海富通稳健添利债券型证券投资基金 2008年年度报告摘要

2008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：中国工商银行股份有限公司　送出日期：2009年3月26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责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，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2009年3月25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。

本报告期自2008年10月24日（基金合同生效日）起至12月31日止。本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通债券
交易代码	519023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月24日
报告期末基金份额总额	2,979,273,098.74份

2.2 基金产品说明

投资目标	在强调本金安全的基础上，积极追求资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金通过价值分析，采用自上而下确定投资策略，采取久期管理、类属配置和现金管理策略等积极投资策略，发现、确认并利用细分市场失衡，实现组合增值。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于中低风险品种。其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	蒋松云
	联系电话	021-38650891	010-66105799
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-50479057	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告/半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/半年度报告备置地点	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

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2008年10月24日-2008年12月31日
本期已实现收益	25,301,354.82
本期利润	98,531,505.26
加权平均基金份额本期利润	0.0309
本期基金份额净值增长率	3.10%
3.1.2 期末数据和指标	2008年10月24日-2008年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.0082
期末基金资产净值	3,072,717,263.94
期末基金份额净值	1.031

注：1、本基金合同于2008年10月24日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

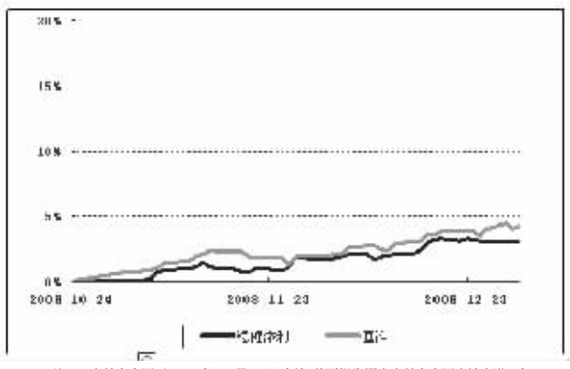
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效起至今	3.10%	0.23%	4.25%	0.25%	-1.15%	-0.02%

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

海富通债券累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2008年10月24日至2008年12月31日

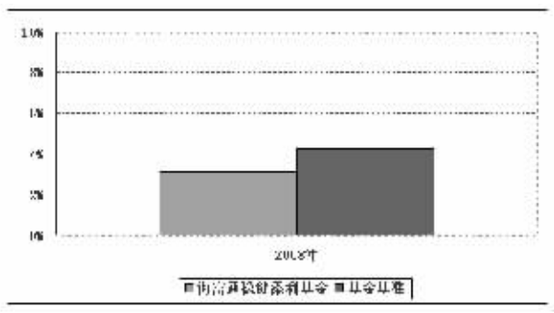


注：1、本基金合同于2008年10月24日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；

2、按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月，自2008年10月24日合同生效日起至2008年12月31日，本基金运作时间未满六个月，仍处于建仓期中。

3.2.3 本基金自基金合同生效以来每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通稳健添利债券型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



注：图中列示的2008年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期10月24日（基金合同生效日）起至12月31日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2008年10月24日-2008年12月31日	—	—	—	—	

§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于2003年4月1日共同发起设立。本海富通稳健添利债券型证券投资基金是基金管理人管理的第九只开放式基金；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、海富通货币市场证券投资基金、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、海富通精选或号混合型证券投资基金和海富通中国海外精选股票型证券投资基金八只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邵佳民	本基金的基金经理；海富通回报基金基金经理；固定收益组合管理部总监	2008-10-24	—	11年	中国国籍，硕士，持有基金从业人员资格证书。历任海通证券公司固定收益部债券业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资部经理。2003年4月任海富通基金管理有限公司固定收益分析师，2005年1月至2008年1月担任海富通货币基金基金经理。2006年5月起任海富通回报基金基金经理，2007年10月起任固定收益组合管理部总监，2008年10月起兼任海富通债券基金基金经理。

注：1、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为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

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，就建立有公平交易制度，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。中国证监会于2008年3月20日颁布了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司根据该指导意见的具体要求，已完善现有的业务流程，建立了公平交易监控系统，并进行定期监控，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

本基金成立以后，宏观经济减速更加明显，中央银行进行了大幅度的降息，一年期存款和贷款利率分别降到2.25%和5.31%。中央银行同时通过减少票据发行，向市场投放流动性。中短期债券继续上涨，而长期债券则因投资者担心远期的物价走势而相对疲软，收益率曲线有所陡峭。信用产品方面，第四季度投资者信用风险不再过于紧张，信用利差收窄。

