# 海富通货币市场证券投资基金

## 2014 年度报告摘要

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
报告送出日期：二〇一五年三月三十日

### §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2015年3月27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。

本报告期自2014年1月1日起至2014年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 | |
| 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 | |
| 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 | 4,143,065,890.91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 | 1,538,716,156.45份 | 2,604,349,734.46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 | 王永民 |
| | 联系电话 | 021-38650891 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | wrxi@hftfund.com | fcid@bankofchina.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 | 2014年 | | 2013年 | | 2012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 | 45,990,548.34 | 175,124,336.26 | 27,571,637.22 | 130,685,924.61 | 42,849,850.68 | 120,476,765.88 |
| 本期利润 | 45,990,548.34 | 175,124,336.26 | 27,571,637.22 | 130,685,924.61 | 42,849,850.68 | 120,476,765.88 |
| 本期净值收益率 | 4.7915% | 5.0416% | 3.6487% | 3.8981% | 4.0713% | 4.3199% |
| 3.1.2期末数据和指标 | 2014年末 | | 2013年末 | | 2012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 | 1,538,716,156.45 | 2,604,349,734.46 | 453,650,041.29 | 1,823,283,162.19 | 2,156,358,314.79 | 7,029,249,501.99 |
| 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 | 1.1769% | 0.0051% | 0.7210% | 0.0003% | 0.4559% | 0.0048% |
| 过去六个月 | 2.2717% | 0.0042% | 1.4742% | 0.0003% | 0.7975% | 0.0039% |
| 过去一年 | 4.7915% | 0.0043% | 2.9726% | 0.0002% | 1.8189% | 0.0041% |
| 过去三年 | 13.0371% | 0.0045% | 9.5035% | 0.0005% | 3.5336% | 0.0040% |
| 过去五年 | 19.7198% | 0.0049% | 15.7008% | 0.0010% | 4.0190% | 0.0039% |
| 自基金合同生效起至今 | 36.9206% | 0.0072% | 30.8492% | 0.0018% | 6.0714% | 0.0054% |

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 | 1.2378% | 0.0051% | 0.7210% | 0.0003% | 0.5168% | 0.0048% |
| 过去六个月 | 2.3945% | 0.0042% | 1.4742% | 0.0003% | 0.9203% | 0.0039% |
| 过去一年 | 5.0416% | 0.0043% | 2.9726% | 0.0002% | 2.0690% | 0.0041% |
| 过去三年 | 13.8508% | 0.0045% | 9.5035% | 0.0005% | 4.3473% | 0.0040% |
| 过去五年 | 21.1612% | 0.0049% | 15.7008% | 0.0010% | 5.4604% | 0.0039% |
| 自基金合同生效起至今 | 34.8556% | 0.0073% | 27.2292% | 0.0016% | 7.6264% | 0.0057% |

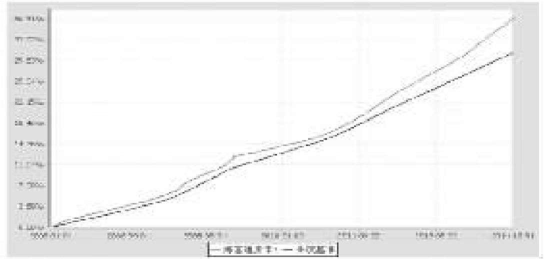
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通货币市场证券投资基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

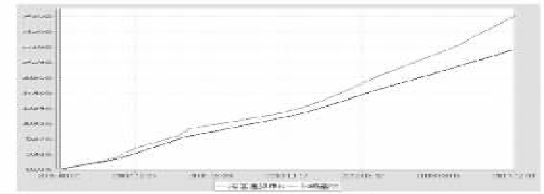
1. 海富通货币A

(2005年1月4日至2014年12月31日)



2. 海富通货币B

(2006年8月1日至2014年12月31日)



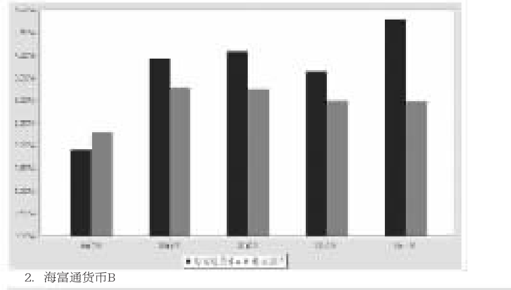
注：本基金合同于2005年1月4日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起3个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十五条(二)投资范围、(六)投资组合中规定的各项比例。

