重要提示 海窩通货币市场证券投资基金 以下简称 本基金" 經中国证券监督管理委员会2004年11月19日出具的 袋于同意海窩通货币市场证券投资基金募集的批复》证监基金字 2004 1945文 批准募集。本基金的基金合同于2005年1月4日正式生效。本基金类型为契约型开放式。 投资有风险 投资者申购本基金附近认真阅读本有得说明书。 基金的过往业绩并不预示其未来表现。 本海要根据基金台丽或设明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金台同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其特有基金份额的行为本身即更用求对基金合同的承认和较多,并获明 截金法,逐作为注》基金合同及其他有关规定享有权利,承担义务。基金投资人创了解基金份缴持有人的权利和义务。应详细查阅基金合同。 基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最限收益。 本招募设明书所载内容截止日为2012年1月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2011年12月31日,财务数据和净值表现表定证计。

法定代表人,邵国有 成立时间:2003年4月18日 电话:021-38650999 联系人:包建 注册资本:1.5亿元 股权结构:海通证券股份有限公司51%,法国巴黎投资管理BE控股公司49%。 C. 上要人员情况 邵国有先生、董事长、副教授。历任吉林大学校党委副书记、长春师范学院校党委书记、长春新世纪广场有限 周副官事长兼总绘理、海通证券股份有限公司宣传培训中心总经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司董 6

董事、副总经理。
郑国汉先生、独立董事、经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学经济系教授及系主任和商学院副院长、现任商学院院长。 系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长、现任商学院院长。 巴罗特 柳亚 Bayot 比生、独立董事、比利明籍、布鲁塞尔大学上的管理硕士、布鲁塞尔大学经济学荣誉教授、 FFAMA 低洲基金和资产管理协会,承比利时基金公会名誉主席,INVESTPROTECT公司、布鲁塞尔、董事总经理、 Pomore投资公司、帐上、都培林、卢森堡 承Degnof资产管理 布鲁塞尔 独立董事、基金联合公会 留本哈根 独立董事。

二、基金托管人为中国银行股份有限公司 简称 中国银行"),基本情况如下:在那及办公地址:北京市西域区复兴门内大街口号 首次注册登记日期:1983年10月31日 变更注册登记日期:1983年10月31日 变更注册登记日期:1983年10月31日 变更注册登记日期:1983年10月31日 变更注册登记日期:1983年10月31日 交更注册登记日,1983年10月31日 安康在代表人,肖 钢 基金杆管业务批准文号。中国证监会证监基字 [1998 ]24 号杆管及投资者服务那总经理;李爱华托管部门信息披露联系人:唐州徽 电话。101 b6594855 传真。101 b6594952 1. 相关服务和均

1. 全部研阅量量金管理有限公司 注册他此:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层 办之他此:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层 法定代表人:邵国有 电话。021-38650999 联系人:康旭 客户服务中心电话:40088-40099 晚长途话费) 电话:021-38650797 传真(021-38530160 2. 代销机0 0 中国银行股份有限公司 地址:北京市西城区复兴门内大街1 号 地话:010-659688 传真:010-66596787 客户服务电话:95566 侧地:www.busc.en

各广版步电记:9506 例批:www.boc.en ()中国建设银行股份有限公司 住所:北京市西坡区金融大街25号 办公地址:北京市西坡区闹市口大街1号院1号楼 注定代表人:王进章 客户服务电话:95533

联系人:张静 例址:www.cch.com ⑥)中国工商银行股份有限公司 地址:北京市西城区复兴门内大街55号 (00032) 注定代表人:麥建清 客户服务电话:95588 电话:610-66107900

5 州尚報行政行相限公司 地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦 法定代表人:傅育宁 客户服务电话:95555 联系人:邓炯鹏

联系人:徐伟·汤嘉惠 阿胜:www.sph.com.cn 11 拼简联评股份有限公司 地址:中国杭州市庆春路28号 法定代表人:张达泽 客户服务电话:95527 联系人:毛夏河 阿胜:www.czbank.com /2 27 按股行股份有限公司 地址:宁波市鄞州区宁南南路700号 法定代表人, 排华終

