

海富通货币市场证券投资基金

海富通货币市场证券投资基金

2012年度报告摘要

4.1.2 基金经理 任本基金基金经理及基金助理期间简历				
姓名	职务	在本基金的基金经理(助理)任期	从业年限	说明
张丽洁	本基金的基金经理、海南富海通证券基金部经理	2008-02-14	10年	经济学硕士学位, 2002年7月至2004年7月就职于南京银行股份有限公司, 从事财务工作; 2004年8月加入海南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2月起担任海南富通证券基金部经理, 2010年起担任海南富通证券基金部的助理基金经理。

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指公司做出决定之日。

注2、基金从业年限指基金经理(含助理)自参加证券行业资格考试并合格开始计算。

3. 本基金基金经理于2013年1月31日发布公告, 自2013年1月31日起聘任张丽洁担任海南富通货币市场基金基金经理, 张丽洁女士不再担任该基金基金经理。

4. 2. 管理人应报告基金经理、基金托管人变动情况的说明

本报告期内, 本基金未发生基金托管人和基金管理人依据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的约定, 未发生实际运用、勤勉尽责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的专项说明

4.3.1 公司交易制度和控制方法

根据中国证监会2010年发布的《证券投资基金公平交易管理办法》的具体要求, 持续完善了公司投资交易投资管理公平交易制度, 制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易投资管理活动, 涵盖了计划、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理

经营活动的各个环节。同时,公司投资交易业务组负责制定并执行包括各投资组合估值策略在内的各项投资管理制度,公司交易交易组负责为监控体系设立交易、投资部、监察稽核部和风险管理部,确保各司其职,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。

报告期内,公司严格遵守法律法规关于公平交易的规定,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、业绩评估等投资交易活动各环节得到公平对待。各投资组合严格按照投资、法规和公司的交易执行投资交易,保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内,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、业绩评估等投资交易活动各环节得到公平对待。债券的收益率差异进行了分析,并采集了连续4个交易日内,不同时间下(如日下、日内、日内)公司管理的不同投资组合向市场询价的情况。对其在95%置信区间,假设有申购与售的分布估值,结合该时点下留置下的估值,分析其估值差异,并分析其估值差异是否合理,是否存在利益输送的可能。

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

4.4 报告期内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

2012年上半年债券市场强劲上冲,经济增长下滑和CPI的下降,以及货币政策的实质性宽松,推动债

非货币基金产品净值一路走低，其中由于信用债违约导致收益率较前期信用资产中高估，因此基金净值承压。政策调整整体上保持平稳，与此同时，随着货币政策宽松预期于预期，市场开始调低未来经济前景：在“政策面+基本面”组合作用下，使得市价变动相对平缓，利率波动区间明显收窄，债券投资结构性机会的集中度加大。

下半年组合主动追求收益为首要目标，在保证流动性的前提下，信用债配置维持了较高仓位，同时维持了一定的权益行业配置。下半年信用风险防范固守风险底线，新增基金资产配置坚持中期和长期配置和回购等固定品种，对于存在基金溢价，通过中长期分析和跟踪，选择具有有效改善个体经营业绩的需求。在报告期内，该笔投资行为可提供支持、利率不等的定期存款，根据流动性管理需要，本基金提前结束多笔存款合约，基本没有发生任何利息损失。