本基金处于建仓期，考虑到债券市场的基本面没有发生变化，支持继续上涨，因此进行了相对快速的建仓，主要投资品种以政策性金融债、短期融资券、国债、公司债券为主。组合久期在5年以内。信用产品全部是主体信用AA级以上，严格防范信用风险。报告期内没有投资可转换债券。

本报告期内，基金净值增长率为3.10%，同期业绩比较基准收益率为4.25%，基金净值落后业绩比较基准1.15个百分点。基金业绩跑输基准的主要原因是本基金在报告期处于建仓期，没有充分投资，因此在债券市场整体上涨时出现了跑输基准的情形。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券市场在经历半年左右的迅速上涨后，市场的担心已经多于乐观，尤其是对于2009年下半年通货膨胀抬头的担心。长期国债的表现除受制于物价预期外，2009年的长期国债发行也是一个不确定因素。市场在经历2008年的涨跌后，已经变得十分“聪明”，走势往往反映了更长时间的预期。市场预期的一致性也增加了投资操作的难度：大多数投资者认为债券市场2009年上半年可能继续牛市，而下半年则可能结束牛市。经验告诉我们，市场往往与多数人的看法并不一致，但目前其他判断缺乏信息支持。有一点可以肯定，2009年的债券市场将受到政府政策的巨大影响，从宏观经济到债券发行，乃至资金供给。本基金管理人认为，不必对上半年过于乐观，而对下半年过于悲观，债券市场在调整中仍可以出现较好的买点。宏观经济受到国内外因素的制约，发展趋势比较复杂，市场的分歧可能加大。物价数据和利率调整的因素对市场的冲击在变小，经济发展的中期趋势将是制约债券市场的决定因素。基金管理人对2009年固定收益市场的发展持乐观态度。

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，并经本公司业务管理委员会批准后实施。

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。

对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用证券投资基金估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1. 本基金本报告期内无应分配利润。

2. 已实施的利润分配：无

3. 不存在应分配但尚未实施的利润。

§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

2008年，本基金托管人在对海富通稳健添利债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他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

2008年，海富通稳健添利债券型证券投资基金的管理人——海富通基金管理有限公司在海富通稳健添利债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的海富通稳健添利债券型证券投资基金2008年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：海富通稳健添利债券型证券投资基金

报告截止日：2008年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2008年12月31日
资产：	
银行存款	317,166,200.24
结算备付金	8,285,292.98
存出保证金	-
交易性金融资产	2,671,951,194.00
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	2,671,951,194.00
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	25,697,680.49
应收股利	-
应收申购款	105,420,544.45
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	3,128,520,912.16
负债和所有者权益	本期末 2008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	52,407,516.81
应付管理人报酬	1,698,323.72
应付托管费	522,561.14
应付销售服务费	783,841.76
应付交易费用	12,887.50
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	378,517.29
负债合计	55,803,648.22
所有者权益：	
实收基金	2,979,273,098.74
未分配利润	93,444,165.20
所有者权益合计	3,072,717,263.94
负债和所有者权益总计	3,128,520,912.16

注：1、本报告期自2008年10月24日（基金合同生效日）起至2008年12月31日止，无上年度可比数据；

2、报告截止日2008年12月31日，基金份额净值1.031元，基金份额总额2,979,273,098.74份。

7.2 利润表

会计主体：海富通稳健添利债券型证券投资基金

本报告期：2008年10月24日至2008年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2008年10月24日至2008年12月31日
一、收入	105,613,158.14
1.利息收入	17,521,647.22
其中：存款利息收入	1,362,144.46
债券利息收入	14,997,275.42
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,162,227.34
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	14,801,177.46
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	14,801,177.46
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）	73,230,150.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	60,183.02
二、费用（以“-”号填列）	-7,081,652.88
1. 管理人报酬	-3,907,479.01
2. 托管费	-1,202,301.23
3. 销售服务费	-1,803,451.91
4. 交易费用	-30,587.67
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	-137,833.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	98,531,505.26
所得税费用（以“-”号填列）	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	98,531,505.26

注：1、本报告期自2008年10月24日（基金合同生效日）起至2008年12月31日止，无上年度可比数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通稳健添利债券型证券投资基金