法定代表人:陆华裕 客户服务电话:96528962528 联系人:胡技勋 阿址:www.nbeb.com.en (13)华夏银行股份有限公司

43 年 录 银 1 成 历 有 限 公 可 地址:北京市东城区建国门内大街22号 法定代表人:吴建 客户服务电话:95577

客户服务电话:021-95553或4008888001 联系人:李笑鸣

联系人: 除还 例址: www.ecitic.com (6) 光大证券股份有限公司 地址: 上海市静安区新闸路1508号 法定代表人: 徐浩明 客户服务电话: 400-8888-788 联系人: 刘晨、沈雯斐

駅ボバースと記 例址:www.csc108.com ① 別 招商证券股份有限公司 地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

地址:福建省福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人:兰荣 客户服务电话:95562 联系人:谢高得

网址:www.hisec.com 05 中信证券股份有限公司 地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层 法定代表人:王东明

担话:010-0010... 专真:010-66107914

客户服务电话:95559 联系人:曹榕

## 海富通货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要

## 基金管理人:海富通基金管理有限公司 基金托管人:中国银行股份有限公司

网址:www.htscom.cn 22 许季联合证券有限责任公司 地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦25、24、10层 法定代表人:马昭明 老子服务电话:400~8888~555.95513 联系人: 證示後 ②3 广 按证券股份有限公司 地址: "州北天河北路183号大都会广场43楼 注定代表人: 王志伟 客户服务电话: 95575或数电各地营业网点 联系人: 黄岚 联系人;黄以 例址:www.gl.com.cn 04)长江证券股份有限公司 地址:或汉市新华路特8号长江证券大厦 达定代表人;胡运钊 客户服务电话:95579.com 9粒:www.95579.com 0地:上海市常熟路17目 达定代表人;丁国荣 是于服务电话:962505 联系人;邓溧冰 例址:www.wcom.cn 版於八: 沙季// 例址: www.swwg.com.cn 66 户镇国际证券有限责任公司 地址:上海市市东银坡中路200号中银大厦39层 注定代表人: 唐新宇 客户服务电话: 400-6208-888 联系人: 张静 联系人: 张静 07 陈方证券股份有限公司 地址上海市中山南路318号2号楼21层-29层 法定代表人,潘鑫军 客户服务电话:95503 联系人,吴宇 网址:www.dfzy.com.en 08 国信证券股份有限公司 地址,深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层到26层 签户服务电话:95536 联系人,齐晓崇 网址:wwg.ugusen.com.en (2) 中国银河证券股份有限公司 地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座 坛定代表人,瞬街国 服务电话:4008-888-888 人:田薇 :0755-83199511 人:张婷 网址:www.esco.com.cn 62)中信金通证券有限责任公司 地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层 B址:初江省机州市浜江区 法定代表人:沈强 客户服务电话:0571-96598 关系人:俞会亮 联系人: 制 完完 例址: www.bigsun.com.cn (3) 中信万通证券有限责任公司 地址: 青岛市场山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层 法定代表人:张智河 客户服务电话: 电话: 0532–96577 联系人: 吴忠超 駅系介: 天志畑 陽址: www.xwt.com.cn (84 床北证券股份有限公司 地址: 长春市自由大路1138号 注定代表人: 終正中 客戸服务电话: 0431-96688 联系人: 潘锴 联於公: 信时 例址:www.nesc.cn 65 斯通正券有限责任公司 地址:杭州市抗大路15号嘉华国际中心 法定代表入;沈继宁 客户服务电话:0571-96336 (上海地区962336) 联系人:养使 联系人:乔俊
例址:www.clsec.com
(6 ) 天相投资期间有限公司
地址:北京市西域区金融街19号富凯大厦B座
法定代表人:林文相
名字服务电话:010-66045678
联系人:莫懿明
例址:www.lssec.com
(6 ) 7 国海证券有限责任公司
地址:广西南宁市滨湖路46号
注定代表人:张雅峰
客字服务电话:96100 (广西),4008888100 俭国)