4、报告期内基金的投资策略和运作分析

A、报告期内基金投资策略和运作分析

(1) 宏观环境及政策影响分析

2018年前三季度，国内生产总值同比增长6.7%，其中三季度环比增长0.9%。前三季度，规模以上工业增加值同比增长6.3%，其中三季度环比增长0.9%。前三季度，固定资产投资（不含农户）同比增长5.9%，其中三季度环比增长0.9%。前三季度，社会消费品零售总额同比增长7.2%，其中三季度环比增长0.9%。前三季度，进出口贸易总额为2.8万亿美元，同比增长0.5%，其中三季度环比增长0.9%。前三季度，一般公共预算收入同比增长0.5%，其中三季度环比增长0.9%。前三季度，一般公共预算支出同比增长0.5%，其中三季度环比增长0.9%。前三季度，一般公共预算赤字为0.5万亿元，同比增长0.5%，其中三季度环比增长0.9%。前三季度，一般公共预算赤字率为0.5%，同比增长0.5%，其中三季度环比增长0.9%。前三季度，一般公共预算赤字率与GDP之比为0.5%，同比增长0.5%，其中三季度环比增长0.9%。前三季度，一般公共预算赤字率与GDP之比与上年相比有所提高，主要是受减税降费政策影响所致。前三季度，一般公共预算赤字率与GDP之比与上年相比有所提高，主要是受减税降费政策影响所致。前三季度，一般公共预算赤字率与GDP之比与上年相比有所提高，主要是受减税降费政策影响所致。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的基本判断
报告期内,受美元走强、政策面偏紧等因素影响,全球通胀维持中低水平,经济增长存在不明显的负效应,权益类资产整体表现偏弱。投资本基金以权益类资产配置转换为对冲通胀压力和权益类资产表现;宏观层面部分行业数据已经有所回暖,但部分强势行业中的弱势企业的信用风险依然较高,如果近期信用事件,无疑会进一步冲击债券市场风险偏好。鉴于此,我们将适度提高信用债投资比例以对冲中等信用等级信用风险,以及采取持有中短久期的、重视债券品种的流动性、同时控制利率风险和信用利差以及久期波动,寻求债券投资收益与高安全边际,并加大对交易性品种的把握力,力争为持有人带来稳定的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人投资估值委员会,委员会成员具有年以上的基金及相关工作经历,专业胜任能力强,并且能够在估值委员会相关工作保持独立性。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。估值工作小组负责听取相关部门的建议,并和相关中介机构充分协商后,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,以估值委员会决策。

估值政策经估值委员会同意,并经公司总裁办公会批准授权实施。

报告期内,本基金管理人估值委员会成员未发生变动。估值委员会由基金管理人估值委员会和估值工作小组的成员,不受与估值政策的关系。但是对于非活跃证券估值,基金经理可以同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
本基金本报告期应分配应付:货币A级42,480.858.62元,货币B级120,476.765.88元。
已实施的利润分配:货币A级已分配40,468.247.46元,货币B级已分配114,146.639.59元。
应分配而未实施的利润:货币B级未分配的17,111.729.17元。 应分配及支付日2013年1月15日按1.00%的余额面额结转为基金金份。

5.8 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵循情况说明

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合规性、净值计算、利润分配等报告的说明

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约定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金净值计算的、基金合同申购赎回价格的计算以及基金费用开支方面进行了认真复核,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,提前支取基金利率不高于提前支取本息合计收益。

5.3 托管人对上年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人的财务报表、净值收益信息、收益分配信息、财务会计报告表、财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在本托管人复核范围内。投资业绩等数据真实、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

资产:	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
货币资金		
结算备付金		
存出保证金		
应收利息		
应收申购款		
其他资产		
资产总计		
负债和所有者权益(或股东权益)		
应付利息		
应付赎回款		
其他负债		
负债总计		
所有者权益(或股东权益)		
实收基金		
未分配利润		
所有者权益(或股东权益)总计		

单位:人民币元

银行存款	2,508,265,324.25	1,578,600,915.60
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,809,971,969.14	1,326,827,910.17
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,809,971,969.14	1,326,827,910.17
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	5,615,352,406.51	50,440,195.66
应收证券清算款	-	-
应收利息	42,574,329.89	29,989,048.37
应收股利	-	-
应收申购款	17,300.00	600.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	9,976,181,329.79	2,985,858,669.80
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2012年12月31日	2011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	769,915,388.90	-
应付赎回款	7,643,030.23	6,864,913.98
应付管理人报酬	1,856,668.11	863,710.11
应付托管费	562,626.71	261,730.33
应付销售服务费	426,992.26	208,316.27
应付交易费用	60,077.63	23,712.82
应交税费	988,000.00	988,000.00
应付利息	-	-
应付利润	8,711,729.17	5,548,609.00
递延所得税负债	-	-
其他负债	409,000.00	414,300.00
负债合计	790,573,513.01	15,173,292.51
所有者权益：	-	-
实收基金	9,185,607,816.78	2,970,685,377.29
未分配利润	-	-
所有者权益合计	9,185,607,816.78	2,970,685,377.29

