华安现金富利投资基金

2013 年度 报告摘要

2013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：二〇一四年三月三十一日

§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2014年3月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安现金富利货币	
基金主代码	040003	
交易代码	040003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年12月30日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,062,008,758.29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	1,936,392,682.84份	5,125,616,075.45份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是在资本保全的情况下，确保基金资产的高流动性，追求稳健的当期收益，并为投资者提供暂时的流动性储备。
投资策略	基金管理人将充分发挥自身的研究力量，利用公司研究开发的各种数量模型工具，采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，发现和捕捉短期资金市场的机会，实现基金的投资目标。 1、资产配置策略： 本基金在实际操作中将主要依据各短期金融工具细分市场的规模、流动性和当时的利率环境，建立动态规划模型，通过求解确定不同资产配置比例和同类资产的基于不同利率期限结构的配置比例。 2、其它操作策略： 套利操作：根据各细分短期金融工具的流动性和收益特征，动态调整基金资产在各个细分市场之间的配置比例。比如，当交易所市场回购利率高于银行间市场回购利率时，可通过增加交易所市场回购的配置比例，或在银行间市场融资、交易所市场融券而实现跨市场套利。 期差操作：根据各细分市场中不同品种的风险收益特征，动态调整不同利率期限结构品种的配置比例。比如，短期回购利率低于长期回购利率时，在既定的变现率水平下，可通过增长长期回购的配置比例，或短期融资、长期融券而实现跨品种套利。 滚动配置：根据具体投资品种的市场特性，采用持续投资的方法，以提高基金资产的整体变现能力。例如，对N天期回购协议可每天进行等量配置，而提高配置在回购协议上的基金资产的流动性。 利率预期：在深入分析财政、货币政策以及短期资金市场、资本市场资金面的情况和流动性的基础上，对利率走势形成合理预期，并据此调整基金资产配置策略。
业绩比较基准	以当期银行个人活期储蓄利率（税前）作为衡量本基金操作水平的比较基准。
风险收益特征	本基金面临与其他开放式基金相同的风险（例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等），但由于本基金是以短期金融工具投资为主的低风险开放式基金，上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为：利率风险 信用风险，流动性风险等。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	赵会军
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年		2012年		2011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	99,882,967.62	355,409,475.11	128,898,046.19	357,319,931.20	70,728,934.90	194,632,419.24
本期利润	99,882,967.62	355,409,475.11	128,898,046.19	357,319,931.20	70,728,934.90	194,632,419.24
本期基金份额净值收益率	3.8845%	4.1339%	4.0124%	4.2617%	3.5206%	3.7680%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末		2012年末		2011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	1,936,392,682.84	5,125,616,075.45	3,995,807,774.37	13,911,706,300.89	4,502,316,916.62	13,889,925,695.69
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	2013年末		2012年末		2011年末	
	华安现金富利货币A	华安现金富利货币B	华安现金富利货币A	华安现金富利货币B	华安现金富利货币A	华安现金富利货币B
基金份额累计净值收益率	32.3596%	15.0878%	27.4107%	10.5194%	22.4960%	6.0023%

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	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1001%	0.0027%	0.0882%	0.0000%	1.0119%	0.0027%
过去六个月	2.1567%	0.0027%	0.1764%	0.0000%	1.9803%	0.0027%
过去一年	3.8845%	0.0029%	0.3500%	0.0000%	3.5345%	0.0029%
过去三年	11.8562%	0.0031%	1.2398%	0.0002%	10.6164%	0.0029%
过去五年	15.6470%	0.0045%	1.9598%	0.0002%	13.6872%	0.0043%
自基金成立起至今	32.3596%	0.0053%	5.5709%	0.0005%	26.7887%	0.0048%