联系人:武城
例址:www.gbrg.com.cn 68 恒率证券股份有限公司 地址:小蒙古呼和浩特市新城区东风路111号 法定代表》、刘汝军 电话:0471-4961259 联系人:张阳亮 网址:www.enh.com.e 69 屬韓記季有限责任公司 地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层 法定代表》、刘弘 经产服务电话:400~887~8827 联系人:谢亚凡 烟址:www.bssecurities.com 网络大语 型八 网址:www.ubsecurities.com (40)中航证券有限公司 地址: 商昌市红谷海新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼 坛定代表人,杜航 宏阳由注: Appendence 朕系人:陈琳琳 放於人(29年) 例註:www.gyq.com.en (2)總邦证券有限责任公司 住所:上海市福山路500号城建大厦26层 法定代表人:姚文平 客户服务电话:400888128 联系人:罗芳 財素介:9万 例址:www.tebon.com.cm (3) 按源证券股份有限公司 公司注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号 办公地址:北京市西城区太平桥大街19号 法定代表为:冯戎 客户服务电话:400−800−0562 联系入:李巍 脚址:www.bess.com 駅於六:子-5% 网址:www.hysec.com (44) 序鲁证券有限公司 地址:山东省济南市经七路86 号 注定代表人:李玮 答户服务电话:95538 联系人:孙豪志 联系人: 70%定 例此: www.qbzt.com.cn (45 第一创业证券有限责任公司 地址. 深圳市罗颜瓜. 對岗路12号中民时代广场B隆25.26层 法定代表人, 刘学民 家户服务电话: 4008881888 联系人, 魏颢 联系人:魏颖 网班: www.firstcapital.com.cn 伯人 謝財化達寿限责任公司 地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼 法定代表人:林梭波 条户服务市近:400-888-1551 联系人:钟康莺 联於八:計學場場 例此:www.xesc.com 47 按信证券股份有限公司 地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元 注定代表人,:牛冠兴 客户服务电话:400~800~1001 联系人,除%地 联系人: 除週週 侧址: www.essence.com.cn (8 ) 中国中投证券有限责任公司 地址: 深圳市福田区益田路6003号菜超商务中心A栋第18层至21层 法定代表人: 龙增來 客户服务电话: 400-600-8008 联系人: 刘燮 例址: www.cjs.cn (49) 中国国际金融有限公司 地址: 北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层 法定代表人: 孝釗昭 网址:www.cic.com.cn 60 中国民族此券有限责任公司 地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层-9层 法定代表人:敖大建 上:上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层 地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来 注定任表, 陈林 客户服务电话: 4008209898 联系人、刘同川 网址: www.cublasteck.com 62 信适证券股份有限公司 地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 法定代表人:高遊江 张厅市65 400-800-8899 联系人:唐静 似士: www.cublasc.com MyL: www.cindasc.com 63 )长城证券有限责任公司 地址上滚排市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层 法定代表人;黄耀华 户服务电话:4006666888 系人:高峰 联於公: 四畔 64 坊正证券股份有限公司 地址: 湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层 法定代表人:雷杰 宏户服务电话: 95571 联系人: 彭博 例此:www.ghfzq.com.cn 66 協海证券股份有限公司 地址:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室 法定代表人,社庆平

客户服务电话:400-651-5988 联系人:王兆权

がポンパースのは 67 旅業证券有限责任公司 地址: 广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼 法定代表人.游箱雑

