海富通货币市场证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011年 12 月 31 日

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
报告送出日期:二〇一二年三月二十九日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年3月28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。

本报告中的财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

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	海富通货币	
基金主代码	519505	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年1月4日	
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	
报告期末基金份额总额	2,970,685,377.29份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通货币A	海富通货币B
下属分级基金的交易代码	519505	519506
报告期末下属分级基金的份额总额	759,029,037.90份	2,211,656,339.39份

2.2 基金产品说明

投资目标	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。
投资策略	根据宏观经济指标(主要包括:利率水平、通货膨胀率、GDP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(长/中/短)和比例分布。根据各类资产的流动性特征(主要包括:平均日交易量、交易场所、机构投资者持有情况、回购抵押数量、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。
业绩比较基准	税后一年期银行定期存款利率
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、流动性强的证券投资基金品种。

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		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	唐州徽
	联系电话	021-38650891	010-66594855
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942

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	http://www.hftfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

§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	
	海富通货币A	海富通货币B	海富通货币A	海富通货币B	海富通货币A	海富通货币B
本期已实现收益	34,804,497.93	153,108,586.07	11,973,783.61	107,453,939.84	33,853,209.92	110,329,038.11
本期利润	34,804,497.93	153,108,586.07	11,973,783.61	107,453,939.84	33,853,209.92	110,329,038.11
本期基金份额净值收益率	3.9368%	4.1859%	1.9003%	2.1453%	1.6104%	1.8551%
3.1.2期末数据和指标	2011年末		2010年末		2009年末	
	海富通货币A	海富通货币B	海富通货币A	海富通货币B	海富通货币A	海富通货币B
期末基金资产净值	759,029,037.90	2,211,656,339.39	814,445,461.42	5,684,604,758.46	1,596,278,321.05	9,538,218,732.49
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000

注:1、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。

2、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

3、本基金收益分配是按月结转份额。

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. 海富通货币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	1.1136%	0.0029%	0.8709%	0.0000%	0.2427%	0.0029%
过去六个月	2.1688%	0.0024%	1.7453%	0.0001%	0.4235%	0.0023%
过去一年	3.9368%	0.0037%	3.2798%	0.0007%	0.6570%	0.0030%
过去三年	7.6176%	0.0053%	8.0368%	0.0013%	-0.4192%	0.0040%
过去五年	15.9562%	0.0085%	15.2314%	0.0019%	0.7248%	0.0066%
自基金合同生效起至今	21.1289%	0.0079%	19.4931%	0.0020%	1.6358%	0.0059%

2. 海富通货币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	1.1748%	0.0029%	0.8709%	0.0000%	0.3039%	0.0029%
过去六个月	2.2920%	0.0024%	1.7453%	0.0001%	0.5467%	0.0023%
过去一年	4.1859%	0.0037%	3.2798%	0.0007%	0.9061%	0.0030%
过去三年	8.3953%	0.0053%	8.0368%	0.0013%	0.3585%	0.0040%
过去五年	17.3529%	0.0085%	15.2314%	0.0019%	2.1215%	0.0066%
自基金合同生效起至今	18.4494%	0.0082%	16.1873%	0.0019%	2.2621%	0.0063%

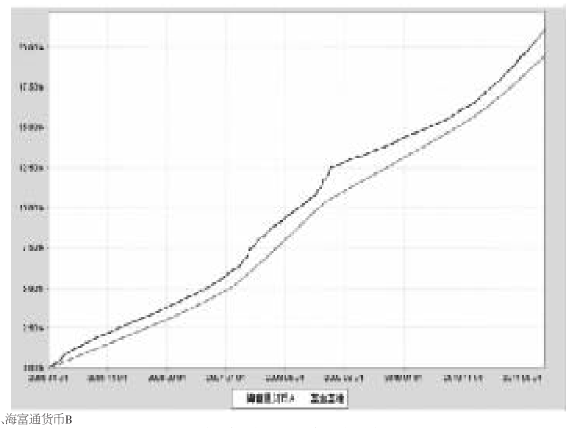
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通货币市场证券投资基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

