华安现金富利投资基金 2017年年度报告摘要

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:二〇一八年三月二十七日

§1 重要提示

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2018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2017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	26,961,876,942.21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	828,869,829.66份	26,133,007,112.55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,在既定的安全率水平下,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。 久期配置: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安现能力。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	钱鲲	郭明
	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		021-68993414	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要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	2017年		2016年		2015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	33,072,470.89	685,697,389.41	25,269,252.24	577,376,713.62	59,699,920.87	426,318,272.19
本期利润	33,072,470.89	685,697,389.41	25,269,252.24	577,376,713.62	59,699,920.87	426,318,272.19
本期净值收益率	3.7619%	4.0106%	2.3555%	2.6017%	3.4078%	3.6561%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末		2015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	828,869,829.66	26,133,007,112.55	1,048,793,275.31	19,814,050,078.04	2,591,072,074.22	37,080,054,529.08
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。

3.2 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	0.9709%	0.0012%	0.0882%	0.0000%	0.8827%	0.0012%
过去六个月	1.9372%	0.0010%	0.1764%	0.0000%	1.7608%	0.0010%
过去一年	3.7619%	0.0014%	0.3500%	0.0000%	3.4119%	0.0014%
过去三年	9.8250%	0.0029%	1.0510%	0.0000%	8.7740%	0.0029%
过去五年	19.1925%	0.0037%	1.7510%	0.0000%	17.4415%	0.0037%
自基金合同生效起至今	51.8636%	0.0056%	6.9719%	0.0005%	44.8917%	0.0051%

2. 华安现金富利货币B:

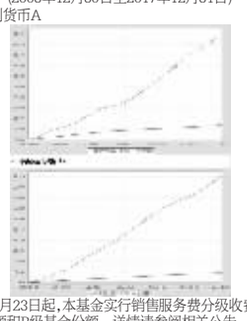
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0318%	0.0012%	0.0882%	0.0000%	0.9436%	0.0012%
过去六个月	2.0603%	0.0010%	0.1764%	0.0000%	1.8839%	0.0010%
过去一年	4.0106%	0.0014%	0.3500%	0.0000%	3.6606%	0.0014%
过去三年	10.6180%	0.0029%	1.0510%	0.0000%	9.5670%	0.0029%
过去五年	20.6289%	0.0037%	1.7510%	0.0000%	18.8779%	0.0037%
自基金合同生效起至今	33.3180%	0.0043%	3.0097%	0.0001%	30.3083%	0.0042%

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
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2017年12月31日)

1、华安现金富利货币A

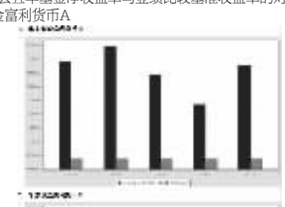


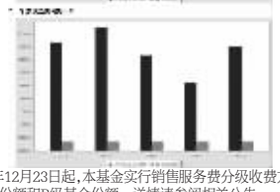
注:自2009年12月23日起,本基金实行销售服务费分级收费方式,分设两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额。详情请参阅相关公告。

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





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
2017年	33,723,706.22	-1,552,117.98	900,883.65	33,072,470.89	-
2016年	29,228,335.78	1,855,799.16	-5,814,882.70	25,269,252.24	-
2015年	58,264,289.19	10,254,908.05	-8,819,276.37	59,699,920.87	-
合计	121,216,330.19	10,558,589.23	-13,733,275.42	118,041,644.00	-

华安现金富利货币B:

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
2017年	545,160,054.82	116,367,827.55	24,169,507.04	685,697,389.41	-
2016年	534,957,953.96	55,775,450.86	-13,356,691.20	577,376,713.62	-
2015年	345,338,061.73	54,440,829.12	26,539,381.34	426,318,272.19	-
合计	1,425,456,070.51	226,584,107.53	37,352,197.18	1,689,392,375.22	-