网址:www.dgzq.com.cn 68)广州证券有联责任公司 地址:广州市越秀区长观中路69号东山广场主楼17楼 注定代表人;刘陈 客户服务电话.020-961303 联系人:林洁茹 為戶版方电话-400918918 联系人、下級 同)注:www.962518.com 60) 大通证券股份有限公司 地址、大连市沙河口区全展路129号 法定代表人、许宏民 客户服务电话-4008169169 联系人、谢立军 阿趾:www.daton.com.cn 61》 江海证券有限公司 地址。哈介该市告初区赣水路56号 法定代表人、孙名扬 客户服务电话—400—666—2288 联系人,郭岭 附上,www.jhzq.com.cn 62》 以西证券股份有限公司 地址:水原市府西省69号山西国际贸易中心东塔楼 法定代表人、保赖 客户服务电话—400—666—1618 联系人,张志国 00/高品品,并依该压力可能。 地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层 法定代表人:常喆 服务电话:400-818-8118 人:黄静 网址:www.guodu.com 64 冻兴证券有限责任公司 地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层 法定代表人:崔海涛 客户服务电话:4008-888-993 关系人:黄英 网址:www.dz.q.net 65 欺當证券有限责任公司 地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼 法定代表人:周晖 与真:0731-84403330 联於八:不及且 例此:www.cfzq.com 66 民生证券有限责任公司 地址:北京市本版公建国门内大街28号民生金融中心A层 法定代表人:丘献泰 客户服务电话:4006198888 联系人:赵明 即44.1. 研究公式。2009 例址:http://www.mszq.com 67)华龙证券有限责任公司 地址:甘肃省兰州市东岗西路638号 建定代表人;李晓安 客户服务电话:4006898888 联系人;李昕田 財政人:子可田 例批: http://www.hlzigs.com 68 英大证券有限责任公司 地址:深则市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层 法定代表/: 赵文安 签户服务电话: 4008698698 联系人: 土營 联系人:王睿 网址:http://www.yds.com.cn 69.中山证券有限责任公司 地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层 法定代表人:吴永良 客户服务申证: 4001022011 联系人:李珍 随址... 联系人: 李珍 例此:www.zszq.com 70 紅塔证券股份有限公司 地址:云南省B用市北京路155号附一号红塔大厦9楼 注定代表人:祝厨林 家户服务电话:0871 - 3577888 联系人:沈晚明 联系人;20晚明 01)日信证券有限责任公司 地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号 法定代表人:孔伍东 客户服务电话 620 联系人;冯杰 联系人:23年 University (1995年) 1995 (1995年) 199 联条人: 宋萍萍 联系电话: 0755-82125533 经办律师: 新庆军、宋萍萍 四 审计基金财产的会计师事务所 普华永道中天会计师事务所有限公司 注册,地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 办之地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 经办注册会计师: 注模 金穀 电话: 021) 23338888 。 第富通货币市场证券投资基金 五、基金类型 :在力争本金安全和资产充分流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的收益。 1. 決策依据
 (1) 投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定:
 (2) 投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比:
 (6) 投资部策略分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告,为投资策略提供依据。 2. 决策程序
① 整体配置策略
根据宏观经济指标 住 要包括:利率水平、通货膨胀率、CDP增长率、货币供应量、就业率水平、国际市场利率
水平、汇率),决定债券组合的剩余期限、6、4户规 和比例分布。
根据各类资产的流动性释住 任要包括:平均日交易量 交易场所,机构投资者持有情况、回则抵押数量、分拆
转换进程),决定组合中各类资产的投资比例。
根据债券的信用等级及担保状况、决定组合的风险级别。
② 涂别资产配置策略
根据整体策略要求、决定组合中类别资产的配置的容和各类别投资的比例。
根据不同类别资产的流动性指标。C级市场存量、二级市场流量、分类资产日均成交量、近期成交量、近期变
对量、交易场所)决定类别资产的场上增长。一级市场流量、分类资产日均成交量、近期或交量、近期变
根据不同类别资产的流动性指标。C级市场存量、二级市场流量、分类资产日均成交量、近期或交量、近期变
积据不同类别资产的流速率水平。倒购收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理。附加选择权价值、类别资产的基础是数量产,认为偏联。法律法规对基金投资的规定、基金合同、基金收益目标、业绩比较基准等决定不同类
别资产的目标配置比率。 5 用注收价"配置策略 第一步筛选,根据即细充产的剩余期限。资信等级、流动性指标、能通总量、日均交易量),决定是否纳入组合。 第二步筛选、根据针别情等的收益率。倒期收益率,票面利率、利息支付方式、利息税务处理,与剩余期限的配 ;据基金的收益要求决定是否纳入组合。 第二步筛选,根据分别债券的流动性指标。 使行总量、流通量、上市时间),决定投资总量。 3、投资管理力法 第三步筛选,根据个别债券的流动性指标 使行息量、流通量、上市时间),决定投资总量。
3. 投资管理方法
0 短期利率水平列期鞠贴
深入分析国家货币政策。短期资金市场利率波动、资本市场资金面的情况和流动性的变化,对短期利率走势
形成合理预期,并据此调整基金货币资产的配置策略。
① 收益率曲线分析警略
根期收益率曲线的变化趋势。采取相应的投资管理策略、货币市场收益率曲线的形状反映当时短期利率水平
之间的关系。反映市场对转短期限经济状态的判断及对未来短期经济走势的预期。
6 组合确余则限强筋。则限配置策略。
通过对组合资产剩余期限的设计,最紧。调整、达到保持合理的现金流、锁定组合剩余期限,以满足可能的、突
该现金需求、同时保持组合的危湿收益、特别还债券投资中,根据收益率曲线的情况、投资一定剩余期限的品种、稳定收益、锁定规险、满足组合目标期限。
4 奖别品种配置策略。在保持组合资产相对稳定的条件下,根据各类短期金融工具的市场规模,收益性和流动性,决定各类资产的 在联出合产相对稳定的条件下,根据各类短期金融工具的市场规模,收益性和流动性,决定各类资产的配置比例。6 游元性管理策略
在保持组合资产相对稳定的条件下,根据各类短期金融工度的市场规模,收益性和流动性,决定各类资产的 6 济动性管理策略
6 法风速处理人里以集他措施1 定保持基金资产高流动性的前提下,通过基金资产支排。包括现金库产资产变现、剩余期限管理或以其他措施1 定保持基金资产高流动性的前提下,确保基金的稳定收益。

