海富通中证100指数证券投资基金(LOF)

【2009】第四季度报告

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:2010年1月21日

§1 重要提示

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。

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2010年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2009年10月30日(基金合同生效日)起至2009年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通中证100指数(lof)
基金主代码	162307
基金运作方式	上市型开放式
基金合同生效日	2009年10月30日
报告期末基金份额总额	2,087,148,875.30份
投资目标	采用指数化投资方式,通过有效的投资程序约束和数量化风险管理手段,控制基金投资组合相对于业绩比较基准的偏离度,实现对业绩比较基准的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证100指数×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是股票型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009-10-30至2009-12-31)
1.本期利润	52,584,670.30
2.本期已实现收益	-3,789,029.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0252
4.期末基金资产净值	2,139,733,545.60
5.期末基金份额净值	1.025

注:(1)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。

(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)基金合同在当期生效。

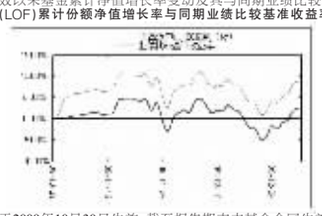
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
2009年10月30日(基金合同生效日)-2009年12月31日	2.50%	1.53%	8.76%	1.61%	-6.26%	-0.08%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

海富通中证100指数(LOF)累计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



注:1、本基金合同于2009年10月30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2009年10月30日合同生效日起至2009年12月31日,本基金运作时间未满六个月,仍处于建仓期中。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	基金经理(或基金经理小组)证券从业起始日期	说明
		任职日期	离任日期			
牟永宁	本基金的基金经理;海富通收益增长混合基金基金经理	2009年10月30日	-	14年	1995年3月1日	中国国籍,硕士,CFA。历任申银万国证券股份有限公司分析师,申万巴黎基金管理有限公司股票分析师,2004年8月加入海富通基金管理有限公司,任策略分析师、研究总监。2009年1月起任海富通收益增长混合基金基金经理;2009年10月起任海富通中证100指数(LOF)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公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

公司自成立以来,就建立了公平交易制度,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,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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

随着宏观经济的进一步好转,A股市场在2009年第四季度稳步上升,深圳成份指数、中小板指数纷纷创出年内新高。创业板市场的推出,极大的活跃了中小企业板个股的活跃度,并使得市场形成了深强沪弱的格局。中央经济工作会议明确了明年将维持宏观经济政策的延续性,并在2009年的基础上继续大力促进内需。在宏观政策支持下,消费、电子、化工等行业的表现明显优于大盘。市场对于明年地产市场会受到政府调控的担忧使得地产及相关行业的表现明显弱于大盘。

基于对国内经济景气持续向上的判断,本基金在2009年10月31日正式成立后采取了快速建仓的策略。但是,由于在本基金成立之初,市场快速上扬,本基金在建仓期内仍然大幅跑输业绩比较基准。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通中证100指数(LOF)基金净值增长率为2.5%,同期业绩比较基准收益率为8.76%,基金净值落后业绩比较基准6.26个百分点。

展望未来,2010年一季度中国宏观经济必将继续保持高速增长的势头。但2009年A股市场的持续上涨已经在相当程度上反映了这一预期,市场对于宏观刺激政策退出抑或转向的忧虑反而日渐增加,因此未来市场走势将取决于经济增长和宏观政策退出的力度和节奏,出口复苏程度和通货膨胀水平将成为关注的重要变量。

本基金将继续按照基金合同的要求,努力做好基金建仓工作,力争降低建仓成本,争取在未来取得更好的投资收益。

§5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益类投资	2,022,780,346.57	94.18
	其中:股票	2,022,780,346.57	94.18
2	固定收益类投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	121,100,751.27	5.64
	其他资产	3,991,332.31	0.19
	合计	2,147,872,430.15	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	19,685,759.10	0.92
C	制造业	4,964,275.11	0.23
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	4,964,275.11	0.23
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,860,000.00	0.69
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	12,286,810.61	0.57
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	51,796,844.82	2.42

