海富通货币市场证券投资基金 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 1 月 1 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	海富通货币	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	15,838,861,831.75 份	
下属两级基金的基金简称	海富通货币 A	海富通货币 B
下属两级基金的交易代码	519505	519506
报告期末下属两级基金的份额总额	5,738,192,372.28 份	10,100,669,459.47 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	宁敏
	联系电话	021-38650891	010-66594977
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-50479057	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

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2008年		2007年		2006年	
	A级	B级	A级	B级	A级	B级
本期已实现收益	68,270,011.93	245,563,220.34	14,553,007.46	32,087,794.92	39,500,253.39	7,943,896.59
本期利润	68,270,011.93	245,563,220.34	14,553,007.46	32,087,794.92	39,500,253.39	7,943,896.59
本期净值收益率	4.1075%	4.3553%	3.4972%	3.7454%	1.9236%	0.9344%
3.1.2 期末数据和指标	2008年		2007年		2006年	
期末基金资产净值	5,738,192,372.28	10,100,669,459.47	464,571,071.79	1,015,288,562.36	644,438,313.83	917,007,798.88
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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。

2、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、本基金收益分配是按月结转份额。

4、自 2006 年 8 月 1 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。在计算主要财务指标时,A 级基金与分级前基金连续计算,B 级基金自 2006 年 8 月 1 日开始计算。

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

A 级

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	1.6315%	0.0246%	0.8097%	0.0017%	0.8218%	0.0229%
过去六个月	2.4273%	0.0180%	1.7947%	0.0015%	0.6326%	0.0165%
过去一年	4.1075%	0.0134%	3.7717%	0.0012%	0.3358%	0.0122%
过去三年	9.8211%	0.0099%	8.6643%	0.0024%	1.1568%	0.0075%
自基金合同生效起至今	12.5549%	0.0093%	10.6041%	0.0024%	1.9508%	0.0069%

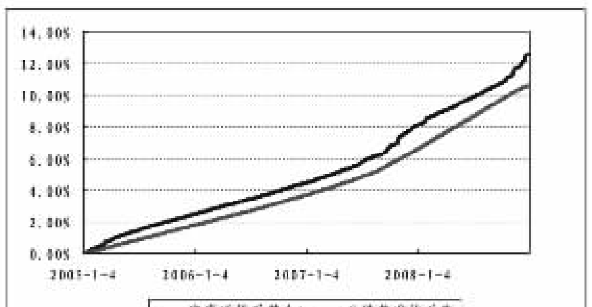
B 级

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	1.6916%	0.0246%	0.8097%	0.0017%	0.8819%	0.0229%
过去六个月	2.5496%	0.0180%	1.7947%	0.0015%	0.7549%	0.0165%
过去一年	4.3553%	0.0134%	3.7717%	0.0012%	0.5836%	0.0122%
自基金合同生效起至今	9.2755%	0.0106%	7.5443%	0.0022%	1.7312%	0.0084%

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

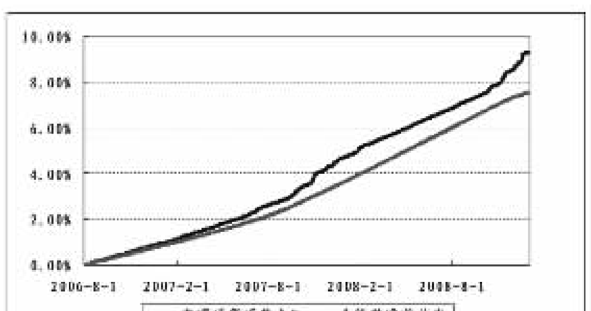
A 级

(2005 年 1 月 4 日至 2008 年 12 月 31 日)



B 级

(2006 年 8 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)

