海富通货币市场证券投资基金 2006年年度报告摘要

第一节 重要提示

本年度报告摘要摘自年度报告正文，报告正文同时登载于基金管理人网站（http://www.hftfund.com）。投资者欲了解详细内容,应仔细阅读年度报告正文。

基金管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 2007 年 3 月 30 日复核了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、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。

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。

第二节 基金简介

（一）基金基本资料	
1、基金简称:	海富通货币 A 海富通货币 B
2、基金交易代码:	519505 519506
3、基金运作方式:	契约型开放式
4、基金合同生效日:	2005年 1 月 4 日
5、报告期末基金份额总额:	A级基金份额:644,438,313.83 份 B 级基金份额:917,007,798.88 份
6、基金合同存续期:	不定期
7、基金份额上市的证券交易所:	无
8、上市日期:	无
（二）基金产品说明	
1、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。
2、投资策略:	1.决策依据 （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; （3） 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（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。 （2） 类别资产配置策略 根据整体策略要求,决定组合中类别资产的配置内容和各类别投资的比例。根据不同类别资产的流动性指标（二级市场存量、二级市场流量、分类资产日均成交量、近期成交量、近期变动量、交易场所）,决定类别资产的当期配置比率。根据不同类别资产的收益率水平（到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类别资产收益差异）、市场偏好、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。 （3） 明细资产配置策略 第一步筛选,根据明细资产的剩余期限、资信等级、流动性指标（流通总量、日均交易量）,决定是否纳入组合。第二步筛选,根据个别债券的收益率（到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理）与剩余期限的配比,对照基金的收益要求决定是否纳入组合。第三步筛选,根据个别债券的流动性指标（发行总量、流通量、上市时间）,决定投资总量。 3. 投资管理方法 （1） 短期利率水平预期策略 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。 （2） 收益率曲线分析策略 根据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,反映市场对较短期限经济状况的判断及对未来短期经济走势的预期。 （3） 组合剩余期限策略、期限配置策略 通过对组合资产剩余期限的设计、跟踪、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、突发的现金需求,同时保持组合的稳定收益;特别在债券投资中,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,锁定风险,满足组合目标期限。 （4） 类别品种配置策略 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,决定各类资产的配置比例;再通过评估各类资产的流动性和收益性利差,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。 （5） 流动性管理策略 在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下,通过基金资产安排（包括现金库存、资产变现、剩余期限管理或以其他措施）,在保持基金资产高流动性的前提下,确保基金的稳定收益。 （6） 无风险套利策略 无风险套利策略包括: 跨市场套利策略: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。跨品种套利策略:根据各细分市场中不同品种的风险参数、流动性补偿和收益特征,动态调整不同期限结构品种的配置比例。 （7） 滚动配置策略 根据具体投资品种的市场特性,采用持续滚动投资的方法,以提高基金资产的整体持续的变现能力。
3、业绩比较基准:	税后一年期银行定期存款利率
4、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。
（三）基金管理人	
1、名称:	海富通基金管理有限公司
2、信息披露负责人:	奚万荣
3、联系电话:	021-68604999-591
4、传真:	021-50479057
5、电子邮箱:	wrxi@hftfund.com
（四）基金托管人	
1、名称:	中国银行股份有限公司
2、信息披露负责人:	宁敏
3、联系电话:	010－66594977
4、传真:	010－66594942
5、电子邮箱:	tgxxpl@bank-of-china.com
（五）信息披露	
登载年度报告正文的管理人互联网网址:	http://www.hftfund.com
基金年度报告置备地点:	基金管理人及基金托管人的住所

第三节 主要财务指标和基金净值表现

所述基金业绩指标不包括持有人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。

一、 主要财务指标

		2006年		2005年
序号	项目	A级	B级	
1	本期净收益(元)	39,500,253.39	7,943,896.59	68,230,101.36
2	期末基金资产净值(元)	644,438,313.83	917,007,798.88	2,928,551,698.69
3	期末基金份额净值(元)	1.0000	1.0000	1.0000
4	本期净值收益率	1.9236%	0.9344%	2.4894%
5	累计净值收益率	4.4609%	0.9344%	2.4894%

注:1、本基金收益分配是按月结转份额。本基金合同生效日为 2005 年 1 月 4 日，2005 年度主要财务指标的计算期间为 2005 年 1 月 4 日至 2005 年 12 月 31 日。

2、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 2006 年度主要财务指标时,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。