2. 华安现金富利货币B

阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1613%	0.0027%	0.0882%	0.0000%	1.0731%	0.0027%
过去六个月	2.2800%	0.0027%	0.1764%	0.0000%	2.1036%	0.0027%
过去一年	4.1339%	0.0029%	0.3500%	0.0000%	3.7839%	0.0029%
过去三年	12.6620%	0.0031%	1.2398%	0.0002%	11.4222%	0.0029%
自基金成立起至今	15.0878%	0.0040%	1.6087%	0.0002%	13.4791%	0.0038%

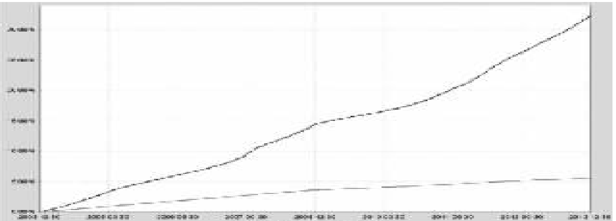
注：自2009年12月23日起，本基金实行销售服务费分级收费方式，分设两级基金份额：A级基金份额和B级基金份额。详情请参阅相关公告。

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

华安现金富利投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2003年12月30日至2013年12月31日）

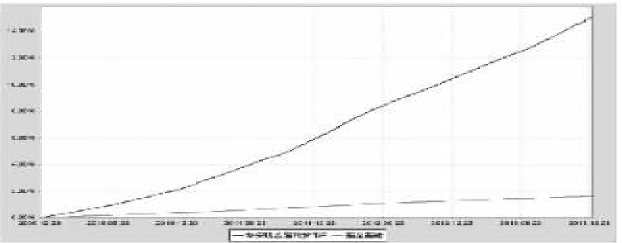
1、华安现金富利货币A

（2003年12月30日至2013年12月31日）



2、华安现金富利货币B

（2009年12月23日至2013年12月31日）

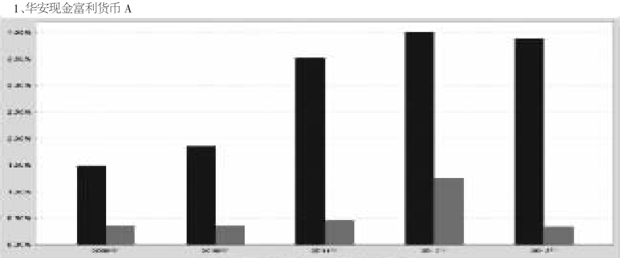


注：自2009年12月23日起，本基金实行销售服务费分级收费方式，分设两级基金份额：A级基金份额和B级基金份额。详情请参阅相关公告。

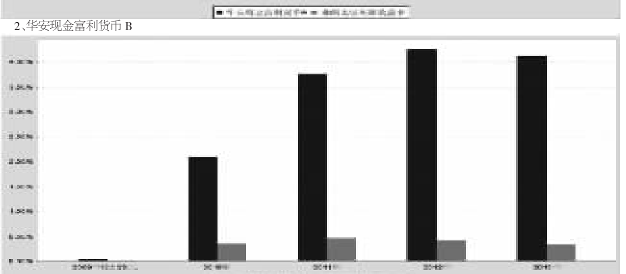
3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安现金富利投资基金
过去五年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

1、华安现金富利货币A

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2011	62,148,846.12	7,833,724.69	746,364.09	70,728,934.90	-
2012	116,051,050.06	20,378,936.79	-7,531,940.66	128,898,046.19	-
2013	95,826,330.82	11,251,383.07	-7,194,746.27	99,882,967.62	-
合计	274,026,227.00	39,464,044.55	-13,980,322.84	299,509,948.71	-

2、华安现金富利货币B

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2011	158,588,199.11	22,081,748.68	13,962,471.45	194,632,419.24	-
2012	309,494,423.49	36,836,326.90	10,989,180.81	357,319,931.20	-
2013	327,512,836.16	31,875,827.05	-3,979,188.10	355,409,475.11	-
合计	795,595,458.76	90,793,902.63	20,972,464.16	907,361,825.55	-

