海富通货币市场证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:二〇一九年三月三十日

§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2019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。

本报告期自2018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	
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	18,550,087,836.61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	290,144,158.95份	18,259,943,677.66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	葵万荣	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	2018年		2017年		2016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	12,076,976.43	837,349,737.81	18,270,363.66	686,224,577.99	16,111,912.48	427,949,566.69
本期利润	12,076,976.43	837,349,737.81	18,270,363.66	686,224,577.99	16,111,912.48	427,949,566.69
本期净值收益率	3.4328%	3.6812%	3.7816%	4.0307%	2.4126%	2.6588%
3.1.2期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016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	290,144,158.95	18,259,943,677.66	642,280,282.60	20,399,426,615.00	936,827,517.79	13,511,609,732.09
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	0.6884%	0.0006%	0.3760%	0.0000%	0.3124%	0.0006%
过去六个月	1.4410%	0.0007%	0.7534%	0.0000%	0.6876%	0.0007%
过去一年	3.4328%	0.0017%	1.5000%	0.0000%	1.9328%	0.0017%
过去三年	9.9339%	0.0021%	4.5721%	0.0000%	5.3618%	0.0021%
过去五年	19.5349%	0.0035%	9.9586%	0.0016%	9.5763%	0.0019%
自基金合同生效起至今	56.1843%	0.0063%	39.7264%	0.0021%	16.4579%	0.0042%

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	0.7492%	0.0006%	0.3760%	0.0000%	0.3732%	0.0006%
过去六个月	1.5637%	0.0007%	0.7534%	0.0000%	0.8103%	0.0007%
过去一年	3.6812%	0.0017%	1.5000%	0.0000%	2.1812%	0.0017%
过去三年	10.7279%	0.0021%	4.5721%	0.0000%	6.1558%	0.0021%
过去五年	20.9748%	0.0035%	9.9586%	0.0016%	11.0162%	0.0019%
自基金合同生效起至今	55.3111%	0.0062%	35.8609%	0.0021%	19.4502%	0.0041%

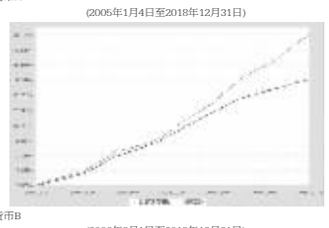
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

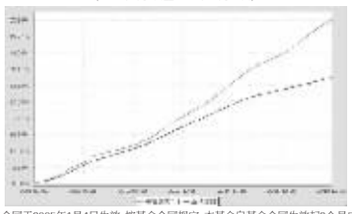
1. 海富通货币A

(2005年1月4日至2018年12月31日)



2. 海富通货币B

(2006年8月1日至2018年12月31日)



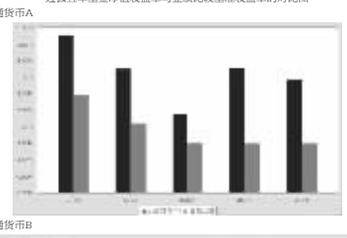
注:本基金合同于2005年1月4日生效,按基金合同规定,本基金自基金合同生效起3个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十五条(二)投资范围、(六)投资组合中规定的各项比例。

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

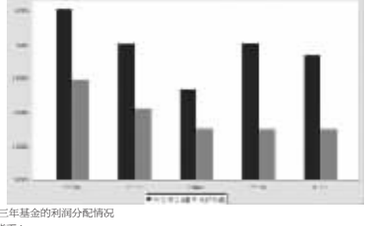
海富通货币市场证券投资基金

过去五年基金净值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
2018	11,415,360.52	1,183,500.41	-521,884.50	12,076,976.43	-
2017	15,477,156.22	2,820,700.26	-27,492.82	18,270,363.66	-
2016	14,198,721.91	2,370,371.89	-457,181.32	16,111,912.48	-
合计	41,091,238.65	6,374,572.56	-1,006,558.64	46,459,252.57	-

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
2018	725,236,048.82	117,418,742.32	-5,305,053.33	837,349,737.81	-
2017	542,877,119.41	130,587,773.69	12,759,684.89	686,224,577.99	-
2016	350,910,204.39	79,891,738.44	-2,852,376.14	427,949,566.69	-
合计	1,619,023,372.62	327,898,254.45	4,602,255.42	1,951,523,882.49	-