所有者权益合计	9,865,007,816.78	2,970,683,372.29
负债和所有者权益总计	9,976,181,329.79	2,985,858,669.80

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值1.000元，基金份额总额9,185,607,816.78份，其中A级基金份额1,556,358,314.79份，其中B级基金份额7,029,249,501.99份。

7.2 利润表

会计主体：海富通货币市场证券投资资金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	188,225,747.73	215,592,869.09
1.利息收入	171,052,281.56	210,258,281.39
其中：存款利息收入	90,345,358.28	69,743,713.41
债券利息收入	60,724,766.97	74,677,959.82
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	19,982,156.31	65,836,608.16
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	17,173,466.17	5,334,587.70
其中：股票投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	17,173,466.17	5,334,587.70

资产投资收益	17,175,406.17	3,334,587.00
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)	-	-
减:费用	24,899,131.17	27,679,785.09
1.管理人报酬	13,372,476.21	15,708,086.75
2.托管费	4,052,265.70	4,760,026.37
3.销售服务费	3,075,283.42	2,641,394.70
4.交易费用	=	550.00
5.利息支出	3,888,023.80	4,076,727.44
其中:卖出回购金融资产支出	3,888,023.80	4,076,727.44
6.其他费用	510,532.04	493,549.83
利润总额(亏损总额以“-”号填列)	163,326,616.56	187,913,084.00
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)	163,326,616.56	187,913,084.00
7.3所有者权益(基金净值)变动	-	-

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	1,809,971,969.14	18.14
	其中：债券	1,809,971,969.14	18.14
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	5,615,352,406.51	56.29
	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	2,508,265,324.25	25.14
4	其他各项资产	42,591,629.89	0.43
	合计	9,976,181,329.79	100.00

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	3.39	
	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(%)
1	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本报告期内每个报告期末交易对手融资余额占基金资产净值的简单平均。

8.3 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%。

8.4 基金投资组合平均剩余期限

8.4.1 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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

报告期末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。

8.4.2 期末投资组合平均剩余期限分布

序号	平均剩余期限	合同期限≤180天资产 的比例(%)	资产 的比例(%)	合同期限≤180天资产 的比例(%)	资产 的比例(%)
1	30天以内 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	77.55	—	8.38	—
2	30天(含)—60天 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.86	—	—	—
		2.05	—	—	—
3	60天(含)—90天 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	7.52	—	—	—
		0.98	—	—	—
4	90天(含)—180天 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	6.84	—	—	—
		1.18	—	—	—
5	180天(含)—297天(含) 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	10.37	—	—	—
		—	—	—	—
	合计	108.14	—	8.38	—
8.5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		573,199,651.55	6.24	
	其中：政策性金融债		573,199,651.55	6.24	
4	企业债券		185,933,786.80	2.02	
5	企业短期融资券		1,050,838,530.79	11.44	
6	中期票据		-	-	
7	其他		-	-	
8	合计		1,809,971,969.14	19.70	
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券		386,580,695.82	4.21	
8.6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	080210	08国开10	3,200,000	322,624,458.91	3.51

2	041251034	12海航CP001	2,000,000	200,158,485.95	2.18
3	110206	11国开债	1,100,000	110,407,612.25	1.20
4	1000236	10国债26	900,000	90,239,296.77	0.98
5	071201004	12招商CP004	900,000	89,992,508.90	0.98
6	041253042	12深华债 CP002	800,000	80,024,736.71	0.87
7	058031	05中信债1	800,000	78,574,837.59	0.86
8	068007	06音都机场 债	800,000	77,985,655.03	0.85
9	041252004	12华新CP001	600,000	60,215,336.95	0.65
10	041260039	12海航电 CP001	600,000	60,067,998.84	0.66
8.7 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					70
报告期内偏离度的最高值					0.4081%
报告期内偏离度的最低值					0.0431%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值					0.1840%
注：以上数据据交易日报统计。					
8.8 报告期内公允价值对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					
本基金报告期内未持有资产支持证券。					