§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2013年12月31日，公司旗下共管理了华安安顺封闭1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、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证180ETF、华安上证180ETF联接、华安上证龙头企业ETF、龙头ETF联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证300指数基金（LOF）、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安七日鑫短期理财债券、华安沪深300指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费股票、华安纳斯达克100指数、华安黄金易（ETF）、华安黄金ETF联接、华安沪深300量化指数、华安年年红债券、华安生态优先股票、华安中证细分地产ETF、华安中证细分医药ETF等46只开放式基金。管理资产规模达到838.62亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄勤	本基金的基金经理，固定收益部总监	2007-05-16	2013-08-28	12年	经济学硕士，持有基金从业人员资格证书，17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月至2013年8月任职于华安基金管理公司，曾任固定收益部债券投资经理，2007年5月至2013年8月担任本基金的基金经理，2009年4月至2012年10月担任华安强化收益债券型基金的基金经理。2011年12月至2013年8月同时担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理。2012年12月至2013年8月同时担任华安7日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。
杨柳	本基金的基金经理	2012-11-23	2013-10-08	11年	金融学硕士，11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月至2013年10月任职于华安基金管理有限公司，任集中交易部高级交易员。2009年12月至2012年11月担任本基金的基金经理助理。2012年11月至2013年10月担任本基金的基金经理。2012年5月至2013年10月担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金及华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理，2012年6月至2013年10月同时担任华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。
贺涛	本基金的基金经理、固定收益部副总监	2013-10-08	-	16年	金融学硕士（金融工程方向），16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。
张晟刚	本基金的基金经理	2013-10-08	-	15年	硕士研究生，15年银行、证券行业从业经验。曾在中国银行上海分行、伦敦分行、总行交易中心担任高级交易员、高级经理等职务。2012年11月加入华安基金管理有限公司。2013年1月起担任华安日日鑫货币市场基金及华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理；2013年3月起担任华安纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。2013年5月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2013年10月起同时担任本基金、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。

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《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，除因季末出现巨额赎回，导致本基金持有不具有托管资格同一银行的存款高于5%以外，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，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司合规监察稽核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；风险管理部根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况共出现了3次。原因：各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖数量极少，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，也未发现有异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年欧美经济稳步复苏，股市迭创新高。尤其是美国经济在多领域表现出了持续增长动力，就业和房地产市场的改善夯实了消费的基础。5月开始美联储启动了QE退出的市场预期，美国国债利率大幅上升，12月18日正式迈出削减量化宽松第一步。欧元区经济企稳复苏，但地区间高度不平衡。同时，新兴经济体经济增速高位回落，较高的杠杆和疲软的消费迫使加快结构调整和转型。

2013年中国经济增速平稳，通胀温和。从"三驾马车"的结构看，增长主要依靠投资拉动，结构失衡有所加剧。于此同时，中国依靠货币扩张的经济模式积聚了一定的金融风险。从二季度开始，央行开始收紧货币政策，倒逼金融机构去杠杆。资金总量层面的供需矛盾和结构性问题，即融资平台和房地产通过信托和委托贷款吸收了大量的融资，使得融资成本飙升。而互联网金融引领的利率市场化变革，加速分流银行存款，助推了资金价格，使得2013年流动性问题集中爆发。

债券市场的走势可谓是跌宕起伏。一季度在流动性宽松的背景下，延续了自11年四季度以来的牛市行情，收益率持续下行，高收益债券表现出色。进入二季度后，随着监管升级，银监会8号文出台治理影子银行；央行"锁长放短"扭曲操作，市场对流动性预期急速逆转，债市收益率节节走高。而传统的配债大户商业银行和保险在资金成本飙升情况下，更是"舍债迫非"，为债市雪上加霜。标杆性的10年国债最高触及4.72%，刷新了近九年来的记录。信用债发行遭遇寒冬，AAA短融全年收益上行超过200BP，5年AAA中票上行超过130BP。