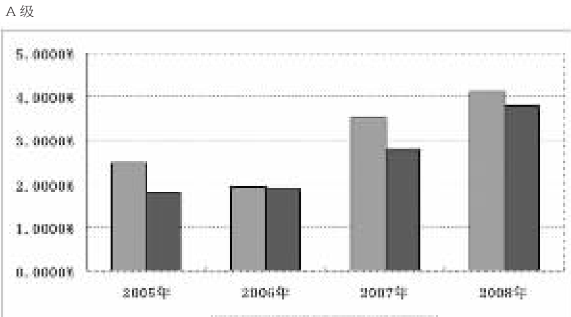


注:本基金合同于 2005 年 1 月 4 日生效,按基金合同规定,本基金自基金合同生效起 3 个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十五条(二)投资范围、(六)投资组合中规定的各项比例。

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

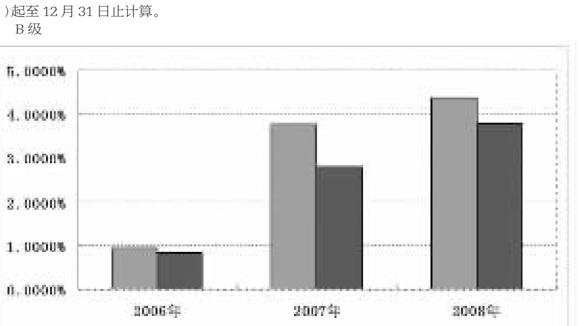
海富通货币市场证券投资基金净值收益率与业绩比较基准历史收益率的对比图

A 级



注: 图中列示的 2005 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 1 月 4 日 (基金合同生效日)起至 12 月 31 日止计算。

B 级



注:图中列示的 2006 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 8 月 1 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

A 级 单位:人民币元

年度	再投资形式发放(总额)	备注
2008年	68,270,011.93	
2007年	14,553,007.46	
2006年	39,500,253.39	
合计	122,323,272.78	

B 级 单位:人民币元

年度	再投资形式发放总额	备注
2008年	245,563,220.34	
2007年	32,087,794.92	
2006年	7,943,896.59	
合计	285,594,911.85	

注: 1、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。

2、本基金合同生效日为 2005 年 1 月 4 日,在计算 2006 年收益分配时,A 级基金与分级前基金连续计算,B 级基金自 2006 年 8 月 1 日开始计算。

§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。本海富通货币市场证券投资基金是基金管理人管理的第三只开放式基金;除本基金外,基金管理人目前还管理着另外八只开放式基金——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和海富通稳健添利债券型证券投资基金。

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; 海富通债券基金基金经理; 海富通回报基金基金经理; 固定收益组合管理部总监	2005-1-4	2008-1-31	11年	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。
张丽洁	本基金的基金经理	2008-1-31	—	6年	经济学学士学位, 持有基金从业人员资格证书,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 1 月起任海富通货币基金基金经理。

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: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

海富通货币基金在 2008 年初判断上半年通货膨胀水平将高位运行,基准利率虽然有上调可能,但是美国当时已开始大幅度减息,加上二会之后中国人民银行再次提高准备金比例 0.5%,加息空间非常有限。资金面考虑在新股申购收益率下降,特别在出现新股破发后,货币市场将明显出现偏暖的预期。我们对于市场判断是保持弱势整理格局,所以本基金上半年一直采用哑铃型配置策略,增加信用产品的投资比例。

下半年开始通货膨胀水平有所下降,虽然货币数量政策继续保持紧缩,但是利率政策方面不存在大幅度加息可能,本基金继续坚持采用哑铃型配置策略,增加配置 1 年期央行票据,慢慢减少信用产品的投资比例。之后宏观经济发生了重大变化,各个方面都支持一个中期的债券牛市:次贷危机后外围经济的衰退,一定程度上影响了国内市场,我国的经济增速开始放缓,政府开始放松银根,宽松财政,利率下降通道已然打开;大宗商品价格继续下跌的可能性大,而且 2009 年的 CPI 可能大幅度下降;人民币在目前保持小幅度的升值,资金面充足。货币基金投资的 1 年期央行票据利率从 4.0%下降到现在的 1.1%,所以本基金四季度收益较高,主要是由于成本计价法下卖出债券资产兑现了部分收益。