§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。目前的股东为国泰君安投资管理股份有限公司、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创新投资有限公司。公司在北京、上海、沈阳、成都、广州等地设有分公司,在香港和上海设有子公司—华安(香港)资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至2017年12月31日,公司旗下共管理华安创新混合、华安MSCI中国A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等98只开放式基金,管理资产规模达到1851.32亿元人民币。

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		
贺涛	本基金的基金经理、固定收益部总监	2013-10-08	2017-07-24	20年	金融学硕士(金融工程方向),20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月至2017年6月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9月起担任固定收益部副总监。2013年10月至2017年7月同时担任本基金、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月至2017年7月同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理。2015年2月至2017年6月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月至2017年7月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月至2017年7月,同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月起,同时担任华安安保保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年7月起同时担任华安安保保本混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016年11月起,同时担任华安睿享定期开放混合型发起式证券投资基金、华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年2月起,同时担任华安新活力灵活配置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	-	7年	硕士研究生,7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月至2017年7月,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的基金经理,2014年8月至2015年1月,同时担任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顺养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016年10月起,同时担任华安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月起,同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起,同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。

注: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。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,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,超过授权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,因组合流动性管理或投资策略调整需要,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。

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

回顾2017年,海外主要经济体温和复苏持续,美欧日从低增长、低通胀向增长回升、通胀略有回升发展。全球货币正常化持续推进,美联储三次加息,10月启动缩表;欧日央行缩表计划逐步临近议事日程。2017年,国内宏观经济表现稳中向好,在供给侧改革推动下,工业品价格上涨超预期、企业利润回升,通胀预期有所升温。国民消费较为稳定,且占GDP的贡献项不断上升。货币政策逐步趋紧推动金融去杠杆,央行上调公开市场操作利率三次,资金利率大幅提高,流动性紧平衡。三行一会多项监管政策落地,重塑金融业态,商业银行同业负债和同业资产双双回落。债券市场在货币政策趋紧、监管趋严叠加经济改善的影响下,收益率大幅走升,十年国债去年走升90个基点。中美利差大幅走阔,外储逐步回升,人民币大幅升值。企业融资需求较旺盛,融资阶段性转向贷款,债券市场净融资额较2016年下降33%,信用债净融资额更是显著回落92%,信用利差明显走阔。

本基金将流动性和安全性置于首位,在此基础上灵活调整仓位和追求收益。资产配置以逆回购、存款和同业存单为主,积极把握流动性紧张时点锁定资产,合理分布资产到期,积极进行波段操作,努力为持有人赚取收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2017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:3.7619% 比较基准:0.3500%

期初规模:10.49亿 期末规模:8.29亿

2.华安现金富利货币B

投资回报:4.0106% 比较基准:0.3500%

期初规模:198.14亿 期末规模:261.33亿

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018,减税落地后美国经济预期向好,联储加息步伐或将有所加快。日本和欧洲央行将加入回归货币正常化的道路,外围流动性收紧将成为必然。国内宏观经济平稳,房地产投资和政府基建投资虽面临下行压力,但制造业升级和消费升级点燃中国经济新动能。2018预计PPI和CPI剪刀差继续收窄,通胀预期升温,但总体仍处于良性区间。宏观审慎下,严监管氛围不改,金融去杠杆步入下半场,大资管行业将继续面临负债和资产收缩的局面。货币政策维持中性姿态,货币政策工具进一步丰富,精准调控流动性,资金面将保持紧平衡。债市收益率预期逐步筑顶,收益率曲线有所走陡但依然偏平坦化。融资环境趋紧、严监管挤泡沫的大环境下,信用风险仍需高度警惕,尤其是对于信用资质较差的民企、财政压力明显的地方债以及同业业务激进扩张、脱实向虚的商业银行。

我们将继续严控组合流动性和安全性,合理调整仓位和久期。积极握资金价格阶段性走高的机会,锁定高收益存款和逆回购。同时也会积极参与短融和NCD的波段操作,为投资人赚取收益。我们将持续跟踪债券的信用风险,严格甄选个券,信用债投资保持高等级。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时,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;同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成,具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

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33,072,470.89元,华安现金富利货币B累计收益分配金额685,697,389.41元。

4.8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2017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