本报告期：2008年10月24日至2008年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2008年10月24日至2008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）	3,180,077,343.35	-	3,180,077,343.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	98,531,505.26	98,531,505.26
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）	-200,804,244.61	-5,087,340.06	-205,891,584.67
其中：1.基金申购款	997,612,461.25	17,415,071.81	1,015,027,533.06
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-1,198,416,705.86	-22,502,411.87	-1,220,919,117.73
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,979,273,098.74	93,444,165.20	3,072,717,263.94

注：1、本报告期自2008年10月24日（基金合同生效日）起至2008年12月31日止，无上年度可比数据。

7.4 报表附注

7.4.1 重要会计政策和会计估计

7.4.1.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2008年10月24日(基金合同生效日)至2008年12月31日。

7.4.1.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.1.3 金融资产和金融负债的分类

(i) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(ii) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.1.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(ii) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(iii) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.1.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.1.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.1.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.1.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.1.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.1.12 其他重要的会计政策和会计估计

计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

7.4.2 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
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
富通基金管理公司 (Fortis Investment Management S.A.)	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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.3.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2008年10月24日至2008年12月31日
当期应支付的管理费	3,907,479.01
其中：当期已支付	2,209,155.29
期末未支付	1,698,323.72

注：支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理费按前一日基金资产净值的年费率（0.65%）计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费＝前一日基金资产净值X 0.65%/当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2008年10月24日至2008年12月31日
当期应支付的托管费	1,202,301.23
其中：当期已支付	679,740.09
期末未支付	522,561.14

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的年费率（0.20%）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 0.20%/当年天数。

7.4.3.2.3 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 2008年10月24日至2008年12月31日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
中国工商银行	514,359.06	355,138.59	869,497.65
海通证券	-	5,550.59	5,550.59
海富通基金管理有限公司	331,959.04	284,472.26	616,431.30
合计	846,318.10	645,161.44	1,491,479.54

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年费率（0.30%）计提，逐日累计至每月月底，按月支付给海富通基金管理有限公司，再由海富通基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日基金资产净值X 0.30%/当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.3.4.2 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

本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.3.5 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 2008年10月24日至2008年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	317,166,200.24	1,283,373.97

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2008年10月24日至2008年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
海通证券	088054	08南网债01	债券分销	1,000,000	100,000,000.00

7.4.4 期末（2008年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有流通受限证券。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无债券正回购余额。

§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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	2,671,951,194.00	85.41
	其中：债券	2,671,951,194.00	85.41
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	325,451,493.22	10.40
6	其他资产	131,118,224.94	4.19
7	合计	3,128,520,912.16	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	-	-

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	321,080,194.00	10.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,106,915,000.00	36.02
	其中：政策性金融债	891,455,000.00	29.01
4	企业债券	321,813,000.00	10.47
5	企业短期融资券	922,143,000.00	30.01
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	2,671,951,194.00	86.96

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	NF0818	08农发18	8,000,000	840,400,000.00	27.35
2	081903	08广发债固2	2,000,000	215,460,000.00	7.01
3	010210	02国债(10)	2,134,360	215,143,488.00	7.00
4	881208	08同盛CP01	2,100,000	212,415,000.00	6.91
5	088054	08南网债01	1,500,000	152,760,000.00	4.97

8.7 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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

8.9.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.9.3 其他资产构成

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	应收股利	-
4	应收利息	25,697,680.49
5	应收申购款	105,420,544.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	131,118,224.94

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

§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

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
12,735	233,943.71	1,521,569,171.86	51.07%	1,457,703,926.88	48.93%

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	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	794,965.50	0.03%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年10月24日）基金份额总额	3,180,077,343.35
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	997,612,461.25
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-1,198,416,705.86
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
基金合同生效日至报告期期末基金份额变动（份额减少以“-”填列）	-200,804,244.61
报告期期末基金份额总额	2,979,273,098.74

§11 重大事件揭示

11.1 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

报告期内，基金管理人、基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

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，本基金聘请普华永道中天会计师事务所有限公司提供审计服务，报告期内应付审计费金额为70,000元，目前是事务所为本基金提供审计服务的第一年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		回购交易		应支付该券商的佣金	
		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	佣金	占当期佣金总量的比例
中金公司	2	1,781,833,675.18	100%	5,571,600,000.00	100%	-	-

注：1、本基金于2008年10月24日成立，报告期内本基金租用专用交易单元2个，分别是中国国际金融有限责任公司的上海证券交易所交易单元1个，深圳证券交易所交易单元1个。

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