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

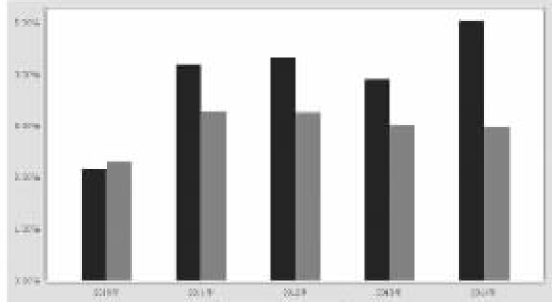
海富通货币市场证券投资基金

过去五年基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

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

海富通货币A：

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2014年 | 35,133,247.34 | 8,760,368.84 | 2,096,932.16 | 45,990,548.34 | - |
| 2013年 | 24,590,140.21 | 4,739,446.95 | -1,757,949.94 | 27,571,637.22 | - |
| 2012年 | 35,026,656.70 | 6,981,662.52 | 841,531.46 | 42,849,850.68 | - |
| 合计 | 94,750,044.25 | 20,481,478.31 | 1,180,513.68 | 116,412,036.24 | - |

海富通货币B：

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2014年 | 148,603,415.97 | 23,694,176.11 | 2,826,744.18 | 175,124,336.26 | - |
| 2013年 | 107,092,714.05 | 26,904,247.17 | -3,311,036.61 | 130,685,924.61 | - |
| 2012年 | 99,468,638.95 | 18,686,538.22 | 2,321,588.71 | 120,476,765.88 | - |
| 合计 | 355,164,768.97 | 69,284,961.50 | 1,837,296.28 | 426,287,026.75 | - |

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。截至2014年12月31日，本基金管理人共管理32只公募基金：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、海富通稳进增利债券型证券投资基金（LOF）、海富通国策导向股票型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通现金管理货币市场基金、海富通养老收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通双利分级债券型证券投资基金、海富通内需热点股票型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双福分级债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金。

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 | | |
| 位健 | 本基金的基金经理，海富通养老收益混合基金经理，海富通一年定开债券基金经理，海富通双利分级债券基金经理 | 2013-01-30 | 2014-03-07 | 8年 | 硕士，持有基金从业人员资格证书。2005年3月至2010年5月任银河基金基金经理，2006年3月至2008年4月担任银河银富货币市场基金基金经理助理，2008年4月至2010年5月担任银河银富货币市场基金基金经理。2010年6月至2012年9月任英大证券投资副总监。2012年9月至2012年11月任浙金信托投资总监。2012年12月加入海富通基金管理有限公司。2013年1月至2014年3月任海富通货币基金经理，2013年5月至2014年3月任海富通养老收益混合基金经理，2013年10月至2014年3月任海富通一年定开债券基金经理，2013年12月至2014年3月任海富通双利分级债券基金经理。 |
| 陈铁平 | 本基金的基金经理；海富通季季增利理财债券基金经理；海富通上证可质押城投债ETF基金经理 | 2013-08-29 | - | 5年 | 博士，特许金融分析师（CFA），持有基金从业人员资格证书，2009年1月至2009年8月任Mariner Investment Group LLC 分析师，2009年10月至2011年9月任瑞银企业管理(上海)有限公司副董事，2011年10月加入海富通基金管理有限公司，任债券投资经理，2013年8月起任海富通货币基金经理。2014年8月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014年11月兼任海富通上证可质押城投债ETF基金经理。 |
| 何谦 | 本基金的基金经理助理 | 2014-06-05 | - | 4年 | 硕士，持有基金从业人员资格证书。历任平安银行资金交易员，华安基金管理有限公司债券交易员，2014年6月加入海富通基金管理有限公司。2014年6月起任海富通货币基金经理助理。 |

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。

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公平交易制度和控制方法

公司根据证监会2011年发布的《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，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，公司建立了严格的投资交易行为监控制度，公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部、监察稽核部和风险管理部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

4.3.2公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，对公司旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了95%置信区间，假设溢价率为0的T分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

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，未发生投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