|              | 章利策略包括:   |  |                  |                                     |  |
|--------------|---|--|------------------|-------------------------------------|--|
|              | 查利策略:根据各细分短期金融工具的流运   | 动性和收益特征,动态i  | 周整基金资            | 资产在各个细分市场之间的                        |  |
| 配置比例。        | L-2-7-188-00 49-49-49 (11-17-17-17-17-17-17-17-17-17-17-17-17-1 | OF PA 46 MAL NOT LIVE AT AME   | Total Co. Market |                                     |  |
| 跨品科<br>品种的配置 | 中套利策略:根据各细分市场中不同品种的』  | XI险参数、流动性补偿  | 和収益特             | 止,                                  |  |
|              | 动配置策略   |  |                  |                                     |  |
|              | 体投资品种的市场特性,采用持续滚动投资   | 资的方法,以提高基金   | 5产的整体            | k持续的变现能力。                           |  |
|              | 金的业绩比较标准  | total Tilda  |                  |                                     |  |
|              | è的业绩比较基准为,税后一年期银行定期7<br>目的市场化利率基准推出的情况下,本基金                     |  | こまのもれ 次と台        | 2my 1540分元亩川海山公士                    |  |
| 住.并及时        |   | 自  | WHIZDA           | 观时, 明足文文业坝以7000                     |  |
|              | ★管理人认为,业绩的选择标准需要合理、透  | 明,为广大投资者所接   | 受。本业             | 绩基准是投资者最熟知、最                        |  |
|              | 的低风险收益率。  |  |                  |                                     |  |
|              | 金的风险收益特征  | ΛΠ 144 + 1+75 Hα 1/1 I/Λ 1/α   | 725 110116-34-   | かかけて肌而 (本を10日)                      |  |
| 平贝川<br>基金。   | f市场基金是具有较低风险、流动性强的基金。   | 志品种,共测期风险和   | ]则别収益:           | 半卸瓜丁収录, 贝芬和俄日                       |  |
|              | 基金的投资组合报告   |  |                  |                                     |  |
|              | 理人的董事会及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                        |  |
|              | 性和完整性承担个别及连带责任。   |  |                  | Line Line Land                      |  |
|              | 任管人中国银行股份有限公司根据本基金合<br>日组合报告等内容,保证复核内容不存在虚例                     |  |                  |                                     |  |
|              | 3组合报告专内各,床证复核内各个存住底。<br>3组合报告所载数据为截至2011年12月31日                 |  |                  |                                     |  |
| t.           | (3EG1KG1/1489K3G75 BKIL2011   12/151 H                          | (1001/9//0 /47-10  | XADD ( TOD       | CI I MIZIMIZI MARINGET              |  |
| 1、报告         | ·期末基金资产组合情况   |  |                  |                                     |  |
| 序号           | 项目  | 金額 (元)   |                  | 占基金总资产的比例 6%)                       |  |
| 1            | 固定收益投资  | 1,326,   | 827,910.17       | 44.44                               |  |
|              | 其中:债券   | 1,326,   | 827,910.17       | 44.44                               |  |
|              | 资产支持证券  | -  |                  | -                                   |  |
| 2            | 买人返售金融资产  | 50,  | 440,195.66       | 5.66 1.6                            |  |
|              | 其中:买断式回购的买人返售金融资产   |  | _                | _                                   |  |
| 3            | 银行存款和结算备付金合计  | 1.578.0  | 600,915.60       | 52.87                               |  |
| 4            | 其他各项资产  |  | 989,648.37       | 1.00                                |  |
| 5            | 合计  | -  | 2,985,858,669.80 |                                     |  |
| -            | ·期债券回购融资情况  | 2,703,   | 3,70,007.00      | 100.00                              |  |
| 序号           | 1771000 日本地域 11700  | 占基   | 金资产净值            | iH:(9) (%)                          |  |
|              | 报告期内债券回购融资余额  |  |                  | 4.28                                |  |
| 1            | 其中:买断式问购融资  |  |                  | 1.20                                |  |
| 序号           | 共十:天朝八巴鸠融页<br>项目  | 金額   | - 1              | -<br>占基金资产净值的比例 % )                 |  |
| 17.4         |   | 322.034  |                  | 口盔並贝) (尹国的比例 %)                     |  |
| 2            | 报告期末债券回购融资余额  |  | -                | -                                   |  |
| 5 V D        | 其中:买断式回购融资  | A COLUMN TO THE RESIDENCE OF THE SECOND TO T | - A AH A- A- A-  | -17 -1-18 17 -71 1/4 / 1/27 1 -14 / |  |
|              | 设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   | 个银行间引            | 可场交易日融资余额占基金                        |  |
|              | 三回购的资金余额超过基金资产净值的20%  | 的说明  |                  |                                     |  |
| 在本报          | 2告期内本货币市场基金债券正回购的资金   |  | 付20%。            |                                     |  |
|              | 投资组合平均剩余期限  |  |                  |                                     |  |
| (1) 投        | · 资组合平均剩余期限基本情况   |  |                  | and the                             |  |
|              | 项目  |  |                  | 天数                                  |  |
| 报告期末         | 投资组合平均剩余期限  |  |                  | 66                                  |  |

