华安现金富利投资基金

【2011】年度报告摘要

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:二〇一二年三月二十九日

§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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签子同意,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2012年3月23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2011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	
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	18,392,242,612.31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	4,502,316,916.62份	13,889,925,695.69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、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	2011年		2010年		2009年12月23日-2009年12月31日	
	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	70,728,934.90	194,632,419.24	36,180,638.72	100,504,030.26	176,699,370.64	2,660,170.96
本期利润	70,728,934.90	194,632,419.24	36,180,638.72	100,504,030.26	176,699,370.64	2,660,170.96
本期基金份额净值收益率	3.5206%	3.7680%	1.8614%	2.1059%	1.4998%	0.0465%
3.1.2期末数据和指标	2011年末		2010年末		2009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	4,502,316,916.62	13,889,925,695.69	1,721,805,120.53	7,257,428,794.68	1,992,153,839.24	12,116,082,260.96
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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	1.0736%	0.0024%	0.1260%	0.0000%	0.9476%	0.0024%
过去六个月	1.8630%	0.0032%	0.2521%	0.0000%	1.6109%	0.0032%
过去一年	3.5206%	0.0028%	0.4697%	0.0001%	3.0509%	0.0027%
过去三年	7.0289%	0.0038%	1.1897%	0.0002%	5.8392%	0.0036%
过去五年	14.4219%	0.0056%	2.6349%	0.0005%	11.7870%	0.0051%
自基金合同生效起至今	22.4960%	0.0050%	4.8008%	0.0005%	17.6952%	0.0045%

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	1.1339%	0.0024%	0.1260%	0.0000%	1.0079%	0.0024%
过去六个月	1.9855%	0.0032%	0.2521%	0.0000%	1.7334%	0.0032%
过去一年	3.7680%	0.0028%	0.4697%	0.0001%	3.2983%	0.0027%
自基金合同生效起至今	6.0023%	0.0035%	0.8386%	0.0002%	5.1637%	0.0033%

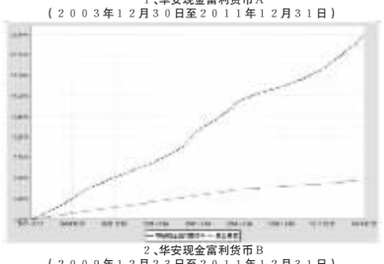
注:自2009年12月23日起,本基金实行销售服务费分级收费方式,分设两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额。详情请参阅相关公告。

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2011年12月31日)

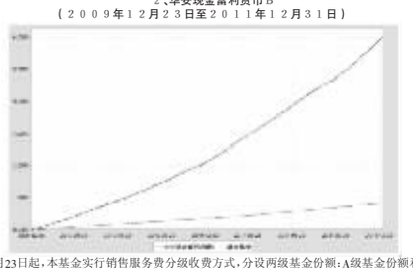
1、华安现金富利货币A

(2003年12月30日至2011年12月31日)



2、华安现金富利货币B

(2009年12月23日至2011年12月31日)

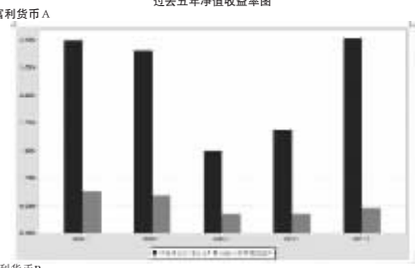


注:自2009年12月23日起,本基金实行销售服务费分级收费方式,分设两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额。详情请参阅相关公告。

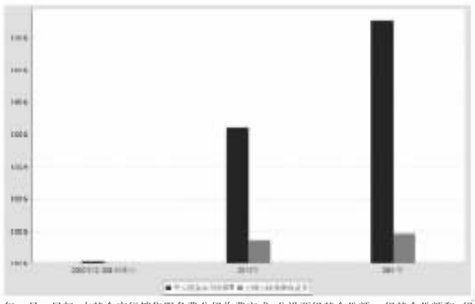
3.2.3过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安现金富利投资基金
过去五年净值收益率图

