债占基金资产净 |
|----|--------|----------|-------------|
|----|--------|----------|-------------|

|   |                        | 资产净值的比例 (%) | 值的比例 (%) |
|---|------------------------|-------------|----------|
| 1 | 30 天以内                 | 38.25       | 18.79    |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 13.41       | -        |
| 2 | 30 天(含)—60 天           | 16.66       | -        |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 3.51        | -        |
| 3 | 60 天(含)—90 天           | 11.29       | -        |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 6.47        | -        |
| 4 | 90 天(含)—180 天          | 13.45       | -        |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -           | -        |
| 5 | 180 天(含)—397 天(含)      | 38.14       | -        |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -           | -        |
| 6 | 合计                     | 117.79      | 18.79    |

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种                 | 摊余成本             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|------------------|---------------|
| 1  | 国家债券                 | -                | -             |
| 2  | 央行票据                 | 98,782,448.43    | 1.64          |
| 3  | 金融债券                 | 1,606,521,716.21 | 26.72         |
|    | 其中：政策性金融债            | 1,606,521,716.21 | 26.72         |
| 4  | 企业债券                 | 20,713,372.35    | 0.34          |
| 5  | 企业短期融资券              | 3,213,577,558.23 | 53.45         |
| 6  | 中期票据                 | -                | -             |
| 7  | 其他                   | -                | -             |
| 8  | 合计                   | 4,939,595,095.22 | 82.15         |
| 9  | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 1,406,546,507.99 | 23.39         |

#### 7.6 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  | 100209 | 10 国开 09 | 4,500,000 | 451,267,004.27 | 7.51          |

|    |         |                |           |                |      |
|----|---------|----------------|-----------|----------------|------|
| 2  | 080414  | 08 农发 14       | 1,900,000 | 190,591,338.68 | 3.17 |
| 3  | 110221  | 11 国开 21       | 1,700,000 | 170,309,513.95 | 2.83 |
| 4  | 090205  | 09 国开 05       | 1,500,000 | 152,963,160.59 | 2.54 |
| 5  | 110402  | 11 农发 02       | 1,350,000 | 135,174,315.77 | 2.25 |
| 6  | 110212  | 11 国开 12       | 1,300,000 | 130,286,281.97 | 2.17 |
| 7  | 1181069 | 11 昆钢集<br>CP01 | 1,200,000 | 120,367,331.69 | 2.00 |
| 8  | 1181131 | 11 百联集<br>CP01 | 1,200,000 | 120,131,961.93 | 2.00 |
| 9  | 100230  | 10 国开 30       | 1,100,000 | 109,970,997.29 | 1.83 |
| 10 | 090411  | 09 农发 11       | 1,000,000 | 100,903,081.67 | 1.68 |

### 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况   |
|-------------------------------|--------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 | 0      |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.16%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.20% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.10%  |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法，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。

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

| 序号 | 发生日期      | 该类浮动债占基金资产净值的比例 (%) | 原因           | 调整期                                       |
|----|-----------|---------------------|--------------|---|
| 1  | 2011-6-28 | 20.14               | 6 月份基金份额大幅下降 | 10 个工作日内调整合规。截至 2011 年 7 月 7 日，本基金持有剩余期限小 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | 于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本低于基金净值的 20% |
|--|--|--|--|---|

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

#### 7.9.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | -             |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收利息    | 69,819,952.93 |
| 4  | 应收申购款   | 14,097,395.93 |
| 5  | 其他应收款   | -             |
| 6  | 待摊费用    | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 83,917,348.86 |

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别       | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额     | 持有人结构            |        |                  |        |
|------------|----------|---------------|------------------|--------|------------------|--------|
|            |          |               | 机构投资者            |        | 个人投资者            |        |
|            |          |               | 持有份额             | 占总份额比例 | 持有份额             | 占总份额比例 |
| 华安现金富利货币 A | 51,870   | 39,600.37     | 140,456,026.42   | 6.84%  | 1,913,615,391.03 | 93.16% |
| 华安现金富利货币 B | 101      | 39,194,741.26 | 3,734,863,811.23 | 94.35% | 223,805,055.87   | 5.65%  |
| 合计         | 51,971   | 115,694.14    | 3,875,319,837.65 | 64.45% | 2,137,420,446.90 | 35.55% |

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）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目                   | 份额级别       | 持有份额总数（份）     | 占基金总份额比例 |
|----------------------|------------|---------------|----------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 华安现金富利货币 A | 12,236,457.36 | 0.60%    |
|                      | 华安现金富利货币 B | -             | -        |
|                      | 合计         | 12,236,457.36 | 0.20%    |

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                              | 华安现金富利货币 A       | 华安现金富利货币 B        |
|---------------------------------|------------------|-------------------|
| 基金合同生效日(2003 年 12 月 30 日)基金份额总额 | 4,253,745,531.90 | -                 |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 1,721,805,120.53 | 7,257,428,794.68  |
| 本报告期基金总申购份额                     | 9,380,566,498.66 | 17,244,382,337.78 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 9,048,300,201.74 | 20,543,142,265.36 |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -                | -                 |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 2,054,071,417.45 | 3,958,668,867.1   |

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。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：无。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|--------------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|              |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中银国际证券有限责任公司 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |     | 回购交易 |      | 权证交易 |    |
|------|------|-----|------|------|------|----|
|      | 成交金额 | 占当期 | 成交金额 | 占当期回 | 成交金额 | 占当 |

|              |   | 债券成交总额的比例 |                  | 购成交总额的比例 |   | 期权证成交总额的比例 |
|--------------|---|-----------|------------------|----------|---|------------|
| 国泰君安证券股份有限公司 | - | -         | 4,483,200,000.00 | 100.00%  | - | -          |
| 中银国际证券有限责任公司 | - | -         | -                | -        | - | -          |

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

由研究发展部或基金投资部/市场部分别牵头并组织相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》

研究发展部或基金投资部/市场部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研究发展部或基金投资部/市场部提交的《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。

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

华安基金管理有限公司  
二〇一一年八月二十九日