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

2014年国内经济基本面较为疲弱，经济下行压力加大，加之央行采取的较为宽松的货币政策，在保持流动性总量适度充裕的同时引导市场利率下行，资金面整体稳中趋松，债券市场呈现出明显的"牛市"格局。2014年的利率债市场上演了一幕波澜壮阔的牛市行情，在逐步摆脱2013年非基本面冲击之后，债券市场重回基本面驱动。纵观全年的债市走势，大致可以细分为4个阶段：上半年收益率下行，债券估值修复，牛市行情启动；7月份至8月份收益率阶段性反弹，经济数据好转昙花一现；9月份至11月份牛市重启，收益率深度下探，宽松量价齐行；12月份市场震荡调整，资金周期性紧张，市场黑天鹅事件不断。2014年国内经济运行情况不断走弱，反映出内生增长动力的不足和外围环境改善的有限。定向宽松货币政策效果有限，货币市场利率持续走低与实体资金成本居高不下的矛盾亟待破解，预计央行宽松的政策思路会在中短期内继续保持，若实体经济进一步下滑，不排除将有更大的刺激政策出台。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内，A级基金净值收益率为4.7915%，同期业绩比较基准收益率为2.9726%；B级基金净值收益率为5.0416%，同期业绩比较基准收益率为2.9726%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济基本面估计在一季度难改弱势，而通缩风险未消，短期看基本面对利率债长端仍有支撑，但从全年看，随着各项托底政策的效力逐步显现，经济下滑速度可能有所放缓。货币政策预计仍以定向宽松为主，但也不排除进一步降息或降准的可能，主要取决于政府和央行对经济走势以及汇率等因素的考量。资金面方面，随着存贷比解锁银行信贷投放能力增加，加上每月的IPO扰动、预计货币利率中枢在春节前难以大幅下降，但全年看，货币政策的变化仍是决定资金面的核心因素。对于利率债而言，2015年全年或许难有系统性机会，预计整体收益率大概率将在一定区间内波动，如想突破需等待进一步宽松信号的出现。

有鉴于此，将努力维持结构的稳定性，保持好组合流动性和收益性之间的平衡，在保证安全性的前提下，力争为持有人创造更好的投资收益。

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45，990，548.34元，货币B级175，124，336.26元。

二、已实施的利润分配：货币A级已分配42，967，545.37元，货币B级已分配169，580，920.27元。

三、应分配但尚未实施的利润：已分配但未支付的8，566，418.96元。 应于收益支付日2015年1月15日按1.000元的份额面值结转为基金份额。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

### §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。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。

h

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）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：2014年12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末<br>2014年12月31日 | 上年度末<br>2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 2,947,645,918.06 | 1,202,780,636.03 |
| 结算备付金 | - | - |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 1,953,023,093.15 | 1,126,107,568.15 |
| 其中：股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 1,953,023,093.15 | 1,126,107,568.15 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | | |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | 60,000,660.00 |
| 应收证券清算款 | - | 20,045,833.33 |
| 应收利息 | 68,072,902.04 | 26,337,905.43 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 610.00 | 242,985,369.02 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 4,968,742,523.25 | 2,678,257,971.96 |
| 负债和所有者权益 | 本期末<br>2014年12月31日 | 上年度末<br>2013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 | 809,798,985.29 | 394,499,362.75 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | 4,179,757.44 | 838,873.81 |
| 应付管理人报酬 | 1,644,968.65 | 595,445.00 |
| 应付托管费 | 498,475.38 | 180,437.89 |
| 应付销售服务费 | 424,974.64 | 104,285.06 |
| 应付交易费用 | 85,347.51 | 44,782.05 |
| 应交税费 | - | 988,000.00 |
| 应付利息 | 115,358.34 | 34,443.70 |
| 应付利润 | 8,566,418.96 | 3,642,742.62 |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 362,346.13 | 396,395.60 |
| 负债合计 | 825,676,632.34 | 401,324,768.48 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 4,143,065,890.91 | 2,276,933,203.48 |
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 4,143,065,890.91 | 2,276,933,203.48 |
| 负债和所有者权益总计 | 4,968,742,523.25 | 2,678,257,971.96 |