二、 基金净值表现

1、历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较:

A 级

阶段	净值收益率（1）	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 3 个月	0.4993%	0.0039%	0.5044%	0.0000%	-0.0051%	0.0039%
过去 6 个月	1.0028%	0.0036%	0.9825%	0.0003%	0.0203%	0.0033%
过去 1 年	1.9236%	0.0040%	1.8797%	0.0003%	0.0439%	0.0037%
自基金合同生效起至今	4.4609%	0.0058%	3.6985%	0.0002%	0.7624%	0.0056%

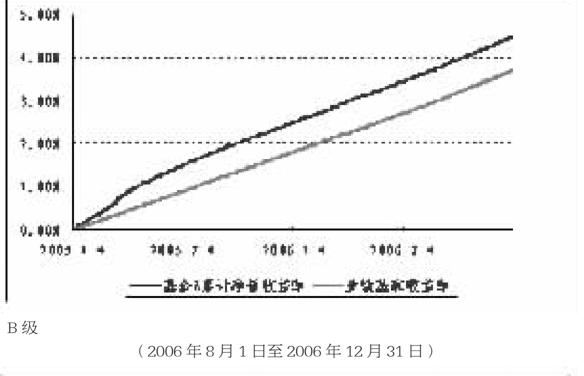
B 级

阶段	净值收益率（1）	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 3 个月	0.5600%	0.0039%	0.5044%	0.0000%	0.0556%	0.0039%
自基金合同生效起至今	0.9344%	0.0036%	0.8296%	0.0002%	0.1048%	0.0034%

2、本基金合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:

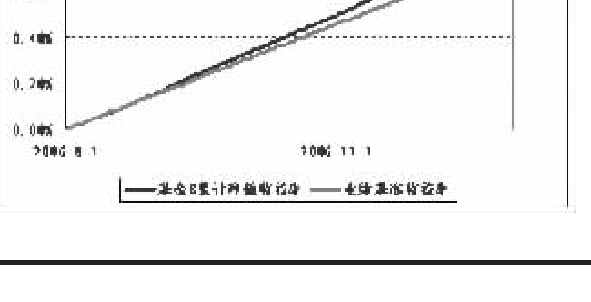
A 级

（2005 年 1 月 4 日至 2006 年 12 月 31 日）



B 级

（2006 年 8 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日）



注:

(1)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。

三、 自基金合同生效以来每年的基金收益分配情况

项目	2006年		2005年
	A级	B级	
收益分配(元)	39,500,253.39	7,943,896.59	68,230,101.36

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, 2005 年度收益分配的计算期间为 2005 年 1 月 4 日至 2005 年 12 月 31 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。

第四节 管理人报告

一、基金管理人及基金经理情况

（一）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五只开放式基金——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。

（二）基金经理简介

邵佳民先生,基金经理,硕士学位,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,海富通基金管理有限公司固定收益分析师。2005 年 1 月至今担任海富通货币市场基金基金经理,2006 年 5 月起至今兼任海富通强化回报混合型证券投资基金基金经理。

二、对报告期内基金运作的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》及其配套规则、《海富通货币市场证券投资基金基金合同》、《海富通货币市场证券投资基金基金招募说明书》和其他相关法律法规的规定,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。

三、报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

2006 年是货币市场基金受到严峻考验的一年。短期利率的大幅度波动,使货币基金遇到了前所未有的利率风险,而股票市场的上涨,新股发行的重开,又使货币基金的吸引力减弱,遭到大量赎回,流动性风险突出;短期融资券的信用风险也随之出现,而信用风险对货币基金是个新的考验。

面对严峻的市场环境,基金管理人强化风险管理,提高基金资产的流动性,使基金承受住了考验,同时为基金持有人提供了良好的服务。

基金管理人首先重视资产的流动性。对于流动性最低的定期存款和资产证券化品种,基金在 2006 年没有投资。对于流动性较差的波动率较大的浮动利率债券,基金只投资了具有回售权的政策性金融债,以提高其流动性,并在上半年全部减仓。在投资品种选择上,以流动性高的中央银行票据和政策性金融债为主,使得基金能够顺利地缩小投资规模,应对赎回的需求。对于有投资比例限制的品种,如浮动利率债券和短期融资券,基金主动地压缩了投资规模,为基金规模下降、投资比例被动上升预留了空间。2006 年,基金虽然规模变动极大,但未发生任何投资比例超过限制的事项。