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	240,202,162.31	11.23
C	制造业	409,846,555.28	19.15
C0	食品、饮料	82,400,834.80	3.85
C1	纺织、服装、皮毛	8,247,484.00	0.39
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	28,785,149.00	1.35
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	145,189,975.00	6.79
C7	机械、设备、仪表	145,223,112.48	6.79
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	73,578,944.18	3.44
E	建筑业	30,842,426.00	1.44
F	交通运输、仓储业	91,387,782.00	4.27
G	信息技术业	54,000,597.00	2.52
H	批发和零售贸易	31,456,764.00	1.47
I	金融、保险业	922,608,026.08	43.12
J	房地产业	92,752,327.00	4.33
K	社会服务业	15,268,765.90	0.71
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	9,039,152.00	0.42
	合计	1,970,983,501.75	92.11

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	6,001,877	108,333,879.85	5.06
2	601328	交通银行	9,530,100	89,106,435.00	4.16
3	600030	中信证券	2,800,000	88,956,000.00	4.16
4	601166	兴业银行	2,128,013	85,780,204.03	4.01
5	601318	中国平安	1,543,939	85,055,599.51	3.98
6	600016	民生银行	10,046,100	79,464,651.00	3.71
7	600000	浦发银行	2,747,681	59,597,200.89	2.79
8	601088	中国神华	1,645,833	57,307,905.06	2.68
9	000002	万？科A	5,298,800	57,280,028.00	2.68
10	601169	北京银行	2,416,600	46,737,044.00	2.18

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600489	中金黄金	200,000	11,656,000.00	0.54
2	601668	中国建筑	2,000,000	9,440,000.00	0.44
3	600547	山东黄金	99,997	8,029,759.10	0.38
4	000024	招商地产	300,000	7,989,000.00	0.37
5	601618	中国中冶	1,000,000	5,420,000.00	0.25

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
	其他	-	-
	合计	-	-

5.5 报告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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	3,966,515.95
3	应收股利	-
4	应收利息	24,816.36
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,991,332.31

5.8.4 报告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。

5.8.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	2,087,148,875.30
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,087,148,875.30

注:本基金合同于2009年10月30日生效。

§7 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11只开放式基金。截至2009年四季度末,海富通管理的公募基金资产规模近460亿元人民币。

作为首批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2009年四季度末,海富通为近50家企业超过100亿元的企业年金基金担任了投资管理人。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2009年四季度末,投资咨询业务规模超过230亿元人民币,海富通投资咨询业务成为其颇具特色的业务之一。

2009年,海富通旗下基金的业绩表现较为出色。根据晨星(Morning Star)排名,2009年全年,海富通风格优势股票基金净值增长率在股票型基金位列前1/4。

成立六年多来,海富通始终坚持"专业、专心、专注"的职业精神。2004年9月,海富通在我国基金业内率先聘请全球著名资产管理人评估机构惠誉评级(Fitch Ratings)为公司进行资产管理业务评级,在2008年复评中海富通又被升级为"惠誉M2+(中国)"资产管理人优秀评级。

海富通同时还在不断践行其社会责任。自2008年启动"绿色与希望-橄榄枝公益环保计划"以来,先后捐赠了因汶川地震严重受灾的学校、在沙化严重的内蒙古库伦旗捐建了公益林、向上海民工小学捐赠电脑、为安徽老区小学扶贫助学并捐赠物资等。

此外,海富通还积极推进投资者教育工作,在与上海交大安泰经管学院合作建立的"海富通-上海交大投资者教育研究中心"推出《股市与幸福感》调研报告后,海富通四季度与东方财富网合作,推出了为期三个月的"幸福投资路、积分赢大奖"幸福投资主题游戏活动,向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

2009年四季度内,海富通在《华西都市报》"榜样中国2009年度传媒大奖"评选中获年度最受投资者信赖基金公司奖项,海富通中国海外股票(QDII)基金获年度最佳QDII产品称号。海富通在《新闻晨报》"2009年度十大基金评选"中,获十大特色基金公司奖项、海富通中国海外股票(QDII)基金获十佳基金奖项。

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录

中国证监会批准设立海富通中证100指数证券投资基金(LOF)的文件

海富通中证100指数证券投资基金(LOF)基金合同

海富通中证100指数证券投资基金(LOF)招募说明书

海富通中证100指数证券投资基金(LOF)托管协议

中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

报告期内海富通中证100指数证券投资基金(LOF)在指定报刊上披露的各项公告

8.2存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层本基金管理人办公地址。

8.3查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
2010年1月21日

海富通货币市场证券投资基金

【2009】第四季度报告

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:2010年1月21日

§1 重要提示

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。

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2010年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2009年10月1日起至2009年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通货币	
基金主代码	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	11,134,497,053.54份	
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。	
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	
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	1,596,278,321.05份	9,538,218,732.49份
下属两级基金的风险收益特征	-	-