注：报告截止日2014年12月31日，基金份额净值1.000元，基金份额总额4，143，065，890.91，其中A级基金份额1，538，716，156.45份，其中B级基金份额2，604，349，734.46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：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年12月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 257,563,277.08 | 187,026,228.31 |
| 1.利息收入 | 242,256,592.85 | 180,974,819.01 |
| 其中：存款利息收入 | 149,860,591.22 | 86,715,422.53 |
| 债券利息收入 | 91,936,998.93 | 80,428,616.14 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 459,002.70 | 13,830,780.34 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以"-"填列） | 15,306,684.23 | 6,051,159.30 |
| 其中：股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 15,306,684.23 | 6,051,159.30 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | |
| 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） | - | 250.00 |
| 减：二、费用 | 36,448,392.48 | 28,768,666.48 |
| 1.管理人报酬 | 15,283,014.39 | 14,040,767.58 |
| 2.托管费 | 4,631,216.63 | 4,254,778.04 |
| 3.销售服务费 | 2,876,117.16 | 2,286,864.25 |
| 4.交易费用 | 200.00 | 100.00 |
| 5.利息支出 | 13,142,761.14 | 7,688,933.70 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 13,142,761.14 | 7,688,933.70 |
| 6.其他费用 | 515,083.16 | 497,222.91 |
| 三、利润总额（亏损总额以"-"号填列） | 221,114,884.60 | 158,257,561.83 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以"-"号填列） | 221,114,884.60 | 158,257,561.83 |

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：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014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） | 2,276,933,203.48 | - | 2,276,933,203.48 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 221,114,884.60 | 221,114,884.60 |
| 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） | 1,866,132,687.43 | - | 1,866,132,687.43 |
| 其中：1.基金申购款 | 27,624,563,087.53 | - | 27,624,563,087.53 |
| 2.基金赎回款 | -25,758,430,400.10 | - | -25,758,430,400.10 |
| 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） | - | -221,114,884.60 | -221,114,884.60 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 4,143,065,890.91 | - | 4,143,065,890.91 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013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） | 9,185,607,816.78 | - | 9,185,607,816.78 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 158,257,561.83 | 158,257,561.83 |
| 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） | -6,908,674,613.30 | - | -6,908,674,613.30 |
| 其中：1.基金申购款 | 19,133,175,300.03 | - | 19,133,175,300.03 |
| 2.基金赎回款 | -26,041,849,913.33 | - | -26,041,849,913.33 |
| 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） | - | -158,257,561.83 | -158,257,561.83 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 2,276,933,203.48 | - | 2,276,933,203.48 |

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：

基金管理人负责人：张文伟，主管会计工作负责人：陶网雄，会计机构负责人：张琦

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，本基金分设两级基金份额：A级基金份额和B级基金份额，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2015年3月25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日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称"企业会计准则"）、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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2014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2014年12月31日的财务状况以及2014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

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，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。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

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、基金销售机构 |
| 海通证券股份有限公司（"海通证券"） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 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<br>2014年1月1日至2014年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013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 | 100,000,000.00 | 100.00% | 3,100,000,000.00 | 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<br>2014年1月1日至2014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 | 1,100.00 | 100.00% | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013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 | 34,100.00 | 100.00% | 1,210.00 | 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<br>2014年1月1日至2014年12月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 15,283,014.39 | 14,040,767.58 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,358,183.57 | 1,231,511.68 |

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<br>2014年1月1日至2014年12月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,631,216.63 | 4,254,778.04 |

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<br>2014年1月1日至2014年12月31日<br>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 | 1,025,511.40 | 55,610.79 | 1,081,122.19 |
| 海通证券 | 8,635.19 | - | 8,635.19 |
| 海富通 | 86,840.50 | 248,232.65 | 335,073.15 |
| 合计 | 1,120,987.09 | 303,843.44 | 1,424,830.53 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31日<br>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 | 274,591.73 | 5,317.88 | 279,909.61 |
| 海通证券 | 14,044.18 | 1,576.63 | 15,620.81 |
| 海富通 | 125,446.36 | 293,154.71 | 418,601.07 |
| 合计 | 414,082.27 | 300,049.22 | 714,131.49 |

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<br>2014年1月1日至2014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 | - | 20,101,545.75 | - | - | 19,518,442,000.00 | 2,230,588.92 |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013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 | - | 60,919,422.47 | - | - | 11,949,340,000.00 | 2,248,189.13 |

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<br>2014年1月1日至2014年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013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-活期存款 | 7,645,918.06 | 58,437.69 | 2,780,636.03 | 455,612.45 |
| 中国银行-定期存款 | - | 195,611.11 | - | 3,358,666.67 |
| 合计 | 7,645,918.06 | 254,048.80 | 2,780,636.03 | 3,814,279.12 |

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2014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0.18%（2013年12月31日：0.12%）。

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（2014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