基金管理人其次重视基金资产的安全性, 突出表现是对短期融资券信用风险的管理。基金管理人建立了严密的短期融资券内部评级体系与投资流程, 只投资安全性较高的品种,并对投资品种进行日常跟踪。2006 年,基金投资的短期融资券未发生信用风险。本基金在报告期内投资了福禧短期融资券,最高投资规模达到 9000 万元,并在该债券上市一个月内全部卖出,因而没有发生信用风险及流动性风险等投资风险。

基金管理人在做好流动性管理的基础上,通过组合管理适当地提高收益水平。基金从一级市场分销了部分高信用等级的短期融资券,紧密捕捉市场机会,增加基金持有人的收益。

基金管理人同时加强了对客户的服务工作,在 8 月份实现 AB 分级,以更好地为客户服务。虽然经历的各种冲击,但基金的年末规模仍高于首发规模。

2006 年,海富通货币市场基金取得了良好的业绩。截至报告期末,本报告期 A 级基金份额净值收益率为 1.9236%， 同期业绩比较基准收益率为 1.8797%，B 净值收益率为 0.9344%,同期业绩比较基准收益率为 0.8296%。

四、对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

2007 年货币市场将面临着更多的机遇和挑战,但整体上机遇大于挑战。

2007 年人民币仍将小幅度升值,而通货膨胀水平将有所回升。受此影响,2007 年的货币市场利率在 2006 年基础上继续大幅度上升的可能性不大,同时向下的空间也非常有限,中央银行公开市场操作对市场的冲击也在减少。货币市场利率有望较为平稳,为基金投资创造良好的环境。随着投资品种收益率的提高,基金可以在 2007 年达到更高的收益水平。

新股发行仍是对货币市场收益率,尤其是短期回购利率影响最大的因素,但随着各市场成员流动性管理能力的加强,市场的抗波动能力在提高。受到新股发行影响,交易所市场和银行间市场短期利率水平的差异可能加大,为同时参与两个市场的货币市场基金带来更好的套利机会。

2007 年长期利率的风险在上升， 更多的资金将倾向于短期投资品种。基金管理人相信,随着投资者对基金认识水平的提高,货币市场基金作为现金管理工具的作用能够得到投资者的重视。基金管理人将紧密跟踪宏观经济形势,密切关注资产的流动性和安全性,为基金持有人带来更好的回报,提供更好的服务。

第五节 托管人报告

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、基金合同和托管合同的有关规定,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。

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、基金合同和托管合同的规定,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。

本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

中国银行股份有限公司
2007 年 3 月 30 日

第六节 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司对海富通货币市场证券投资基金 2006 年 12 月 31 日的资产负债表以及 2006 年度的经营业绩表和基金净值变动表,出具了无保留意见的审计报告（普华永道中天审字(2007)第 20190 号）。

第七节 财务会计报告

一、基金会计报表

（一）资产负债表

海富通货币市场证券投资基金 2006年 12 月 31 日资产负债表 (除特别注明外,金额单位为人民币元)			
	附注	2006年 12 月 31 日	2005年 12 月 31 日
资产			
银行存款	1	354,759,192.19	294,878,196.63
结算备付金		–	28,241,330.29
应收利息	2	5,513,515.22	8,406,527.92
应收申购款		393,489,089.27	42,004,635.91
其他应收款		–	176,329.40
债券投资市值		823,251,381.07	2,561,838,251.12
其中:债券投资成本		823,251,381.07	2,561,838,251.12
资产总计		1,577,013,177.75	2,935,545,271.27
负债及持有人权益			
负债			
应付赎回款		13,792,457.90	2,482,371.80
应付赎回费		20,171.30	45.00
应付管理人报酬		364,654.99	874,690.43
应付托管费		110,501.47	265,057.74
应付销售服务费		133,646.88	783,258.33
应付佣金	3	5,985.00	–
应付收益		622,387.49	2,197,743.36
其他应付款	4	82,487.53	44,240.00
预提费用	5	434,772.48	346,165.92
负债合计		15,567,065.04	6,993,572.58
持有人权益			
实收基金	6	1,561,446,112.71	2,928,551,698.69
负债及持有人权益总计		1,577,013,177.75	2,935,545,271.27