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"法国巴黎资产管理BE控股公司")于2003年4月1日共同发起设立。截至2018年12月31日,本基金管理人共管理58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、海富通股票混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选武弓混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证100指数证券投资基金(LOF)、海富通中小盘混合型证券投资基金、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、海富通大中华精选混合型证券投资基金、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、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通安顺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、海富通内需热点混合型证券投资基金、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、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金(LOF)、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通富睿混合型证券投资基金、海富通睿海混合基金、海富通瑞福一年定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)、海富通量化前锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金。

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		
陈轶平	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;海富通欣享纯债债券基金经理;海富通一年定开债券基金经理;海富通富祥混合基金经理;海富通瑞丰一年定开债券基金经理;海富通美元债(ODII)基金经理;海富通上证周期产业债ETF基金经理;海富通瑞利债券基金经理;海富通瑞合纯债基金经理;海富通富睿混合基金经理;海富通瑞福一年定开债券基金经理;海富通瑞祥一年定开债券基金经理;海富通恒丰定开债券基金经理;海富通上证10年期地方政府债ETF基金经理;海富通弘丰定开债券基金经理。固定收益投资副总监。	2013-08-29	-	9年	博士,CFA。持有基金从业人员资格证书。历任Mariner Investment Group LLC数量金融分析师,瑞银企业管理(上海)有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事,2011年10月加入海富通基金管理有限公司,历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监,现任固定收益投资副总监。2013年8月起任海富通货币基金经理。2014年9月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014年11月起兼任海富通上证可质押城投债ETF基金经理。2015年12月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015年12月至2017年9月兼任海富通稳进增利债券(LOF)基金经理。2016年4月起兼任海富通一年定开债券基金经理。2016年7月起兼任海富通富祥混合基金经理。2016年8月起兼任海富通瑞丰一年定开债券基金经理。2016年8月至2017年11月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016年11月起兼任海富通美元债(ODII)基金经理。2017年1月起兼任海富通上证周期产业债ETF基金经理。2017年2月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017年3月至2018年6月兼任海富通富睿债券基金经理。2017年3月起兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017年5月起兼任海富通富睿混合基金经理。2017年7月起兼任海富通瑞福一年定开债券、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017年7月至2018年12月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018年4月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018年10月起兼任海富通上证10年期地方政府债ETF基金经理。2018年11月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。	
谈云飞	本基金的基金经理;海富通季季增利理财债券基金经理;海富通新内需混合基金经理;海富通稳健添利债券基金经理;海富通欣荣混合基金经理;海富通强化回报混合基金经理;海富通季季增利理财债券基金经理。	2016-02-26	-	13年	硕士,持有基金从业人员资格证书。2005年4月至2014年6月就职于华宝兴业基金管理有限公司,曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理,2014年6月加入海富通基金管理有限公司。2014年7月至2015年10月任海富通现金管理货币基金经理。2014年9月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2015年1月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015年4月起兼任海富通新内需混合基金经理。2016年2月起兼任海富通货币基金经理。2016年4月至2017年6月兼任海富通纯债债券、海富通双福债券(原海富通双福分级债券)、海富通双利债券基金经理。2016年4月起兼任海富通安顺收益混合基金经理。2016年9月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2017年2月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2017年3月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017年3月至2018年1月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017年7月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。
何谦	本基金的基金经理;海富通纯债债券基金经理;海富通双福债券基金经理;海富通欣享纯债债券基金经理;海富通强化回报混合基金经理;海富通利债券基金经理;海富通瑞利债券基金经理;海富通瑞合纯债基金经理;海富通添益货币市场基金经理;海富通聚丰纯债债券基金经理。	2016-05-06	-	8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,任海富通货币基金经理助理。2016年5月至2017年10月兼任海富通双利债券基金经理。2016年5月起任海富通纯债债券、海富通双福债券(原海富通双福分级债券)及海富通货币基金经理。2016年9月起兼任海富通集利债券基金经理。2017年8月起兼任海富通添益货币基金经理。2018年11月起兼任海富通聚丰纯债债券基金经理。

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。

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,本着诚实用开、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、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、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。

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、投资部门、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,保证本报告期内公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