截至本报告期末2014年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额809，798，985.29元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|
| 041456055 | 14滨建投CP004 | 1906-03-01 | 99.82 | 1,500,000 | 149,730,000.00 |
| 041451055 | 14八钢CP004 | 1906-03-01 | 99.83 | 1,000,000 | 99,830,000.00 |
| 011499073 | 14山水SCP002 | 1906-03-01 | 99.71 | 1,000,000 | 99,710,000.00 |
| 011481006 | 14淮南矿SCP006 | 1906-03-01 | 99.71 | 800,000 | 79,768,000.00 |
| 041454024 | 14宁熊猫CP001 | 1906-03-01 | 100.69 | 500,000 | 50,345,000.00 |
| 140443 | 14农发43 | 1906-03-01 | 100.14 | 500,000 | 50,070,000.00 |
| 140230 | 14国开30 | 1906-03-01 | 99.81 | 500,000 | 49,905,000.00 |
| 011499056 | 14豫能源SCP002 | 1906-03-01 | 99.51 | 500,000 | 49,755,000.00 |
| 041466007 | 14冀水泥CP002 | 1906-03-01 | 100.58 | 300,000 | 30,174,000.00 |
| 140207 | 14 国开07 | 1906-03-01 | 100.15 | 300,000 | 30,045,000.00 |
| 140212 | 14国开12 | 1906-03-01 | 100.13 | 230,000 | 23,029,900.00 |
| 011481003 | 14淮南矿SCP003 | 1906-03-01 | 100.24 | 210,000 | 21,050,400.00 |
| 041462006 | 14南通国投CP001 | 1906-03-01 | 100.85 | 200,000 | 20,170,000.00 |
| 140430 | 14农发30 | 1906-03-01 | 100.17 | 200,000 | 20,034,000.00 |
| 041466031 | 14冀水泥CP003 | 1906-03-01 | 99.43 | 200,000 | 19,886,000.00 |
| 041460027 | 14湘高速CP001 | 1906-03-01 | 100.92 | 129,000 | 13,018,680.00 |
| 140317 | 14进出17 | 1906-03-01 | 100.06 | 100,000 | 10,006,000.00 |
| 011473005 | 14鲁高速SCP005 | 1906-03-01 | 100.00 | 50,000 | 5,000,000.00 |
| 合计 | | | | 8,219,000 | 821,526,980.00 |

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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2014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次的余额为1，953，023，093.15元，无属于第一层次和第三层次的余额（2013年12月31日：第二层次1，126，107，568.15元，无属于第一层次和第三层次的余额）。

(ii) 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次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2013年12月31日：同）。

(d) 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。

(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 | 1,953,023,093.15 | 39.31 |
| | 其中：债券 | 1,953,023,093.15 | 39.31 |
| | 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 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,947,645,918.06 | 59.32 |
| 4 | 其他各项资产 | 68,073,512.04 | 1.37 |
| 5 | 合计 | 4,968,742,523.25 | 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 | 9.99 | |
| | 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 | 809,798,985.29 | 19.55 |
| | 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。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

| 序号 | 发生日期 | 融资余额占基金资产净值的比例（%） | 原因 | 调整期 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 2014-08-29 | 20.68 | 大额赎回 | 一个工作日内调整完毕 |

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 | 139 |
| 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 | 67 |

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。

8.3.2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 | 5.01 | 19.55 |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天（含）—60天 | 11.57 | - |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 1.91 | - |
| 3 | 60天（含）—90天 | 32.35 | - |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天（含）—180天 | 42.00 | - |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天（含）—397天（含） | 27.35 | - |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 6 | 合计 | 118.29 | 19.55 |

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 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 229,854,087.16 | 5.55 |
| | 其中：政策性金融债 | 229,854,087.16 | 5.55 |
| 4 | 企业债券 | 158,807,768.11 | 3.83 |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,564,361,237.88 | 37.76 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 1,953,023,093.15 | 47.14 |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 79,231,012.84 | 1.91 |