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

主要财务指标	海富通货币A报告期(2009-10-01至2009-12-31)	海富通货币B报告期(2009-10-01至2009-12-31)
1.本期已实现收益	4,949,630.53	23,753,279.88
2.本期利润	4,949,630.53	23,753,279.88
3.期末基金资产净值	1,596,278,321.05	9,538,218,732.49

注:(1)本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

(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,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。

3.2 基金净值表现

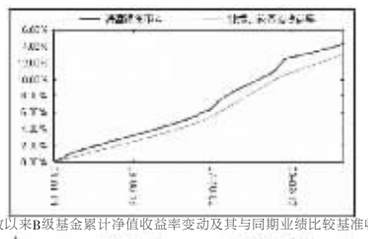
3.2.1 本报告期A级基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.4841%	0.0063%	0.5624%	0.0000%	-0.0783%	0.0063%

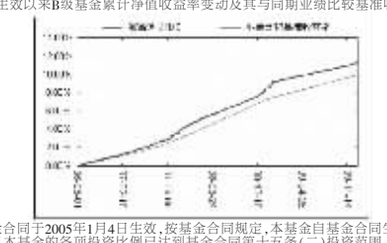
本报告期B级基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.5445%	0.0063%	0.5624%	0.0000%	-0.0179%	0.0063%

3.2.2自基金合同生效以来A级基金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



自基金合同生效以来B级基金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



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。

2、本基金的历任基金经理为邵佳民先生,任职时间为2005年1月至2008年1月。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	基金经理(或基金经理小组)证券从业起始日期	说明
		任职日期	离任日期			
张丽洁	本基金的基金经理	2008年1月31日	-	7年	2002年7月1日	中国国籍,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报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

公司自成立以来,就建立了公平交易制度,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,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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

随着宏观经济的进一步好转,A股市场在2009年第四季度稳步上升,深圳成份指数、中小板指数纷纷创出年内新高。创业板市场的推出,极大的活跃了中小企业板个股的活跃度,并使得市场形成了深强沪弱的格局。中央经济工作会议明确了明年将维持宏观经济政策的延续性,并在2009年的基础上继续大力促进内需。在宏观政策支持下,消费、电子、化工等行业的表现明显优于大盘。市场对于明年地产市场会受到政府调控的担忧使得地产及相关行业的表现明显弱于大盘。

基于对国内经济景气持续向上的判断,本基金在2009年第四季度继续保持了较高的股票仓位配置。由于中央政府的宏观调控政策导向开始转向调结构、防通胀,而保增长的重要性则明显下降,反映在具体政策上,则是对房地产市场的强力调控,对产能过剩行业的行政干预,和对货币市场流动性的逐步收紧。因此,在行业配置方面,本基金在第四季度进一步减少了对金融、地产和上游资源类行业的配置,主要增加了对钢铁、建材、化工等中游产业以及医药和科技产业相关的股票配置。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通收益增长混合基金净值增长率为14.64%,同期业绩比较基准收益率为7.75%,基金净值跑赢业绩比较基准6.89个百分点。

展望未来,二零一零年一季度中国宏观经济必将继续保持高速增长的势头。但二零零九年A股市场的持续上涨已经在相当程度上反映了这一预期,市场对于宏观刺激政策退出抑或转向的忧虑反而日渐增加,因此未来市场走势将取决于经济增长和宏观政策退出的力度和节奏,出口复苏程度和通货膨胀水平将成为关注的重要变量。

基于上述判断,在行业选择上,我们将重点关注得益于产能利用率提高而存在涨价预期的中游以及存在相对供给瓶颈的部分上游;国家经济转型政策扶持的新兴行业以及受益于消费升级和农村消费而具备持续增长力的消费领域;另外,我们也会积极关注大型国企的兼并重组机会,并从上市公司年报中发掘业绩优良未来成长性较好的品种。

§5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	3,388,287,104.28	30.33
	其中:债券	3,388,287,104.28	30.33
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,316,002,894.00	11.78
	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	6,449,507,120.45	57.74
	其他资产	16,975,986.42	0.15
	合计	11,170,773,105.15	100.00