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

（二）经营业绩表及收益分配表

海富通货币市场证券投资基金 2006年度经营业绩表 (除特别注明外,金额单位为人民币元)			
	附注	2006年度	2005年 1 月 4 日(基金合同生效日)至 2005 年 12月 31 日止期间
收入			
债券差价收入	7	19,604,190.26	30,401,114.17
债券利息收入		41,606,876.37	47,105,612.71
存款利息收入		2,065,359.52	3,418,001.14
买入返售证券收入		3,033,612.95	9,833,181.67
其他收入		–	37,756.93
收入合计		66,310,039.10	90,795,666.62
费用			
基金管理人报酬		(8,185,084.43)	(9,795,147.96)
基金托管费		(2,480,328.58)	(2,968,226.92)
基金销售服务费		(5,343,292.35)	(7,420,566.65)
卖出回购证券支出		(1,787,167.99)	(1,534,098.95)
其他费用	8	(1,070,015.77)	(847,524.78)
其中:信息披露费		(283,606.56)	(266,665.92)
审计费用		(80,000.00)	(75,000.00)
费用合计		(18,865,889.12)	(22,565,565.26)
基金净收益及基金经营业绩		47,444,149.98	68,230,101.36
基金净收益		47,444,149.98	68,230,101.36
加:年 / 期初基金净收益		–	–
可供分配基金净收益		47,444,149.98	68,230,101.36
减:本年 / 期已分配基金净收益	9	(47,444,149.98)	(68,230,101.36)
未分配基金净收益		–	–
后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。			

（三）净值变动表

海富通货币市场证券投资基金 2006年度基金净值变动表 (除特别注明外,金额单位为人民币元)		
	2006年度	2005年 1 月 4 日(基金合同生效日)至 2005 年 12月 31 日止期间
年 / 期初基金净值	2,928,551,698.69	964,512,079.20
本年 / 期经营活动		
基金净收益	47,444,149.98	68,230,101.36
经营活动产生的基金净值变动数	47,444,149.98	68,230,101.36
本年 / 期基金份额交易		
基金申购款	11,505,697,834.16	12,381,260,978.15
其中:分红再投资	41,616,438.61	57,893,983.90
基金赎回款	(12,872,803,420.14)	(10,417,221,358.66)
基金份额交易产生的基金净值变动数	(1,367,105,585.98)	1,964,039,619.49
本年 / 期向基金份额持有人分配收益		
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数	(47,444,149.98)	(68,230,101.36)
年 / 期末基金净值	1,561,446,112.71	2,928,551,698.69

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

二、年度会计报表附注

1、主要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计除下述变更外与上年度会计报表相一致:

（1）费用的确认和计量

2006 年 8 月 1 日之前，本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。自 2006 年 8 月 1 日实行销售服务费分级收费方式起,本基金 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%的年费率逐日计提。

（2）实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为 1.00 元。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,以及因级别调整而引起的 A、B 级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

2、重大会计差错的内容和更正金额

本报告期无重大会计差错。

3、关联方关系及关联方交易

(a) 关联方

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
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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(b) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

本基金在本年度通过海通证券券商席位进行债券回购交易的合计交易量 5,022,100,000.00 元 (2005 年:22,997,600,000.00 元)，产生交易佣金 55,243.10 元 (2005 年:48,384.60 元)。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。

(c) 基金管理人报酬

支付基金管理人海富通基金管理有限公司的基金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:日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 8,185,084.43 元(2005 年:9,795,147.96 元)。

(d) 基金托管费

支付基金托管人中国银行的基金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:

日基金托管费＝前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费 2,480,328.58 元(2005 年:2,968,226.92 元)。

(e) 基金销售服务费

本基金支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提。2006 年 8 月 1 日之前的约定年费率为 0.25%,自 2006 年 8 月 1 日实行销售服务费分级收费方式起,A 类基金份额和 B 类基金份额的约定年费率分别为 0.25%和 0.01%。其计算公式为:

日基金销售服务费＝前一日基金资产净值 X 约定年费率 / 当年天数。

本基金在 2006 年度需向关联方支付的基金销售服务费如下:

	2006年度	2005年 1 月 4 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日止期间
海富通基金管理有限公司	2,984,605.14	4,239,608.02
中国银行	1,646,006.21	2,207,181.96
海通证券	228,389.39	310,842.21
	4,859,000.74	6,757,632.19

(f) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,并按银行同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 354,759,192.19 元 (2005 年:294,878,196.63 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 1,988,698.05 元(2005 年:3,136,261.60 元)。

a) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本基金在本年度与基金托管人中国银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下:

	2006年	2005年 1 月 4 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日止期间
买入债券结算金额	7,549,276,515.34	2,865,904,578.18
卖出债券结算金额	9,767,049,918.76	9,087,437,344.79
卖出回购证券协议金额	7,551,700,000.00	4,152,500,000.00
卖出回购证券利息支出	773,532.21	173,527.55

(h) 本会计报告期内本基金各关联方无投资本基金的情况

第八节 投资组合报告

一、报告期末基金资产组合

资产类别	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
债券投资	823,251,381.07	52.20
买入返售证券	–	–
其中:买断式回购的买入返售证券	–	–
银行存款和清算备付金合计	354,759,192.19	22.50
其中:定期存款	–	–
资产支持证券	–	–
其他资产	399,002,604.49	25.30
合计:	1,577,013,177.75	100.00

二、报告期债券回购融资情况

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	30,056,700,000.00	4.87
	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	–	–

1、上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每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。

2、根据《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》（证监基金字[2005]41 号）,自 2005 年 4 月 1 日起,除发生巨额赎回,货币市场基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值 20%。本基金在 2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日期间不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的情况。

三、基金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:

项 目	天 数
报告期末投资组合平均剩余期限	128
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	176
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	87

注:本报告期内,本基金投资组合的平均剩余期限在每工作日均未超过 180 天。

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	22.72	–
2	30天(含)—60 天	4.50	–
3	60天(含)—90 天	1.27	–
4	90天(含)—180 天	19.09	–
5	180天(含)—397 天（含）	27.86	–
合 计		75.44	–

四、报告期末债券投资组合

1、 按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	–	–
2	金融债券	100,288,623.90	6.42
	其中:政策性金融债	100,288,623.90	6.42
3	央行票据	112,940,697.65	7.23
4	企业债券	610,022,059.52	39.07
5	其他	–	–
合计		823,251,381.07	52.72
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券		–	–

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

1、 基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张)		成本(元)	占基金资产净值比例(%)
		自有投资	买断式回购		
1	06农发 08	1,000,000	–	100,288,623.90	6.42
2	06百联 CP01	700,000	–	70,307,248.26	4.50
3	06铁通 CP01	700,000	–	68,550,504.88	4.39
4	06国航 CP01	600,000	–	60,375,054.96	3.87
5	06莱钢 CP01	600,000	–	59,320,440.96	3.80
6	06国开投 CP02	600,000	–	58,646,069.13	3.76
7	06联通 CP03	500,000	–	50,144,778.50	3.21
8	06江铜 CP02	500,000	–	50,077,353.20	3.21
9	06济钢 CP02	500,000	–	49,222,317.05	3.15
10	06西电 CP01	500,000	–	49,211,612.84	3.15

注:上表中,“债券数量”中的“自有投资”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券卖出后的余额。

二、“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	34
报告期内偏离度的最高值	0.0817%
报告期内偏离度的最低值	-0.4721%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0. 1199%

三、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细。

无。

四、投资组合报告附注

1、基金计价方法说明

本基金的债券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

2、本报告期内,本基金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 20%的情况。

3、本报告期内需说明的证券投资决策程序

报告期内,基金管理人的投资决策严格按照招募说明书和基金合同进行,所有投资品种均没有超出债券池的范围,没有需要特别说明和补充的部分。

4、其他资产的构成

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	5,513,515.22
4	应收申购款	393,489,089.27
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
合 计		399,002,604.49

5、本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

第九节 基金份额持有人情况

一、报告期末基金份额持有人户数和持有人结构

份额级别	基金份额持有人户数（份）	平均每户持有的基金份额（份）	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额（份）	占总份额比例	持有份额（份）	占总份额比例
A级	7,803.00	82,588.53	33,690,098.87	2.16%	610,748,214.96	39.11%
B级	37.00	24,783,994.56	716,165,201.47	45.87%	200,842,597.41	12.86%
合计	7,840.00	199,164.04	748,855,300.34	48.03%	811,590,812.37	51.97%

第十节 开放式基金份额变动情况

本基金份额变动情况如下:

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	
基金合同生效日的基金份额总额	964,512,079.20	–	964,512,079.20
本报告期期初基金份额总额	2,928,551,698.69	–	2,928,551,698.69
本报告期期间总申购份额(包括转入份额、份额级别调整)	8,155,444,051.09	3,350,253,783.07	11,505,697,834.16
本报告期期间总赎回份额（包括转出份额、份额级别调整）	10,439,557,435.95	2,433,245,984.19	12,872,803,420.14
本报告期期末基金份额总额	644,438,313.83	917,007,798.88	1,561,446,112.71
注:A 级基金与分级前基金连续计算,B 级基金自 2006 年 8 月 1 日计算。			