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 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 041456055 | 14滨建投CP004 | 1,500,000 | 149,914,525.94 | 3.62 |
| 2 | 041453118 | 14酒钢CP002 | 1,500,000 | 149,877,422.41 | 3.62 |
| 3 | 041451055 | 14八钢CP004 | 1,000,000 | 100,000,112.46 | 2.41 |
| 4 | 011499073 | 14山水SCP002 | 1,000,000 | 99,966,605.07 | 2.41 |
| 5 | 011481006 | 14淮南矿SCP006 | 800,000 | 80,008,335.47 | 1.93 |
| 6 | 058031 | 05中信债1 | 800,000 | 79,576,755.27 | 1.92 |
| 7 | 068007 | 06首都机场债 | 800,000 | 79,231,012.84 | 1.91 |
| 8 | 140207 | 14国开07 | 700,000 | 70,070,175.56 | 1.69 |
| 9 | 041456007 | 14奇瑞CP001 | 600,000 | 60,226,539.54 | 1.45 |
| 10 | 011481002 | 14淮南矿SCP002 | 500,000 | 50,033,967.40 | 1.21 |

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 | 40 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.4164% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.1123% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1917% |

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 | 68,072,902.04 |
| 4 | 应收申购款 | 610.00 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 68,073,512.04 |

### §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

| 序号 | 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 | 43,625 | 35,271.43 | 56,304,953.15 | 3.66% | 1,482,411,203.30 | 96.34% |
| 海富通货币B | 124 | 21,002,820.44 | 2,040,843,086.17 | 78.36% | 563,506,648.29 | 21.64% |
| 合计 | 43,749 | 94,700.81 | 2,097,148,039.32 | 50.62% | 2,045,917,851.59 | 49.38% |

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 |
|---|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 海富通货币A | 1,731,272.20 | 0.1125% |
| | 海富通货币B | - | - |
| | 合计 | 1,731,272.20 | 0.0418% |

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|---|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 海富通货币A | >100 |
| | 海富通货币B | 0 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 海富通货币A | 0 |
| | 海富通货币B | 0 |
| | 合计 | 0 |

### §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 | 453,650,041.29 | 1,823,283,162.19 |
| 本报告期基金总申购份额 | 9,137,628,957.50 | 18,283,337,497.98 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 8,052,562,842.34 | 17,502,270,925.71 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,538,716,156.45 | 2,604,349,734.46 |

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

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

1、2014年6月14日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第四届董事会审议通过，同意陈洪先生辞去公司副总经理职务。

2、2014年9月27日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司2014年第二次股东会议审议通过，聘请魏海诺（Mr. Bruno Weil）先生担任本公司监事。同时，谷若鸿(Mr. Laurent couraudon)先生不再担任本公司监事。

3、2014年10月24日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第四届董事会第四次会议审议通过，聘请孟辉先生担任本公司副总经理。

4、2014年11月4日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第四届董事会第四次会议审议通过，聘请何树方先生担任本公司副总经理。

5、2014年11月4日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第四届董事会第四次会议审议通过，聘请戴德舜先生担任本公司副总经理。

6、2015年1月17日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司职工代表大会民主选举，公司股东会审议通过，聘请俞涛先生担任本公司职工监事，高勇前先生因个人原因离职，不再担任本公司职工监事。

7、2015年2月14日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第四届董事会第三十六次临时会议审议通过，同意田仁灿先生辞去公司总经理职务，并决定由公司董事长张文伟先生代为履行总经理职务，代为履行总经理职务的期限不超过90日。公司已按有关规定向中国证券监督管理委员会和上海监管局报告。

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告，自2014年2月13日起，陈四清先生担任本行行长。

报告期内本基金托管人的专门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105，000.00元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是10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

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 海通证券 | 1 | - | - | 1,100.00 | 100.00% | - |

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

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。

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 | - | - | 100,000,000.00 | 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32只公募基金。截至2014年12月31日，海富通管理的公募基金资产规模为287亿元人民币。

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2014年12月31日，海富通为80多家企业超过347亿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2014年12月31日，海富通旗下专户理财管理资产规模超过65亿元。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。2012 年9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。

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2014年12月31日，投资咨询及海外业务规模超过220亿元人民币。2011年12月，海富通全资子公司——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，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012年2月，海富通资产管理（香港）有限公司已募集发行了首只RQFII产品。

2012年3月，国内权威财经媒体《中国证券报》等授予海富通基金管理有限公司"中国基金业金牛基金管理公司"大奖，《证券时报》授予 海富通精选混合基金"2011年中国基金业明星奖—五年持续回报平衡混合型明星基金"荣誉。2013年4月，《上海证券报》授予海富通精选混合基金2012年"金基金"奖——分红基金奖。

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。几年来，海富通的公益行动进一步升级，持续为上海民工小学学生捐献生活物资，并向安徽农村小学捐献图书室。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。

本报告期内，本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

海富通基金管理有限公司
二〇一五年三月三十日