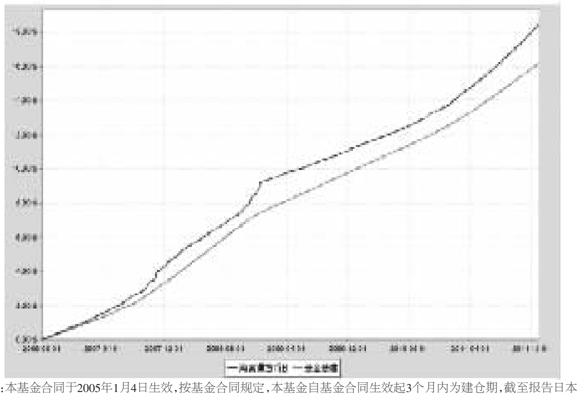
1、海富通货币A

(2005年1月4日至2011年12月31日)



2、海富通货币B

(2006年8月1日至2011年12月31日)



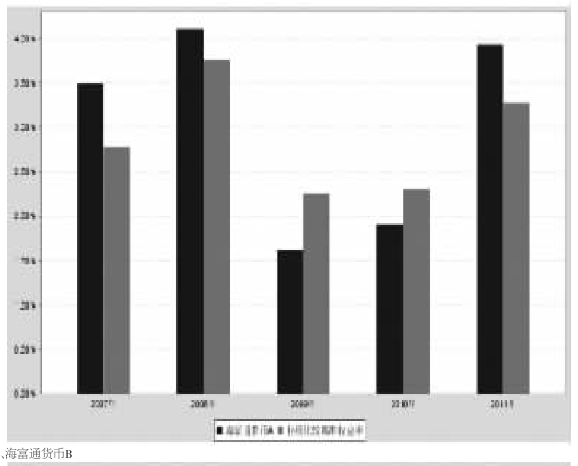
注:本基金合同于2005年1月4日生效,按基金合同规定,本基金自基金合同生效起3个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十五条(二)投资范围、(六)投资组合中规定的各项比例。

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

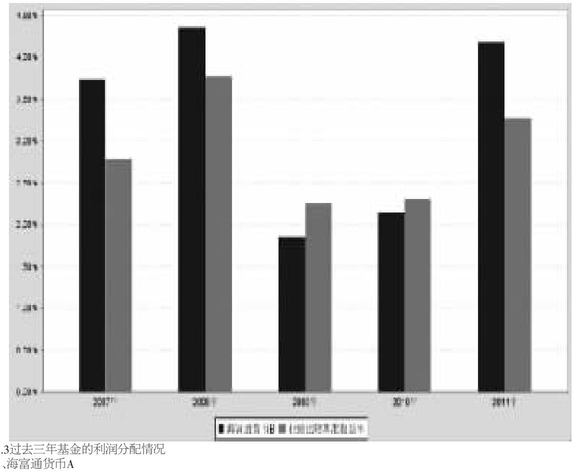
海富通货币市场证券投资基金

基金净值收益率与业绩比较基准历史收益率的对比图

1、海富通货币A



2、海富通货币B



3.3过去三年基金的利润分配情况

1、海富通货币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	26,632,181.04	7,421,573.26	750,743.63	34,804,497.93	-
2010年	10,352,722.35	1,951,656.19	-330,594.93	11,973,783.61	-
2009年	34,487,234.38	8,509,790.26	-9,143,814.72	33,853,209.92	-
合计	71,472,137.77	17,883,019.71	-8,723,666.02	80,631,491.46	-

2、海富通货币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	128,099,808.98	25,364,024.04	-355,246.95	153,108,586.07	-
2010年	91,594,530.21	15,723,614.89	135,794.74	107,453,939.84	-
2009年	113,443,897.89	19,371,272.24	-22,486,132.02	110,329,038.11	-
合计	333,138,237.08	60,458,911.17	-22,705,584.23	370,891,564.02	-

注:本基金每日计算投资人账户当日所产生的收益,每月将投资人账户累计的收益结转为基金份额,计入该投资人账户的基金份额中。

§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

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48号文批准,由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司(现更名为"法国巴黎投资管理BE控股公司")于2003年4月1日共同发起设立。本海富通货币市场证券投资基金是基金管理人管理的第三只公募基金;除本基金外,基金管理人目前还管理着海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通股票证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势股票型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选股票型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长股票型证券投资基金、海富通中证100指数证券投资基金(LOF)、海富通中小盘股票型证券投资基金、上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选股票型证券投资基金、上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳进增利分级债券型证券投资基金和海富通国策导向股票型证券投资基金十九只公募基金。