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。

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

2018年经济逐步回落,通胀中枢下行。供给端,工业增加值逐步下滑,工业企业利润见顶后已进入下行通道;需求端,消费整体平稳走弱,出口相对显韧性,而融资渠道的收紧和地方债务的管控导致基建投资增速出现大幅下滑,虽然房地产投资和制造业投资全年呈高增长态势,但也难挡固定资产投资回落趋势。融资方面,虽然年内央行两次调整放宽社融口径,但社融存量增速仍下滑至历史新低。通胀方面,三季度有光水灾和非洲猪瘟等事件性冲击,短期内令市场对通胀预期有所升温,但是工业品价格的下行带动全年通胀中枢的回落。为了应对中美贸易摩擦和对冲经济下行压力,国内货币政策从稳健中性转向稳健偏松,全年进行了四次定向降准操作并创设了TMLF进行结构性降息,在美联储加息的环境下表现出货币政策的独立性;另一方面,下半年政策目标从"紧信用"转向"宽信用",基建托底等政策也逐步出台。利率走势方面,全年利率基本呈现单边下行,1月初至7月中旬,受货币政策稳健偏松、资金利率维持低位、中美贸易摩擦加剧等影响,利率出现大幅下行;7月下旬至9月中旬,"宽信用"政策出台、地方债加速发行、通胀预期抬升等利空因素推动利率回调;随后,在基本面明确下行、"宽信用"未见成效、海外扰动减弱等因素催化下,债市开启新一轮快速下行。2018年市场流动性处于宽松状态,3个月 SHIBOR 报价也自年初4.9%开始一路下行至2.8%的低点,年底上升至3.34%;1年金融债利率从年初的4.67%一路下行至年底的2.75%。同样,3个月期限的同业存款、同业存单的利率也大幅下行。

本基金规模呈现季节性的波动,但全年来看,规模扩张较大。本基金主要投资于同业存款、同业存单和逆回购,2018年的投资侧重于关键时点的流动性安排和资产配置,适当拉长久期,增加了逆回购的比例。全年基本实现了安全性、流动性和收益性的平衡。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A类份额净值收益率为3.4328%,同期业绩比较基准收益率为1.5000%。本基金B类份额净值收益率为3.6812%,同期业绩比较基准收益率为1.5000%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年,预计经济依然承压,通胀总体无忧。从需求角度来看,投资、消费和出口等分项仍存在一定下行压力,投资方面,基建投资作为经济重要逆周期调节手段,或结构性发力,但在地方债务制约下空间或有限;而房地化妆置力度减弱影响下,地产销售和投资或明显承压;随着企业盈利回落,制造业投资大概率下滑。消费方面,居民收入增长低迷,或制约消费增长;出口方面,全球经济动能整体回落,出口大概率下滑。通胀方面总体无忧,CPI需关注结构性压力,密切关注猪周期启动情况,而PPI中枢大概率明显下移。总体看2019年国内经济下行压力未消,政策加码的紧迫性会有所增强,预计减税降费、基建托底等一系列积极财政政策会在上半年集中出台,地方专项债和证金债等发行或提速;货币政策大概率以国内为主,央行或将延续稳健偏松和灵活操作,进一步降准的同时也存在降息的可能;而其他"宽信用"的结构性政策也有望继续加码。在上述判断下,我们认为2019年利率仍处于下行趋势中,但是随着信用逐步企稳利率下行的空间或许有限。信用债方面,"宽信用"政策下企业融资环境大概率有所改善,但国内经济下行环境中企业经营压力会加大,因此2019年信用风险将呈现结构性,因自身经营不善而导致的违约仍将无法避免。总体看受政策支持信用利差可能会逐渐收窄,同时杠杆息差策略依然可行。在稳健偏松的货币环境中,资金成本大概率维持较低水平,关键时点季节性波动,银行负债成本将会比去年进一步降低,存款存单价格进一步走低。货币基金整体收益率水平将处于低位。我们将关注宽信用政策的执行效果,对货币市场流动性的影响。

下一年,本基金在资产端管理中将继续把流动性和安全性放在重要位置,在低利率环境中谨慎拉长久期,资产配置跟负债端的周期波动相匹配,严格遵守货币基金最新法规,负债端方面,本基金也将积极进行负债端管理,稳定负债端。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成,基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会,组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等,以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。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,估值工作小组对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估,充分听取相关部门的建议,并和托管人充分协商后,向估值委员会提交估值建议报告,以便估值委员会决策。基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