5.2报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	13.43
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	67
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	138
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

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。

5.3.2 报告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	65.70	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.90	-
2	30天(含)—60天	2.95	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.25	-
3	60天(含)—90天	9.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	3.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.19	-
5	180天(含)—397天(含)	18.19	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.17	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	296,226,097.77	2.66
3	金融债券	1,001,310,647.20	8.99
	其中:政策性金融债	1,001,310,647.20	8.99
4	企业债券	371,391,698.38	3.34
5	企业短期融资券	1,719,358,660.93	15.44
6	其他	-	-
7	合计	3,388,287,104.28	30.43
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	371,391,698.38	3.34

5.5 报告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

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	050406	05农发06	6,000,000	601,334,611.71	5.40
2	0981228	09振华CP01	3,300,000	330,064,903.86	2.96
3	0901044	09央行票据44	3,000,000	296,226,097.77	2.66
4	0981117	09酒钢CP01	2,500,000	249,542,570.59	2.24
5	070417	07农发17	2,000,000	200,140,731.70	1.80
6	090218	09国开18	2,000,000	199,835,303.79	1.79
7	058031	05中信债1	1,800,000	175,973,494.18	1.58
8	0981207	09浦发CP01	1,700,000	169,795,204.30	1.52
9	0981086	09豫投资CP01	1,000,000	100,038,679.61	0.90
10	0981170	09郑煤CP01	1,000,000	100,032,267.74	0.90

5.6 "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	-
报告期内偏离度的最高值(%)	0.2178
报告期内偏离度的最低值(%)	0.0478
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值(%)	0.1508

注:以上数据按交易日统计。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	16,972,986.42
4	应收申购款	3,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	16,975,986.42

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	A级	B级
本报告期期初基金份额总额	973,032,836.33	4,225,225,025.89
本报告期基金总申购份额	2,371,466,631.87	9,944,162,642.28
减:本报告期基金总赎回份额	1,748,221,147.15	4,631,168,935.68
本报告期期末基金份额总额	1,596,278,321.05	9,538,218,732.49

§7 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11只开放式基金。截至2009年四季度末,海富通管理的公募基金资产规模近460亿元人民币。

作为首批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2009年四季度末,海富通为近50家企业超过100亿元的企业年金基金担任了投资管理人。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2009年四季度末,投资咨询业务规模超过230亿元人民币,海富通投资咨询业务成为其颇具特色的业务之一。

2009年,海富通旗下基金的业绩表现较为出色。根据晨星(Morning Star)排名,2009年全年,海富通风格优势股票基金净值增长率在股票型基金位列前1/4。

成立六年多来,海富通始终坚持"专业、专心、专注"的职业精神。2004年9月,海富通在我国基金业内率先聘请全球著名资产管理人评估机构惠誉评级(Fitch Ratings)为公司进行资产管理业务评级,在2008年复评中海富通又被升级为"惠誉M2+(中国)"资产管理人优秀评级。

海富通同时还在不断践行其社会责任。自2008年启动"绿色与希望-橄榄枝公益环保计划"以来,先后捐赠了因汶川地震严重受灾的学校、在沙化严重的内蒙古库伦旗捐建了公益林、向上海民工小学捐赠电脑、为安徽老区小学扶贫助学并捐赠物资等。

此外,海富通还积极推进投资者教育工作,在与上海交大安泰经管学院合作建立的"海富通-上海交大投资者教育研究中心"推出《股市与幸福感》调研报告后,海富通四季度与东方财富网合作,推出了为期三个月的"幸福投资路、积分赢大奖"幸福投资主题游戏活动,向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

2009年四季度内,海富通在《华西都市报》"榜样中国2009年度传媒大奖"评选中获年度最受投资者信赖基金公司奖项,海富通中国海外股票(QDII)基金获年度最佳QDII产品称号。海富通在《新闻晨报》"2009年度十大基金评选"中,获十大特色基金公司奖项、海富通中国海外股票(QDII)基金获十佳基金奖项。

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录

中国证监会批准设立海富通货币市场证券投资基金的文件

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招募说明书

海富通货币市场证券投资基金托管协议

中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

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

8.2存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层本基金管理人办公地址。

8.3查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
2010年1月21日

海富通收益增长证券投资基金

【2009】第四季度报告

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