本报告期内，基金保持了仓位调整的灵活性，下半年主要积极化解风险，把握货币市场利率冲高的机会，通过协议存款和回购提高组合收益。因此，2013年通过审慎和积极的管理，化解了债市调整带来的市场风险和赎回带来的流动性压力，保持了组合的稳健良好的表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013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：3.8845% 比较基准：0.3500%

期初规模：39.96亿 期末规模：19.36亿

2.华安现金富利货币B

投资回报：4.1339% 比较基准：0.3500%

期初规模：139.12亿 期末规模：51.26亿

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年欧美经济温和复苏，新兴市场国家结构调整，仍将延续，在QE退潮的背景下，欧洲和日本央行放水，一定程度上弥补了外部流动性不足。中国基本面好于一般新兴市场国家，预计外汇占款今年保持流入。国内方面，经济和通胀总体保持稳定，但改革和转型加速中，经济增速会有不确定性。地方债务问题和金融机构杠杆问题将考验执政者的能力，经济结构转型任重道远。

货币政策和流动性仍是焦点。市场化和互联网金融带来的创新革命将继续和扩大化，降低了银行存款可得性，提高了银行的资金成本。但债市调整已经影响到实体经济的正常融资，同业业务监管制度已经酝酿推出，协调有效的金融监管机制正在建立，因此货币政策出现放松的机会，流动性会较13年有所改善。债券收益率在去年全面大幅上行之后，部分品种的绝对收益有着较好的投资价值。

操作方面，我们将继续做好基金的流动性和收益性的平衡，关注债市的投资机会，特别是中高评级短融，甄选个选进行配置和波段操作。同时也会保持组合良好的流动性，把握利率冲高时点锁定收益。在控制组合风险的基础上，为投资者积极赚取高收益。

我们将秉承稳健、专业的投资理念，优化组合结构，控制风险，勤勉尽责地维护持有人的利益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

（1）公司方面

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

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

相关人员专业胜任能力及工作经历：

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

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

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

贺涛，金融学硕士，固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安稳定收益债券基金、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债添利债券基金的基金经理，固定收益部副总监。

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

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

（2）托管银行

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

（3）会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金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99,882,967.62元，华安现金富利货币B累计收益分配金额355,409,475.11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

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》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安现金富利投资基金2013年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师汪棣、傅琛慧签字出具了普华永道中天审字（2014）第20927号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安现金富利投资基金

报告截止日：2013年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产：		
银行存款	2,944,921,286.74	6,595,810,093.53
结算备付金	-	181,818.18
存出保证金	-	-
交易性金融资产	2,204,931,355.42	4,268,031,223.36
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,204,931,355.42	4,268,031,223.36
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,893,004,240.10	6,982,188,655.43
应收证券清算款	-	197,054.99
应收利息	49,424,398.15	105,558,682.52
应收股利	-	-
应收申购款	188,819,428.42	470,203,640.19
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,281,100,708.83	18,422,171,168.20
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	194,999,582.50	354,999,622.50
应付证券清算款	-	10,058,754.52
应付赎回款	1,770,318.53	113,744,730.42
应付管理人报酬	1,783,921.58	3,390,479.39
应付托管费	540,582.31	1,027,418.00
应付销售服务费	490,256.77	711,720.35
应付交易费用	60,880.42	83,595.51
应交税费	3,705,883.78	3,705,883.78
应付利息	17,304.65	37,734.10
应付利润	15,295,220.00	26,469,154.37
递延所得税负债	-	-
其他负债	428,000.00	428,000.00
负债合计	219,091,950.54	514,657,092.94
所有者权益：		
实收基金	7,062,008,758.29	17,907,514,075.26
未分配利润	-	-
所有者权益合计	7,062,008,758.29	17,907,514,075.26
负债和所有者权益总计	7,281,100,708.83	18,422,171,168.20

注：报告截止日2013年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额7,062,008,758.29份，其中A级基金份额总额1,936,392,682.84份，B级基金份额总额5,125,616,075.45份。