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		
张丽洁	本基金的基金经理;海富通稳进增利分级债券基金基金经理	2008-02-14	-	9年	经济学硕士学位,2002年7月至2004年7月就职于南京银行股份有限公司,从事债券交易工作,2004年8月加入海富通基金管理有限公司,任助理固定收益分析师、组合经理,2008年2月起任海富通货币基金基金经理。2011年9月起兼任海富通稳进增利分级债券基金基金经理。

注:1、对基金的首任基金经理,其任职日期指基金合同生效日,离任日期指公司做出决定之日;非首任基金经理,其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准:自参加证券行业的相关工作开始计算。

3、张丽洁女士自2011年12月15日开始休假。张丽洁女士休假期间,我公司基金经理邵佳民先生暂代管理本基金。该事项2011年12月12日已在指定媒体公开披露。

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,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

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

公司自成立以来,就建立了公平交易制度,并通过系统控制和事前、事中、事后的监控确保公平交易制度的执行。本报告期,公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求,对公司的公平交易制度进行了更新,完善现有的业务流程,改进了公平交易监控系统,进行定期监控,以切实保护投资者的合法权益。

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

根据本基金合同,公司旗下无投资风格与本基金相似的其他基金。

4.3.3异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2011年,货币政策转向紧缩,全年上调存款基准利率三次,一年期存款利率从2.75%上升到3.5%;上调存款准备金六次,从年初大型金融机构的18.5%加到6月的21.5%。经济增长呈现回落态势,全年GDP增长9.2%。

从政府关心的目标看,上半年集中于通货膨胀,而下半年则更关心经济增长。上半年物价没有出现所预期的回落,反而连创新高,给债券市场和权益市场以很大的压力。CPI从一月份的4.9%上升到七月份的6.5%,下半年则出现回落。物价缓解以后,政府逐步把经济增长放在优先位置,货币政策逐步放松。12月下调存款准备金0.5个百分点,宣告货币政策正式转向。

受上述因素,以及国际市场的影响,上半年债券市场在短暂冲高后,出现较大幅度的调整,其中又以城投债等信用等级较低的债券受累最大。三季度受到资金面持续紧张的影响,债券收益率继续上升,城投债收益率一度达到15%。短期利率与长期利率的差距不大,收益率曲线相对扁平。四季度开始随着物价指数的回落和货币政策的放松,债券市场出现恢复性上涨行情,但收益率并未回到年初的水平。

由于全年资金面总体处于紧张状态,因此银行存款和回购的收益率趋于上升,给货币基金带来了较好的机会。基金管理人根据流动性管理的需要,投资了较大比例的银行存款和债券回购,提高了收益水平。短期融资券上半年以追求收益为主,下半年则随着高信用等级收益率的提高,着重投资高信用等级的短期融资券,以提高资产的流动性。浮动利率债券虽然有较好的持有收益,但考虑到市场价格的波动率较大,不适合货币基金作为重点投资的对象,逐步减持。在报告期内,本基金还投资于可提前支取、利率不变的定期存款,根据流动性管理的需要,本基金提前结束多笔存款合约,该投资行为不存在任何利息损失。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通货币A类基金净值收益率为3.9368%,同期业绩比较基准收益率为3.2798%;海富通货币B类基金净值收益率为4.1859%,同期业绩比较基准收益率为3.2798%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金认为,2012年债券市场相对乐观,但需要把握收益率起伏和资金面变化带来的机会。大的可能是,2012年开始正式进入了一个新的经济周期:经济增长率回落,而通货膨胀处于中等的水平,对债券市场的影响始终存在。货币政策总体上保持"微调"格局,在保增长与防通货膨胀之间不同时期有不同的侧重。利率品种的机会已经不大,信用品种则需要精耕细作。2012年下半年起高收益信用品种有可能出现收益率下降的机会。基金管理人的投资策略是:以流动性管理为中心,精心挖掘信用利差和收益率曲线变化带来的机会,积极投资银行存款和回购。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值委员会,委员会成员具有3年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能,并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组。估值工作小组充分听取相关部门的建议,并和相关托管人充分协商后,向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告,以便估值委员会决策。