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12,076,976.43元,货币B级837,349,737.81元。

二、已实施的利润分配:货币A级已分配11,749,757.47元,货币B级已分配818,209,016.13元。

三、应分配但尚未实施的利润:已分配但未支付的19,467,940.64元。应于收益支付日2019年1月16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")在海富通货币市场证券投资基金(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、基金净值收益率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(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:2018年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	10,432,757,188.75	9,742,211,390.95
结算备付金	4,727,272.73	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	4,640,452,477.25	5,571,748,526.43
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	4,640,452,477.25	5,571,748,526.43
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	3,792,651,088.99	5,524,034,486.04
应收证券清算款	-	220,549,986.94
应收利息	161,416,847.29	98,456,801.48
应收股利	-	-
应收申购款	800.00	4,900.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	19,032,005,675.01	21,157,006,091.84
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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	450,258,764.61	82,169,838.91
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	1,507,229.78	348,540.83
应付管理人报酬	7,168,126.63	5,032,506.61
应付托管费	2,172,159.59	1,525,002.01
应付销售服务费	276,556.50	248,644.33
应付交易费用	311,972.50	203,647.39
应交税费	49,763.53	-
应付利息	276,323.12	27,135.63
应付利润	19,467,940.64	25,294,878.47
递延所得税负债	-	-
其他负债	429,001.50	449,000.06
负债合计	481,917,838.40	115,299,194.24
所有者权益:		
实收基金	18,550,087,836.61	21,041,706,897.60
未分配利润	-	-
所有者权益合计	18,550,087,836.61	21,041,706,897.60
负债和所有者权益总计	19,032,005,675.01	21,157,006,091.84

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.000元,基金份额总额18,550,087,836.61,其中A级基金份额290,144,158.95份,其中B级基金份额18,259,943,677.66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:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	966,300,403.07	799,373,669.83
1.利息收入	961,393,354.23	800,525,986.82
其中:存款利息收入	509,654,138.22	488,463,479.35
债券利息收入	230,414,314.88	207,569,890.06
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	221,324,901.13	104,492,617.41
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	4,860,248.84	-1,176,334.02
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,860,248.84	-1,176,334.02
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)	46,800.00	24,017.03
减:二、费用	116,873,688.83	94,878,728.18
1. 管理人报酬	80,083,454.43	58,712,030.08
2. 托管费	24,267,713.53	17,791,524.28
3. 销售服务费	3,267,737.22	2,956,719.75
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	8,580,150.53	14,840,201.98
其中:卖出回购金融资产支出	8,580,150.53	14,840,201.98
6. 税金及附加	83,436.40	-
7. 其他费用	591,196.72	578,252.09
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	849,426,714.24	704,494,941.65
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	849,426,714.24	704,494,941.65

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:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	21,041,706,897.60	-	21,041,706,897.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	849,426,714.24	849,426,714.24
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)	-2,491,619,060.99	-	-2,491,619,060.99
其中:1.基金申购款	101,420,427,784.29	-	101,420,427,784.29
2.基金赎回款	-103,912,046,845.28	-	-103,912,046,845.28
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)	-	-849,426,714.24	-849,426,714.24
五、期末所有者权益(基金净值)	18,550,087,836.61	-	18,550,087,836.61
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	14,448,437,249.88	-	14,448,437,249.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	704,494,941.65	704,494,941.65
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)	6,593,269,647.72	-	6,593,269,647.72
其中:1.基金申购款	115,433,303,195.31	-	115,433,303,195.31
2.基金赎回款	-108,840,033,547.59	-	-108,840,033,547.59
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)	-	-704,494,941.65	-704,494,941.65
五、期末所有者权益(基金净值)	21,041,706,897.60	-	21,041,706,897.60

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:任志强,主管会计工作负责人:陶网雄,会计机构负责人:胡正万

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《海富通基金管理有限公司关于修改海富通货币市场证券投资基金基金合同的公告》,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施(货币市场基金监督管理办法)有关问题的规定》的有关规定及《海富通货币市场基金基金合同》和《海富通货币市场基金托管协议》的约定,经本基金的基金管理人与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,并经中国证监会备案,自2016年6月16日起对本基金的基金合同进行修改。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和修改后的《海富通货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于现金、期限1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券;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2019年3月28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以下简称"中国基金业协会"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、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准