7.2 利润表

会计主体：华安现金富利投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	529,473,219.00	570,739,872.52
1.利息收入	505,766,955.37	526,443,052.01
其中：存款利息收入	272,058,974.35	356,638,014.11
债券利息收入	161,723,221.13	142,262,772.15
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	71,984,759.89	27,542,265.75
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	23,706,107.21	44,296,820.51
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	23,706,107.21	44,296,820.51
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）	156.42	-
减：二、费用	74,180,776.27	84,521,895.13
1.管理人报酬	39,059,051.47	39,609,801.53
2.托管费	11,836,076.11	12,002,970.14
3.销售服务费	7,565,250.91	8,977,037.72
4.交易费用	-	-
5.利息支出	15,078,488.98	23,255,497.27
其中：卖出回购金融资产支出	15,078,488.98	23,255,497.27
6.其他费用	641,908.80	676,588.47
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	455,292,442.73	486,217,977.39
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列	455,292,442.73	486,217,977.39

7.2 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：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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）	17,907,514,075.26	-	17,907,514,075.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	455,292,442.73	455,292,442.73
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）	-10,845,505,316.97	-	-10,845,505,316.97
其中：1.基金申购款	55,441,946,063.18	-	55,441,946,063.18
2.基金赎回款	-66,287,451,380.15	-	-66,287,451,380.15
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）	-	-455,292,442.73	-455,292,442.73
五、期末所有者权益（基金净值）	7,062,008,758.29	-	7,062,008,758.29
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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）	18,392,242,612.31	-	18,392,242,612.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	486,217,977.39	486,217,977.39
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）	-484,728,537.05	-	-484,728,537.05
其中：1.基金申购款	65,927,536,390.16	-	65,927,536,390.16
2.基金赎回款	-66,412,264,927.21	-	-66,412,264,927.21
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）	-	-486,217,977.39	-486,217,977.39
五、期末所有者权益（基金净值）	17,907,514,075.26	-	17,907,514,075.26

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码（序号）从7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：李勍，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

7.2 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2014年3月28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7.4.4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2013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2013年12月31日的财务状况以及2013年度 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

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 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（"华安基金公司"）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（"中国工商银行"）	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气（集团）总公司	基金管理人的股东
上海工业投资（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
上海光通信公司	受上海工业投资（集团）有限公司控制的公司
上海电气集团财务有限责任公司	受上海电气（集团）总公司控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

无。

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	39,059,051.47	39,609,801.53
其中：支付销售机构的客户维护费	2,579,805.07	3,520,180.31

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	11,836,076.11	12,002,970.14

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

7.4.8.2.3 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 2013年1月1日至2013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	1,670,409.75	864,887.91	2,535,297.66
中国工商银行	2,489,927.55	12,669.73	2,502,597.28
合计	4,160,337.30	877,557.64	5,037,894.94
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	1,776,304.57	779,766.97	2,556,071.54
中国工商银行	2,831,381.15	22,321.03	2,853,702.18
合计	4,607,685.72	802,088.00	5,409,773.72

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。

7.4.8.3 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日					
	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	130,323,437.67	467,888,579.32	224,640,000.00	387,277.83	750,000,000.00	154,407.44
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日					
	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	41,743,903.06	290,185,053.80	390,000,000.00	489,947.05	2,877,000,000.00	263,421.41

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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 2013年12月31日		华安现金富利货币A上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上海光通信公司	-	-	3,762,781.42	0.09%

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 2013年12月31日		华安现金富利货币B上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上海电气集团财务有限责任公司	105,846,357.76	2.07%	-	-
上海光通信公司	29,239,418.66	0.57%	-	-

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	264,921,286.74	96,003,567.09	1,615,810,093.53	37,636,868.91

注：1.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。

2.本基金本期末存放于基金托管人中国工商银行的协议存款金额为250,000,000.00元，年利率为5.65%。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额194,999,582.50元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
041352038	13核风电CP001	2014-01-02	99.28	500,000	49,640,000.00
041359041	13金茂CP001	2014-01-02	99.43	500,000	49,715,000.00
100230	10国开30	2014-01-02	98.80	1,000,000	98,800,000.00
合计		-	-	-	198,155,000.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末2013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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