估值政策经估值委员会审阅同意,并经本公司总裁办公会批准后实施。

基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。除了投资总监外,其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员,不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种,基金经理可以向估值工作小组提供估值建议。上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、本基金本报告期内应分配:货币A级34,804,497.93元,货币B级153,108,586.07元。

二、已实施的利润分配:货币A级已分配33,424,003.59元,货币B级已分配148,940,471.41元。

三、应分配但尚未实施的利润:已分配但未支付的5,548,609.00元。应于收益支付日2012年1月16日按1.00元的份额面值结转为基金份额。

§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,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对海富通货币市场基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。本基金本报告期内提前支取定期存款,根据约定,提前支取利率不变,提前支取未造成利息损失。

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

本报告中的财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了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:海富通货币市场证券投资基金

报告截止日:2011年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	1,578,600,915.60	1,925,087,253.56
结算备付金		-	1,365,909.09
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,326,827,910.17	2,482,727,563.97
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,326,827,910.17	2,482,727,563.97
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	50,440,195.66	2,122,912,129.35
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	29,989,048.37	20,912,541.30
应收股利		-	-
应收申购款		600.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,985,858,669.80	6,553,005,397.27
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		6,864,913.98	45,383,609.39
应付管理人报酬		863,710.11	1,367,214.34
应付托管费		261,730.33	414,307.36
应付销售服务费		208,316.27	151,863.15
应付交易费用	7.4.7.7	23,712.82	75,920.68
应交税费		988,000.00	988,000.00
应付利息		-	-
应付利润		5,548,609.00	5,153,112.32
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	414,300.00	421,150.15
负债合计		15,173,292.51	53,955,177.39
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,970,685,377.29	6,499,050,219.88
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,970,685,377.29	6,499,050,219.88
负债和所有者权益总计		2,985,858,669.80	6,553,005,397.27

注:报告截止日2011年12月31日,基金份额净值1.000元,基金份额总额2,970,685,377.29份,其中A级基金份额759,029,037.90份,其中B级基金份额2,211,656,339.39份。

7.2 利润表

会计主体:海富通货币市场证券投资基金

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	附注号	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		215,592,869.09	151,311,219.56
1.利息收入		210,258,281.39	138,255,923.42
其中:存款利息收入	7.4.7.11	69,743,713.41	40,409,503.86
债券利息收入		74,677,959.82	74,760,109.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		65,836,608.16	23,086,310.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		5,334,587.70	13,055,296.14
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	5,334,587.70	13,055,296.14
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	-	-
减:二、费用		27,679,785.09	31,883,496.11
1.管理人报酬		15,708,086.75	18,957,349.88
2.托管费		4,760,026.37	5,744,651.54
3.销售服务费		2,641,394.70	2,180,562.70
4.交易费用	7.4.7.18	-	-
5.利息支出		4,076,727.44	4,444,155.07
其中:卖出回购金融资产支出		4,076,727.44	4,444,155.07
6.其他费用	7.4.7.19	493,549.83	556,776.92
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		187,913,084.00	119,427,723.45
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列		187,913,084.00	119,427,723.45

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通货币市场证券投资基金

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)	6,499,050,219.88	-	6,499,050,219.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	187,913,084.00	187,913,084.00
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)	-3,528,364,842.59	-	-3,528,364,842.59
其中:1.基金申购款	29,515,187,685.77	-	29,515,187,685.77
2.基金赎回款	-33,043,552,528.36	-	-33,043,552,528.36
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)	-	-187,913,084.00	-187,913,084.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,970,685,377.29	-	2,970,685,377.29

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)	11,134,497,053.54	-	11,134,497,053.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	119,427,723.45	119,427,723.45
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)	-4,635,446,833.66	-	-4,635,446,833.66
其中:1.基金申购款	24,176,115,459.65	-	24,176,115,459.65
2.基金赎回款	-28,811,562,293.31	-	-28,811,562,293.31
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)	-	-119,427,723.45	-119,427,723.45
五、期末所有者权益(基金净值)	6,499,050,219.88	-	6,499,050,219.88