本报告期内,A 级基金净值收益率为 4.1075%,同期业绩比较基准收益率为 3.7717%;B 级基金净值收益率为 4.3553%,同期业绩比较基准收益率为 3.7717%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2009 年最大的不确定性在于宏观经济的走势,管理人认为,基本面因素将在未来一到两年内主导债券市场。我们认为在 2009 年由于充足的流动性,债券短期利率都会在低位运行,货币基金应该谨慎对待短期利率的回调风险,保持仓位和剩余期限的稳定,积极管理流动性,这样也更加符合货币基金作为流动性管理工具的定位。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1. 本基金本报告期内应分配:货币 A 级 68,270,011.93 元,货币 B 级 245,563,220.34 元。

2. 已实施的利润分配:货币 A 级已分配 68,270,011.93 元,货币 B 级已分配 245,563,220.34 元。

3. 应分配但尚未实施的利润:已分配但未支付的 36,977,859.25 元。 应于收益支付日 2009 年 1 月 15 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,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。

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: 2008 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2008年 12 月 31 日	上年度末 2007年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	7,136,161,267.60	43,249,098.40
结算备付金	3,000,000.00	20,671,915.49
存出保证金	–	–
交易性金融资产	8,761,440,891.55	1,432,289,491.09
其中:股票投资	–	–
基金投资	–	–
债券投资	8,761,440,891.55	1,432,289,491.09
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	67,408,310.70	3,283,665.32
应收股利	–	–
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	15,968,010,469.85	1,499,494,170.30
负债和所有者权益	本期末 2008年 12 月 31 日	上年度末 2007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	84,514,919.43	16,522,014.09
应付管理人报酬	3,598,230.88	402,173.10
应付托管费	1,090,373.01	121,870.65
应付销售服务费	1,000,840.74	113,834.63
应付交易费用	213,569.89	69,135.25
应交税费	988,000.00	–
应付利息	–	–
应付利润	36,977,859.25	1,949,293.56
递延所得税负债	–	–
其他负债	764,844.90	456,214.87
负债合计	129,148,638.10	19,634,536.15
所有者权益:		
实收基金	15,838,861,831.75	1,479,859,634.15
未分配利润	–	–
所有者权益合计	15,838,861,831.75	1,479,859,634.15
负债和所有者权益总计	15,968,010,469.85	1,499,494,170.30

注:报告截止日 2008 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.00 元,基金份额总额 15,838,861,831.75 份,其中 A 类基金份额 5,738,192,372.28 份,其中 B 类基金份额 10,100,669,459.47 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:2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2008年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
一、收入	354,823,751.33	55,507,360.37
1.利息收入	233,953,501.31	65,687,197.82
其中:存款利息收入	5,720,332.65	1,660,082.76
债券利息收入	211,848,483.32	27,846,704.02
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	16,384,685.34	36,180,411.04
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"–"填列)	120,870,199.96	–10,180,037.45
其中:股票投资收益	–	–
基金投资收益	–	–
债券投资收益	120,870,199.96	–10,180,037.45
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)	50.06	200.00
二、费用(以"–"号填列)	–40,990,519.06	–8,866,557.99
1. 管理人报酬	–22,335,368.79	–4,330,658.90
2. 托管费	–6,768,293.67	–1,312,320.78
3. 销售服务费	–4,452,021.88	–1,227,148.56
4. 交易费用	–	–
5. 利息支出	–6,844,199.33	–1,528,652.80
其中:卖出回购金融资产支出	–6,844,199.33	–1,528,652.80
6. 其他费用	–590,635.39	–467,776.95
三、利润总额(亏损总额以"–"号填列)	313,833,232.27	46,640,802.38
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"–"号填列)	313,833,232.27	46,640,802.38