（a）不以公允价值计量的金融工具

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

（b）以公允价值计量的金融工具

（i）金融工具公允价值计量的方法

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

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

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

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

（ii）各层级金融工具公允价值

于2013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级的余额为2,204,931,355.42元，无属于第一或第三层级的余额（2012年12月31日：第二层级4,268,031,223.36元，无属于第一或第三层级的余额）。

（iii）公允价值所属层级间的重大变动

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

（iv）第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

（2）除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	2,204,931,355.42	30.28
	其中：债券	2,204,931,355.42	30.28
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,893,004,240.10	26.00
	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	2,944,921,286.74	40.45
4	其他各项资产	238,243,826.57	3.27
	合计	7,281,100,708.83	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	3.65	
	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	194,999,582.50	2.76
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

8.3 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

8.4 基金投资组合平均剩余期限

8.4.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	60
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

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。

8.4.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	70.47	2.76
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.83	-
2	30天（含）—60天	1.84	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.70	-
3	60天（含）—90天	3.07	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.07	-
4	90天（含）—180天	15.01	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天（含）—397天（含）	9.34	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.73	2.76

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	434,945,506.80	6.16
	其中：政策性金融债	434,945,506.80	6.16
4	企业债券	10,223,858.47	0.14
5	企业短期融资券	1,759,761,990.15	24.92
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	2,204,931,355.42	31.22
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	395,203,015.82	5.60

8.6 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	110212	11国开12	1,460,000	145,758,701.56	2.06
2	041358045	13中铝业CP002	1,300,000	130,003,279.39	1.84
3	041361026	13津城建CP001	1,300,000	129,983,312.98	1.84
4	100230	10国开30	1,200,000	119,901,614.17	1.70
5	041351026	13浙国贸CP001	1,100,000	110,003,400.72	1.56
6	041356031	13中铝CP002	1,000,000	99,958,085.25	1.42
7	090205	09国开05	600,000	60,536,041.94	0.86
8	041363008	13海宁CP001	600,000	59,798,462.12	0.85
9	041361044	13中普天CP001	500,000	50,077,859.02	0.71
10	041356012	13秦三核CP001	500,000	50,030,924.44	0.71

8.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25（含）-0.5%间的次数	27
报告期内偏离度的最高值	0.18%
报告期内偏离度的最低值	-0.34%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.13%

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.00元。

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

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

8.9.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	49,424,398.15
4	应收申购款	188,819,428.42
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	238,243,826.57

§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	104,801	18,476.85	105,273,367.69	5.44%	1,831,119,315.15	94.56%
华安现金富利货币B	99	51,773,899.75	4,844,322,369.47	94.51%	281,293,705.98	5.49%
合计	104,900	67,321.34	4,949,595,737.16	70.09%	2,112,413,021.13	29.91%

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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	华安现金富利货币A	3,427,214.21	0.17699%
	华安现金富利货币B	-	-
	合计	3,427,214.21	0.04853%

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至10万份（含）；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

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	3,995,807,774.37	13,911,706,300.89
本报告期基金总申购份额	14,274,983,579.39	41,166,962,483.79
减：本报告期基金总赎回份额	16,334,398,670.92	49,953,052,709.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,936,392,682.84	5,125,616,075.45

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）2013年8月28日，基金管理人发布了华安现金富利投资基金基金经理变更公告，黄勤先生不再担任本基金的基金经理，杨柳女士继续担任本基金的基金经理。

（2）2013年10月8日，基金管理人发布了华安现金富利投资基金基金经理变更公告，杨柳女士不再担任本基金的基金经理，聘请贺涛先生和张晟刚先生担任本基金的基金经理。

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139,000.00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的情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
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	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	-	-	32,054,100,000.00	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。

华安基金管理有限公司
二〇一四年三月三十一日