报表附注为财务报表的组成部分

本报告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:田仁灿,主管会计工作负责人:阎小庆,会计机构负责人:高勇前

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

海富通货币市场证券投资基金(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[2004]第194号《关于同意海富通货币市场证券投资基金设立的批复》核准,由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通货币市场证券投资基金基金合同》负责公开募集。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964,227,474.56元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2004)第236号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通货币市场证券投资基金基金合同》于2005年1月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为964,512,079.20份基金份额,其中认购资金利息折合284,604.64份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《海富通货币市场证券投资基金基金合同》和《海富通货币市场证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,自2006年8月1日起,本基金将基金份额分为不同的类别,适用不同的销售服务费率,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《海富通货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金;一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券;期限在一年以内(含一年)的债券回购;期限在一年以内(含一年)的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为税后一年期银行定期存款利率。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于2012年3月29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》、《海富通货币市场证券投资基金基金合同》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2011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

本基金报告期内不存在会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金报告期内不存在重大会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金报告期内不存在重大会计差错。

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》及其他相关税务法规和实务操作,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
海富通基金管理有限公司("海富通")	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司("海通证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
法国巴黎投资管理BE控股公司(BNP Paribas Investment Partners BE Holding)	基金管理人的股东

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
海通证券	10,903,800,000.00	100.00%	7,799,800,000.00	100.00%

7.4.8.1.4应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	119,941.80	100.00%	3,850.00	100.00%

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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	85,797.80	100.00%	34,047.20	100.00%

注:该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	15,708,086.75	18,957,349.88
其中:支付销售机构的客户维护费	1,942,638.47	1,626,780.00

注:支付基金管理人海富通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	4,760,026.37	5,744,651.54

注:支付基金托管人中国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		
	海富通货币A	海富通货币B	合计
中国银行	360,033.44	15,350.49	375,383.93
海通证券	38,150.81	1,917.70	40,068.51
海富通基金	117,754.72	269,261.99	387,016.71
合计	515,938.97	286,530.18	802,469.15

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		
	海富通货币A	海富通货币B	合计
中国银行	387,807.21	11,963.99	399,771.20
海通证券	10,593.60	1,867.47	12,461.07
海富通基金	91,130.12	409,361.06	500,491.18
合计	489,530.93	423,192.52	912,723.45

注:支付基金销售机构的A级基金份额和B级基金份额的销售服务费分别按前一日该类基金资产净值0.25%和0.01%的年费率计提。其计算公式为:

日销售服务费=前一日基金资产净值 X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 2011年1月1日至2011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
中国银行	-	-	100,000,000.00	381,921.78	1,658,900,000.00	207,786.57

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日					
	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
中国银行	234,230,841.37	-	-	-	1,822,000,000.00	89,654.83

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

本期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本期及上年度末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-定期存款	-	-	-	1,577,000.00
中国银行-活期存款	28,600,915.60	938,649.50	125,087,253.56	6,174,362.26

注:本基金的活期银行存款及部分定期银行存款由基金托管人中国银行保管,按约定利率计息。于2011年12月31日,本基金存放于中国银行的银行存款占基金资产净值的比例为0.96%(2010年12月31日:1.92%)。

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.9期末(2011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

本基金在本报告期内未因新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

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)各层次金融工具公允价值

于2011年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为1,326,827,910.17元,无属于第一层级和第三层级的余额(2010年12月31日:第二层级2,482,727,563.97元,无第一层级和第三层级)。

(iii)公允价值所属层次间的重大变动

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)第三层次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	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	买入返售金融资产	50,440,195.66	1.69
	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	1,578,600,915.60	52.87
4	其他各项资产	29,989,648.37	1.00
	合计	2,985,858,669.80	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	3.22	
	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	-	-
	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银行间市场交易日融资余额占基金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	66
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	139
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

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	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	-

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	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

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	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

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	19
报告期内偏离度的最高值	0.3160%
报告期内偏离度的最低值	-0.1342%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1216%

注:以上数据按交易日统计。

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

2007年7月1日基金实施新会计准则后,本基金所持有的债券(包括票据)采用摊余成本法进行估值,即估值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,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