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:2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2008年 1 月 1 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)	1,479,859,634.15	–	1,479,859,634.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	313,833,232.27	313,833,232.27
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	14,359,002,197.60	–	14,359,002,197.60
其中:1.基金申购款	57,491,895,741.03	–	57,491,895,741.03
2.基金赎回款(以"–"号填列)	–43,132,893,543.43	–	–43,132,893,543.43
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)	–	–313,833,232.27	–313,833,232.27
五、期末所有者权益(基金净值)	15,838,861,831.75	–	15,838,861,831.75
项目	上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 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)	1,561,446,112.71	–	1,561,446,112.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	46,640,802.38	46,640,802.38
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	–81,586,478.56	–	–81,586,478.56
其中:1.基金申购款	9,030,730,826.97	–	9,030,730,826.97
2.基金赎回款(以"–"号填列)	–9,112,317,305.53	–	–9,112,317,305.53
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)	–	–46,640,802.38	–46,640,802.38
五、期末所有者权益(基金净值)	1,479,859,634.15	–	1,479,859,634.15

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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	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	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

本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.3.1.2 权证交易

本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.3.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	15,936,300,000.00	100%	19,576,000,000.00	100%

7.4.3.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2008年 1 月 1 日至 2008 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	175,299.30	100%	38,591.30	100%
关联方名称	上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 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	215,336.00	100%	37,240.95	100%

注: 上述佣金按市场佣金率计算,未扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

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 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	22,335,368.79	4,330,658.90
其中:当期已支付	18,737,137.91	3,928,485.80
期末未支付	3,598,230.88	402,173.10

注: 支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理费是按前一日基金资产净值的年费率(0.33%)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 0.33% / 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 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	6,768,293.67	1,312,320.78
其中:当期已支付	5,677,920.66	1,190,450.13
期末未支付	1,090,373.01	121,870.65

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的年费率(0.1%)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。

7.4.3.2.3 销售服务费

单位:人民币元

海富通货币	A级			B级		
获得销售服务费的各关联方名称	本期			本期		
	2008年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日			2008年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		
	当期应支付的销售服务费			当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计	当期已支付	期末未支付	合计
中国银行	906,780.91	147,085.93	1,053,866.84	33,235.66	6,271.89	39,507.55
海通证券	29,566.44	22,731.01	52,297.45	717.79	2,292.83	3,010.62
海富通基金	166,103.07	20,955.51	187,058.58	270,180.85	41,397.13	311,577.98
合计	1,102,450.42	190,772.45	1,293,222.87	304,134.30	49,961.85	354,096.15
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			上年度可比期间		
	2007年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日			2007年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日		
	当期应支付的销售服务费			当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计	当期已支付	期末未支付	合计
中国银行	706,919.56	52,059.02	758,978.58	17,232.15	2,503.31	19,735.46
海通证券	10,183.36	2,781.56	12,964.92	414.28	–	414.28
海富通基金	103,593.55	10,430.77	114,024.32	48,213.04	5,096.04	53,309.08
合计	820,696.47	65,271.35	885,967.82	65,859.47	7,599.35	73,458.82

注: 支付基金销售机构的 A 类基金份额和 B 类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。

7.4.3.3 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 2008年 1 月 1 日至 2008 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	2,815,943,755.80	3,013,869,756.09	–	–	1,644,700,000.00	278,682.82
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 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	1,961,914,642.47	2,101,997,420.55	–	–	5,334,000,000.00	517,575.99

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。

7.4.3.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2008年 12 月 31 日		上年度末 2007年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
海通证券	631,437.53	0.0040%	607,558.45	0.0411%

注:海通证券为本基金管理公司的大股东。

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 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日	
	期末存款余额	当期存款利息收入	期末存款余额	当期存款利息收入
中国银行	7,136,161,267.60	4,912,524.15	43,249,098.40	1,072,319.67

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按约定利率计息。于 2008 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 45.05%(2007 年 12 月 31 日:2.92%)。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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

本基金未持有流动受限的证券。

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

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2008 年 12 月 31 日,本基金无银行间市场债券正回购交易。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2008 年 12 月 31 日,基金没有证券交易所债券正回购交易。