报告期内投资组合平均剩余期限最低值

2)报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限               | 各期限贷产占基金资产净值的比<br>例 %) | 各期限负债占基金资产净值<br>的比例 %) |
|----|----------------------|------------------------|------------------------|
| 1  | 30天以内                | 18.22                  |                        |
|    | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 5.46                   |                        |
| 2  | 30天 含 )—60天          | 37.31                  |                        |
|    | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 2.63                   |                        |
| 3  | 60天 含 )—90天          | 17.84                  |                        |
|    | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                      |                        |
| 4  | 90天 含 )—180天         | 25.46                  |                        |
|    | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 6.93                   |                        |
| 5  | 180天 含 )—397天 含 )    | 0.67                   |                        |
|    | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                      |                        |
|    | 合计                   | 99.50                  |                        |

| 序号  | 债券品种               | 摊余成本 (元)         | 占基金资产净值比例<br>%) |
|-----|--------------------|------------------|-----------------|
| 1   | 国家债券               | -                | -               |
| 2   | 央行票据               | -                | -               |
| 3   | 金融债券               | 149,954,353.79   | 5.05            |
|     | 其中:政策性金融债          | 149,954,353.79   | 5.05            |
| 4   | 企业债券               | 446,326,830.52   | 15.02           |
| 5   | 企业短期融资券            | 730,546,725.86   | 24.59           |
| 6   | 中期票据               | -                |                 |
| 7   | 其他                 | -                | -               |
| 8   | 合计                 | 1,326,827,910.17 | 44.66           |
| 9   | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 446,326,830.52   | 15.02           |
| 5.ł | 设告期末按摊余成本占基金资产净值比例 | 引大小排名的前十名债券投资明   | 细               |
|     |                    |                  |                 |