第十一节 重大事件揭示

1、本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

2、基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动。

2006 年 5 月 27 日,基金管理人海富通基金管理有限公司（“本公司”）在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上发布关于副总经理的任命公告, 决定聘请陈洪、阎小庆先生担任本公司副总经理。

2006 年 8 月 19 日,基金管理人海富通基金管理有限公司（“本公司”）在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上发布关于缪钧伟先生不再担任本公司副总经理的公告。

2007 年 1 月 12 日,基金管理人海富通基金管理有限公司（“本公司”）在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上公告称,经公司董事会审议通过,同意杨玉良先生因工作需要辞去本公司独立董事职务,聘请杨国平先生继任本公司独立董事。

报告期内,基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

3、本报告期内无涉及本基金的管理人、基金财产、基金托管业务报告期内无诉讼事项。

4、报告期内本基金投资策略未发生改变。

5、基金收益分配事项

本报告期根据基金合同规定每日进行收益分配, 并计入投资者帐户的当前累计收益中,每月 15 日(遇节假日顺延)将投资人账户的当前累计收益结转为基金份额。

6、报告期内,本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度支付的审计费用是 8 万元。

7、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。

8、基金租用证券公司专用交易席位的有关情况如下:

名称	席位数量	回购成交量(人民币元)	占回购总成交量比例	实付佣金	佣金比率
海通证券	1	5,022,100,000.00	100.00%	11,387.10	100.00

注:上述佣金按市场佣金率计算,以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后的净额列示。

9、其他在报告期内发生的重大事件,以及基金管理人判断为重大事件的事项。

(1.) 2006 年 1 月 6 日,本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于海富通货币市场证券投资基金投资中石化集团短期融资券的公告。

(2.) 2006 年 1 月 17 日,本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了海富通基金管理有限公司关于旗下基金代销机构华夏证券变更为中信建投证券的公告。

(3.) 2006 年 1 月 17 日、4 月 21 日、6 月 13 日、本基金的管理人海富通基金管理有限公司分别就增加中银国际证券有限责任公司、深圳发展银行、招商银行股份有限公司为本基金的代销机构在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》刊登公告。

(4.) 2006 年 2 月 15 日、8 月 15 日,本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了《海富通货币市场证券投资基金更新招募说明书》。

(5.) 2006 年 2 月 22 日,本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了增加注册资本和变更股东出资比例的公告,海富通基金管理有限公司的注册资本由人民币 1 亿元增加至人民币 1.5 亿元,双方的出资比例从原来的 67%:33%变更为 51%:49%。

(6.) 2006 年 4 月 18 日,本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于海富通货币市场证券投资基金投资上海强生控股股份有限公司短期融资券的公告。

(7.) 2006 年 4 月 24 日,本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于海富通货币市场基金五一长假前两个工作日暂停申购和转换转入业务的公告。

(8.) 2006 年 6 月 16 日,本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于推出旗下基金优惠申购和转换费率的公告。

(9.) 2006 年 7 月 26 日,本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了海富通货币市场基金关于销售服务费分级并暂停三天申购、赎回公告及关于修改《海富通货币市场证券投资基金基金合同》、《海富通货币市场证券投资基金更新招募说明书》有关内容的公告。

(10.)2006 年 9 月 6 日,本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于旗下基金增加定期定额申购业务代销机构的公告。

(11.)2006 年 9 月 25 日,本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于海富通货币市场基金国庆长假前两个工作日暂停申购和转换转入业务的公告。

第十二节 备查文件

一、备查文件目录

（一）中国证券监督管理委员会批准设立海富通货币市场证券投资基金的文件
（二）海富通货币市场证券投资基金基金合同
（三）海富通货币市场证券投资基金招募说明书
（四）海富通货币市场证券投资基金托管协议
（五）中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
（六）报告期内海富通货币市场证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

二、存放地点:上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼基金管理人办公地址。

三、查阅方式:投资者可于营业时间查阅,或登录基金管理人网站查阅。

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:021-38784858;40088-40099

网址:www.hftfund.com

海富通基金管理有限公司
二〇〇七年三月三十一日