本报告期的基金财务会计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 单峰 魏佳亮签字出具了普华永道中天审字(2018)第 20798 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:2017年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产:	-	-
银行存款	5,286,670,790.65	3,167,000,097.33
结算备付金	5,681,818.18	-
存出保证金	-	614.04
交易性金融资产	8,939,356,186.54	2,972,539,389.48
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	8,939,356,186.54	2,972,539,389.48
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	12,329,082,580.33	14,706,635,319.98
应收证券清算款	-	10,954.17
应收利息	97,076,948.90	71,676,879.67
应收股利	-	-
应收申购款	565,961,081.39	9,107,750.92
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	27,223,829,405.99	20,926,971,005.59
负债和所有者权益	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016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	209,699,445.45	24,919,842.62
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	1,706,967.12	15,746,671.79
应付管理人报酬	4,998,774.40	3,478,230.81
应付托管费	1,514,780.13	1,054,009.32
应付销售服务费	322,515.67	290,658.73
应付交易费用	285,869.07	439,520.63
应交税费	-	-
应付利息	157,561.45	4,558.54
应付利润	42,844,560.49	17,774,159.80
递延所得税负债	-	-
其他负债	422,000.00	420,000.00
负债合计	261,952,463.78	64,127,652.24
所有者权益:	-	-
实收基金	26,961,876,942.21	20,862,843,353.35
未分配利润	-	-
所有者权益合计	26,961,876,942.21	20,862,843,353.35
负债和所有者权益总计	27,223,829,405.99	20,926,971,005.59

注:报告截止日2017年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额26,961,876,942.21份,其中A级基金基金份额总额828,869,829.66份,B级基金基金份额总额26,133,007,112.55份。

7.2 利润表

会计主体:华安现金富利投资基金

本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
一、收入	831,596,361.88	727,163,021.13
1.利息收入	834,409,438.03	718,530,676.53
其中:存款利息收入	313,992,185.05	345,610,079.33
债券利息收入	224,169,335.82	241,211,381.47
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	296,247,917.16	131,709,215.73
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-2,813,076.15	8,607,610.35
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,813,076.15	8,607,610.35
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)	-	24,734.25
减:二、费用	112,826,501.58	124,517,055.27
1. 管理人报酬	60,482,518.83	77,216,081.12
2. 托管费	18,328,035.95	23,398,812.39
3. 销售服务费	3,979,975.91	4,937,983.46
4. 交易费用	4,303.48	-
5. 利息支出	29,484,311.43	18,429,275.33
其中:卖出回购金融资产支出	29,484,311.43	18,429,275.33
6. 其他费用	547,355.98	534,902.97
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	718,769,860.30	602,645,965.86
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	718,769,860.30	602,645,965.86

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:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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)	20,862,843,353.35	-	20,862,843,353.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	718,769,860.30	718,769,860.30
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)	6,099,033,588.86	-	6,099,033,588.86
其中:1.基金申购款	139,705,019,910.29	-	139,705,019,910.29
2.基金赎回款	-133,606,986,321.43	-	-133,606,986,321.43
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)	-	-718,769,860.30	-718,769,860.30
五、期末所有者权益(基金净值)	26,961,876,942.21	-	26,961,876,942.21
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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)	39,671,126,603.30	-	39,671,126,603.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	602,645,965.86	602,645,965.86
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)	-18,808,283,249.95	-	-18,808,283,249.95
其中:1.基金申购款	102,562,473,344.16	-	102,562,473,344.16
2.基金赎回款	-121,370,756,594.11	-	-121,370,756,594.11
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)	-	-602,645,965.86	-602,645,965.86
五、期末所有者权益(基金净值)	20,862,843,353.35	-	20,862,843,353.35

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: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、《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2018年3月22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日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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)》、中国证券投资基金协会(以下简称"中国基金业协会")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、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017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2017年12月31日的财务状况以及2017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[2004]78号《财政部、国家税务总局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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前,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。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税 。

(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,应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("工商银行")	基金托管人、基金代销机构
上海光通信公司	基金管理人股东控制的公司
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
国泰君安创新投资有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
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
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理