| 序号 | 债券代码    | 债券名称      | 债券数量<br>(张) | 摊余成本 (元)       | 占基金资产净值<br>比例 %) |
|----|---------|-----------|-------------|----------------|------------------|
| 1  | 058031  | 05中信债1    | 1,800,000   | 176,800,430.69 | 5.95             |
| 2  | 0980147 | 09中航工债浮   | 1,600,000   | 162,111,680.80 | 5.46             |
| 3  | 1181252 | 11浙商集CP01 | 1,500,000   | 150,110,644.03 | 5.05             |
| 4  | 110222  | 11国开22    | 1,500,000   | 149,954,353.79 | 5.05             |
| 5  | 1181084 | 11浙小商CP01 | 1,000,000   | 100,039,197.42 | 3.37             |
| 6  | 1181249 | 11神火CP01  | 800,000     | 80,062,596.00  | 2.70             |
| 7  | 068007  | 06首都机场债   | 800,000     | 78,234,628.91  | 2.63             |
| 8  | 1181067 | 11悦达CP01  | 700,000     | 70,044,199.41  | 2.36             |
| 9  | 1181054 | 11海航商CP01 | 600,000     | 60,041,279.40  | 2.02             |
| 10 | 1181070 | 11玉柴CP01  | 500,000     | 50,034,345.95  | 1.68             |

| 6、形寸疋川 与 推示以平法 明正的基金页厂伊恒的偏离   |              |
|-------------------------------|--------------|
| 项目                            | 偏离情况         |
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25 焓 )-0.5%间的次数 | 0次           |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.1463%      |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.1200%     |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0830%      |
| 7、报告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 |

即估值对象以买人成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买人时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率 法进行摊销。每日计据收益。 2)本格步期内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 金资产净值的20%的情况。 6)本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公 开谴责,处罚的情形。

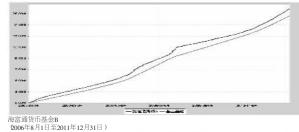
29,989,048.3 5 其他应收款 6 待摊费用

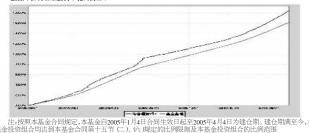
F一、基金的业域 基金业绩截止日为2011年12月31日。 基金管理人依照恪尽职守,诚实信用,谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保 职收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的 1、历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较: 海富通货币基金A

| 阶段                  | 净值增长率<br>(1) | 净值增长率标<br>准差 2) | 业绩比较基准收<br>益率 (3 ) | 业绩比较基准标<br>准差 (4) | (1 )= (3 ) | (2)-(4) |
|---------------------|--------------|-----------------|--------------------|-------------------|------------|---------|
| 2005.1.4-2005.12.31 | 2.4894%      | 0.0070%         | 1.7852%            | 0.0000%           | 0.7042%    | 0.0070% |
| 2006.1.1-2006.12.31 | 1.9236%      | 0.0040%         | 1.8797%            | 0.0003%           | 0.0439%    | 0.0037% |
| 2007.1.1-2007.12.31 | 3.4972%      | 0.0090%         | 2.7827%            | 0.0018%           | 0.7145%    | 0.0072% |
| 2008.1.1-2008.12.31 | 4.1075%      | 0.0134%         | 3.7717%            | 0.0012%           | 0.3358%    | 0.0122% |
| 2009.1.1-2009.12.31 | 1.6104%      | 0.0053%         | 2.2500%            | 0.0000%           | -0.6396%   | 0.0053% |
| 2010.1.1-2010.12.31 | 1.9003%      | 0.0043%         | 2.3040%            | 0.0003%           | -0.4037%   | 0.0040% |
| 2011.1.1-2011.12.31 | 3.9368%      | 0.0037%         | 3.2798%            | 0.0007%           | 0.6570%    | 0.0030% |
| 2005.1.4-2011.12.31 | 21.1289%     | 0.0079%         | 19.4931%           | 0.0020%           | 1.6358%    | 0.0059% |
| 海富通货币基金B            |              |                 |                    |                   |            |         |
|                     | ななははとか       | 公は地と今に          | 川が寒口がたせる中は         | ルがましただけがた         |            |         |