§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	资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	8,761,440,891.55	54.87
	其中:债券	8,761,440,891.55	54.87
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和清算备付金合计	7,139,161,267.60	44.71
	其中:定期存款	–	–
4	其他资产	67,408,310.70	0.42
5	合计:	15,968,010,469.85	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	69,126,996,655.04	3.81
	其中:买断式回购融资	–	–
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中:买断式回购融资	–	–

注:上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每个交易日的融资余额的合计数,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日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

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超过资产净值的 20%的情况如下:

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整日期
1	2008-01-29	20.46	净赎回份额占总份额 3.45%	1
2	2008-02-21	21.39	巨额赎回	2
3	2008-02-22	23.48	净赎回份额占总份额 8.90%	–
4	2008-02-25	26.43	巨额赎回	4
5	2008-02-26	26.76	调整期间	–
6	2008-02-27	26.82	调整期间	–
7	2008-02-28	26.18	调整期间	–

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	97
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	179
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

在本报告期本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

8.3.2 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	45.26	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60 天	4.67	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90 天	9.05	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.87	–
4	90天(含)—180 天	13.98	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.53	–
5	180天(含)—397 天(含)	27.42	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
	合 计	100.38	–

8.4 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(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	4,306,640,932.68	27.19
3	金融债券	1,039,291,508.80	6.56
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	3,415,508,450.07	21.56
6	其他	–	–
合计		8,761,440,891.55	55.32
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券		538, 044,277.66	3.40

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

8.5 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801031	08央行票据 31	7,600,000.00	757,798,293.81	4.78
2	0801084	08央行票据 84	6,900,000.00	685,583,450.10	4.33
3	0801016	08央票 16	6,000,000.00	599,044,143.92	3.78
4	0801098	08央行票据 98	5,100,000.00	505,758,467.15	3.19
5	060801	06民生 01	5,000,000.00	501,247,231.14	3.16
6	050503	05工行 03	3,000,000.00	295,750,855.70	1.87
7	0801067	08央行票据 67	2,500,000.00	248,652,280.44	1.57
8	040705	04建行 03 浮	2,400,000.00	242,293,421.96	1.53
9	0801114	08央票 114	2,300,000.00	227,783,900.32	1.44
10	0801117	08央票 117	2,200,000.00	217,779,800.10	1.37

8.6 "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	74
报告期内偏离度的最高值	0.4940%
报告期内偏离度的最低值	0.0992%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2264%

注:以上数据按交易日统计。

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 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 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。

8.8.3 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。

8.8.4 其他资产构成

单位:人民币元

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	67,408,310.70
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
合 计		67,408,310.70

§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
A级	36,043	159,204.07	236,635,638.74	4.12%	5,501,556,733.54	95.88%
B级	498	20,282,468.79	7,337,397,643.90	72.64%	2,763,271,815.57	27.36%
合计	36,541	433,454.53	7,574,033,282.64	47.82%	8,264,828,549.11	52.18%

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	A 级	936,288.92	0.01%
	B 级		
	合计	936,288.92	0.01%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期内基金份额的变动情况	份额级别		合计
	A级	B级	
基金合同生效日(2005 年 1 月 4 日)基金份额总额	964,512,079.20	–	964,512,079.20
报告期期初基金份额总额	464,571,071.79	1,015,288,562.36	1,479,859,634.15
报告期期间基金总申购份额	17,435,083,238.07	40,056,812,502.96	57,491,895,741.03
报告期期间基金总赎回份额	–12,161,461,937.58	–30,971,431,605.85	–43,132,893,543.43
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	–	–	–
报告期期末基金份额总额	5,738,192,372.28	10,100,669,459.47	15,838,861,831.75

§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 11 万元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 4 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	回购交易		应支付该券商的佣金	
		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
海通证券	1	15,936,300,000.00	100%	175,299.30	100%

注:1、上述佣金按市场佣金率计算,未扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取,并由券商承担的证券结算风险基金。

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,并报公司业务管理委员会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后,由基金管理人的业务管理委员会核准。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人海富通基金管理有限公司。

客户服务中心电话:40088-40099

网址:www.hftfund.com

海富通基金管理有限公司
二〇〇九年三月二十六日