8.9.2本报告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。

8.9.3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。

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	29,989,048.37
4	应收申购款	600.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	29,989,648.37

§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
海富通货币A	12,270	61,860.56	91,210,753.73	12.02%	667,818,284.17	87.98%
海富通货币B	90	24,573,959.33	2,001,149,350.59	90.48%	210,506,988.80	9.52%
合计	12,360	240,346.71	2,092,360,104.32	70.43%	878,325,272.97	29.57%

注:本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,A、B 级比例分母为各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用基金份额的合计数(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	海富通货币A	239,467.22	0.0315%
	海富通货币B	-	-
	合计	239,467.22	0.0081%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	海富通货币A	海富通货币B
基金合同生效日(2005年1月4日)基金份额总额	964,512,079.20	-
本报告期期初基金份额总额	814,445,461.42	5,684,604,758.46
本报告期基金总申购份额	8,526,122,710.33	20,989,064,975.44
减:本报告期基金总赎回份额	8,581,539,133.85	24,462,013,394.51
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	759,029,037.90	2,211,656,339.39

注:总申购含红利再投、转换入及分级份额调增份额;总赎回含转换出及分级份额调减份额。

§11 重大事件揭示

111 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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

2011年8月19日,董文标先生因工作原因辞去本公司独立董事职务,公司聘请王明权先生继任本公司独立董事。

本报告期内,根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》,李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理。因工作调动,董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理,刘慧军女士不再担任中国银行托管及投资者服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内,本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是109,800.00元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是7年。

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

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

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	
海通证券	1	-	-	119,941.80	100.00%	-

注:1、上述佣金按市场佣金率计算。

2、(1)交易单元的选择标准 本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分,进行主观性评议,独立的评分,形成证券公司排名及交易单元租用意见。 (2)交易单元的选择程序 本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择:

<1> 推荐。投资部业务人员推荐,经投资部部门会议讨论,形成重点评估的证券公司备选池,从中进行甄选。原则上,备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定,进行主观性评议,独立的评分,形成证券公司排名及交易单元租用意见,并报公司总裁办公会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后,由基金管理人的总裁办公会核准。

3、本报告期内,本基金租用的券商交易单元未发生变更。

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
海通证券	-	-	10,903,800,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值未超过0.5%。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于2003年4月,是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从2003年8月开始,海富通先后募集成立了20只公募基金。截至2011年12月31日,海富通管理的公募基金资产规模近325亿元人民币。

作为国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人,截至2011年12月31日,海富通为50多家企业近160亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司,截至2011年12月31日,海富通旗下专户理财管理资产规模达28亿元。2010年12月,海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。

2004年末开始,海富通为QFII(合格境外机构投资者)及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问,截至2011年12月31日,投资咨询及海外业务规模近200亿元人民币。

2010年11月25日,海富通全资香港子公司——海富通资产管理(香港)有限公司正式开业,注册资本为6000万港元。经监管部门批复,海富通资产管理(香港)有限公司将开展第四类(就证券提供意见)、第九类(提供资产管理)业务。

2011年12月,海富通资产管理(香港)有限公司获得证监会核准批复RQFII(人民币合格境外机构投资者)业务资格,准许在香港筹集人民币资金投资境内证券市场,并首批获得国家外汇管理局批准的11亿元人民币RQFII(人民币合格境外机构投资者)投资额度。

2011年4月,海富通在由中国证券报社主办、银河证券、天相投顾、招商证券、海通证券等协办的"2010年度中国基金业金牛奖"评选中荣获"2010年十大金牛基金管理公司",在上海证券报社主办的第八届中国"金基金奖"评选中荣获"金基金——海外投资回报公司"奖;2011年3月31日,海富通在证券时报社主办的"中国基金业明星奖"评选中荣获"2010年度十大明星基金公司"奖。

海富通同时还在不断践行其社会责任。公司自2008年启动"绿色与希望-橄榄枝公益环保计划",针对汶川震区受灾学校、上海民工小学、安徽老区小学进行了物资捐赠,向内蒙古库伦旗捐建了环保公益林。此外,海富通还积极推进投资者教育工作,推出了以"幸福投资"为主题和特色的投资者教育活动,向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

海富通基金管理有限公司
二〇一二年三月二十九日