| 阶段  | 净值增长率<br>(1) | 净值增长率标<br>准差 2) | 业绩比较基准收<br>益率 (3 ) | 业绩比较基准标<br>准差 (4) | (1 )- (3 ) | (2)-(4) |  |
|---|--------------|-----------------|--------------------|-------------------|------------|---------|--|
| 2006.8.1-2006.12.31   | 0.9344%      | 0.0036%         | 0.8296%            | 0.0002%           | 0.1048%    | 0.0034% |  |
| 2007.1.1-2007.12.31   | 3.7454%      | 0.0090%         | 2.7827%            | 0.0018%           | 0.9627%    | 0.0072% |  |
| 2008.1.1-2008.12.31   | 4.3553%      | 0.0134%         | 3.7717%            | 0.0012%           | 0.5836%    | 0.0122% |  |
| 2009.1.1-2009.12.31   | 1.8551%      | 0.0053%         | 2.2500%            | 0.0000%           | -0.3949%   | 0.0053% |  |
| 2010.1.1-2010.12.31   | 2.1453%      | 0.0043%         | 2.3040%            | 0.0003%           | -0.1587%   | 0.0040% |  |
| 2011.1.1-2011.12.31   | 4.1859%      | 0.0037%         | 3.2798%            | 0.0007%           | 0.9061%    | 0.0030% |  |
| 2006.8.1-2011.12.31   | 18.4494%     | 0.0082%         | 16.1873%           | 0.0019%           | 2.2621%    | 0.0063% |  |
| 注:本基金收益分配按月结转份额。<br>2. 自基金会同生效以来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。 |              |                 |                    |                   |            |         |  |

海富通货币基金A 2005年1月4日至2011年12月31日)





十三.基金的费用和税收

EANIN - I MAXXXX TOMPINI THE RY的级基金价额的销售服务费率 基金管理人可以调整对各级基金份额计提的销售服务费率,但销售服务费年费率最高不超过0.25%。基金管

基金管理人以问题对各效基金扩稠订强的销售服务预单,证明情服务预单对单项尚不知识0.25%。基金管理人则从资本开始调整之目的3个工作口之前至少在一种中国证金净性的媒体工刊第公告并採中国运会备案。基金销售服务费每日计算,每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费支付指令、基金销售服务费每日计算,每日计提,按月支付,由基金资产中一次性直接支付给基金销售机构,若遇法定节假日,休息日等,支付日期顺延。
3. 其他费用 按照国家有关规定可以列人的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。
C. )不列人基金费用的项目

一中列文。 (E)基金管理费、基金托管费、转换费、基金销售服务费的调整 — № № 日本以《西亚》LB B 以 470 区、 经实用指版及为证的问题是 基金管理人和基金化管人可协商的请询底基金管理费 基金化管费,无须召开基金份额持有人大会。基金管 理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。 基金管理人必须最迟一新的费率实施日前3个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。 李实施日前3个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

2.更新了余毓紫先生的简历;
3.更新了张丽洁女士的简历;
3.更新了报资决策委员会常设委员信息。
C. )第四节 基金社管人"部分,更新了基金社管人基本情况和证券投资基金托管情况。
E. )第四节 相关服务机构"部分:
1.直销机构;更新了直销机构的银汞人信息;
2.代制制机构;对部分代销机构的相实信息进行了更新;
3.注册验记人;更新了会计师事务所的办公地址及验功注册会计师信息。
CD )第十一节 基金的投资"和 第十二节 基金的业绩"部分;
根据2011年第四季度报告,更新了基金投资组合报告和基金业绩的内容,相关数据截止期为2011年12月31