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年	62,148,846.12	7,833,724.69	746,364.09	70,728,934.90	-
2010年	33,311,454.11	4,607,313.81	-1,738,129.20	36,180,638.72	-
2009年	189,828,147.88	19,842,651.22	-32,971,428.46	176,699,370.64	-
合计	285,288,448.11	32,283,689.72	-33,963,193.57	283,608,944.26	-

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年	158,588,199.11	22,081,748.68	13,962,471.45	194,632,419.24	-
2010年	86,646,807.33	8,970,857.54	4,886,365.39	100,504,030.26	-
2009年12月23日至31日	-	390,684.37	2,269,486.59	2,660,170.96	-
合计	245,235,006.44	31,443,290.59	21,118,323.43	297,796,620.46	-

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12月31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、华安上证180ETF联接、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、华安动态灵活配置混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证龙头ETF、华安上证龙头ETF联接、华安升级主题股票、华安深证300指数(LOF)、华安稳固收益债券、华安可转债债券、华安信用四季红债券、华安科技动力股票、华安香港精选股票(QDII)、华安大中华升级股票(QDII)等24只开放式证券投资基金,管理资产规模达到795.34亿元人民币。

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	-	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。2011年12月起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。
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》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,风险管理部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

2011年没有出现异常交易。

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的运作分析

2011年,世界经济在艰难的复苏中蹒跚而行,主权债务危机升级蔓延,经济下行风险凸显。欧元区财政和金融风险交替上升,增长前景不容乐观。欧美各国在本年度不断释放流动性,数量宽松和大规模购买资产操作等措施再出江湖,全球金融市场震荡加剧。

在这样的外部环境之下,本年度中国经济也面临沉重压力,一方面是国内通胀持续徘徊在高位,另一方面是宏观调控导致银根持续紧缩,对金融市场和实体都产生了显著的影响。上半年央行连续六次上调了存款准备金率,并两次上调了存贷款基准利率,四季度货币政策转为"预调微调",下调存款准备金率0.5个百分点,暂停三年央票发行,并下调了一年央票发行利率。年末一年央票发行利率较上年末上行98个BP至3.4875%,全年货币市场反复出现脉冲式波动,波动区间也显著加大。

本年度内货币市场多次出现较大起伏,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来提高季末的组合收益。

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:3.5206% 比较基准:0.4697%

期初规模:17.22亿 期末规模:45.02亿

2、华安现金富利货币B

投资回报:3.7680% 比较基准:0.4697%

期初规模:72.57亿 期末规模:138.90亿

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年,世界经济仍面临诸多不确定性,一方面欧债危机仍将持续,欧元区经济难有起色,另一方面可能出现的地缘政治风险、各主要国家大选进程,以及发染国际政治形势都使得原本就不乐观的世界经济陡增变数。

中国经济前景仍将比较复杂,未来经济整体增速将取决于外部环境和国内政策放松这两个因素。2012年实体经济增速总体回落,通胀保持下行趋势,政策导向从过去的"控通胀"逐步转为"稳增长",上半年或将继续下调准备金率,但大规模放松的可能性不大。预计在目前政策导向下,信贷增长将有所恢复,货币状况将得以逐步缓解,预期货币市场利率中枢将稳步下行。

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,继续为投资者提供安全、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,2011年8月24日离职,离任前华安基金管理有限公司副总裁。

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,现任投资研究部总监。

宋磊,投资研究部联席总监,工学硕士,曾在大鹏证券、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、投资研究部联席总监。

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、华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部总监。

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,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70,728,934.90元,华安现金富利货币B累计收益分配金额194,632,419.24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,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

2011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2011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有限公司审计,注册会计师汪棣、金毅签字出具了普华永道中天审字(2012)第20643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:2011年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资产:		
银行存款	6,819,893,234.40	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	3,184,299,044.06	4,049,429,134.36
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,184,299,044.06	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	7,018,732,939.77	2,016,204,814.51
应收证券清算款	-	-
应收利息	81,094,243.72	44,013,963.84
应收股利	-	-
应收申购款	1,323,679,122.19	173,596,473.52
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	10,000.00
资产总计	18,427,698,584.14	9,027,062,944.76
负债和所有者权益	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	4,315,595.41	33,064,376.71
应付管理人报酬	2,648,657.93	1,737,629.79
应付托管费	802,623.58	526,554.52
应付销售服务费	543,348.43	405,530.35
应付交易费用	87,248.48	37,458.72
应交税费	3,642,483.78	3,365,300.78
应付利息	-	-
应付利润	23,011,914.22	8,303,078.68
递延所得税负债	-	-
其他负债	404,100.00	389,100.00
负债合计	35,455,971.83	47,829,029.55
所有者权益:		
实收基金	18,392,242,612.31	8,979,233,915.21
未分配利润	-	-
所有者权益合计	18,392,242,612.31	8,979,233,915.21
负债和所有者权益总计	18,427,698,584.14	9,027,062,944.76

注:报告截止日2011年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额18,392,242,612.31份,其中华安现金富利货币A类份额总额4,502,316,916.62份,华安现金富利货币B类份额总额13,889,925,695.69份。

7.2 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12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、收入	314,362,977.46	177,834,909.34
1.利息收入	317,072,165.13	155,927,161.81
其中:存款利息收入	110,914,437.32	45,550,900.99
债券利息收入	134,875,429.73	100,133,690.98
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	71,282,298.08	10,242,569.84
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-2,709,187.67	21,907,747.53
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,709,187.67	21,907,747.53
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	49,001,623.32	41,150,240.36
1.管理人报酬	24,064,656.54	22,876,998.73
2.托管费	7,292,320.16	6,932,423.98
3.销售服务费	5,625,655.58	5,471,997.21
4.交易费用	390.00	-
5.利息支出	11,478,473.55	5,357,186.20
其中:卖出回购金融资产支出	11,478,473.55	5,357,186.20
6.其他费用	540,127.49	511,634.24
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	265,361,354.14	136,684,668.98
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	265,361,354.14	136,684,668.98

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:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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)	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)	-	265,361,354.14	265,361,354.14
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)	9,413,008,697.10	-	9,413,008,697.10
其中:1.基金申购款	57,695,516,369.19	-	57,695,516,369.19
2.基金赎回款	-48,282,507,672.09	-	-48,282,507,672.09
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)	-	-265,361,354.14	-265,361,354.14
五、期末所有者权益(基金净值)	18,392,242,612.31	-	18,392,242,612.31
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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)	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)	-	136,684,668.98	136,684,668.98
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)	-5,129,002,184.99	-	-5,129,002,184.99
其中:1.基金申购款	42,310,813,913.88	-	42,310,813,913.88
2.基金赎回款	-47,439,816,098.87	-	-47,439,816,098.87
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)	-	-136,684,668.98	-136,684,668.98
五、期末所有者权益(基金净值)	8,979,233,915.21	-	8,979,233,915.21

报告附注为财务报表的组成部分

本报告从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:李勋,主管会计工作负责人:赵敏,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、封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2012年3月26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。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2011年度财务报表将符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2011年12月31日的财务状况以及2011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[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。

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

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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	24,064,656.54	22,876,998.73
其中:支付销售机构的客户维护费	2,158,096.52	2,414,457.69

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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,292,320.16	6,932,423.98

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 2011年1月1日至2011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	1,347,901.44	456,637.15	1,804,538.59
中国工商银行	2,442,147.20	26,614.65	2,468,761.85
合计	3,790,048.64	483,251.80	4,273,300.44
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	1,247,546.33	422,642.71	1,670,189.04
中国工商银行	2,601,491.60	35,532.47	2,637,024.07
合计	3,849,037.93	458,175.18	4,