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

自2007年1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,按照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。

8.9.2 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30%的情况。

8.9.3 本基金持有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。

8.9.4 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	42,574,329.89
4	应收申购款	17,300.00
5	其他应收款	--
6	待摊费用	--
7	其他	--
8	合计	42,591,629.89

8.9 期末基金份额持有人户数及持有人结构

	持有人结构	份额单位:份
--	-------	--------

基金级别	持有人(户数)	户均持有的基金	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占基金份额比例	持有份额	占基金份额比例
普通证券投资基金A	18,942	113,840.05	108,544,520.71	5.03%	2,047,813,794.08	94.97%
普通证券投资基金B	253	27,783,594.87	5,704,761,115.44	81.16%	1,324,488,386.55	18.84%
合计	19,195	478,541,691.5	813,305,636.15	63.29%	3,372,302,180.63	36.71%

注：上表为基金机构投资者持有的基金份额占基金份额比例的计算中，A、B 级比例分为各自各级别的份额，对合计、比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金资产总额）。

9.2 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	基金级别	持有份额总(股份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	普通证券投资基金A	867, 871.32	0.0400%
	普通证券投资基金B	-	-
	合计	867, 871.32	0.0094%

注：1、本基金本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有普通证券投资基金A份额总量在10%以上50%之间。

2、本基金本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金。

\$10 开放式基金份额变动

项目	普通证券投资基金A	普通证券投资基金B
基金合同生效日（2005年1月4日）	964,512,079.20	-
基金份额总额	-	-
本报告期期初基金份额总额	759,029,037.90	2,211,656,339.39

本报告期末基金份额总额	8,062,294.43
本报告期末基金份额持有人户数	7,443,099,955.44
本报告期末基金份额总额	14,818,229,480.63
本报告期末基金份额总额	2,156,358,314.79
本报告期末基金份额总额	7,029,249,501.99

注：总申购含红利再投，转换入及分级份额调增的净额；总赎回含转换出及分级份额调减的净额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

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

2012年9月10日，余毓霖先生因工作调动辞去董事职务，公司董事会聘请若浩君 Mr. Laurent JOURAULT 先生继任监事职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内基金管理人、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变更。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金改聘为天华会计师事务所。本年度应支付的审计费用是100,000.00元。目前事务所已提供审计报告的续签年度意见。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员在报告期内或报告期间的重大诉讼、仲裁事项

报告期内，托管人及其高级管理人员在报告期内或报告期间的重大诉讼、仲裁事项。

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和佣金支付情况

基金管理人 基金托管人

		股票交易		应付该券商佣金		备注
券商名称	交易单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总额的比例	
海通证券				58,685.00	100.00%	
注1：报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。						
注2：① 券商的佣金率由基金管理人根据券商的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持三个部分进行打分, 进行主观性评价, 独立的评分, 形成证券公司排名及交易单元意见。						
② 交易单元的选择程序：基金的管理人按照如下程序进行交易单元的择选：						
A、推荐：投资部业务人员推荐, 经投资部部门会议讨论, 形成推荐证券公司的备选池, 从中进行筛选。原则上, 备选池中的证券公司不少于以上所选择券商的200%。						
B、筛选：由投资部业务人员、法律顾问、券商基金业务人员等证券公司销售系统的人员, 进行主观性评价, 独立的评分, 形成证券公司排名及交易单元择选意见, 并报公司总裁办公会核准。						
C、核准：在完成对证券公司排名的初步评估、筛选和审核后, 由基金管理人总裁办公会核准。						
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						
		债券交易		回购交易		金额单位：人民币元
券商名称	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			-5,335,000.00	100.00%		
11.8 债券回购日价值超过0.5%的情况						
本基金本报告期内债券回购日价值未超过0.5%。						
§12 影响投资者决策的其他重要信息						

海南基金管理公司成立于2003年4月,是中国首批获批准的外资中资基金管理公司。从2003年8月开始,海南通富先后募集了7只公募基金,截至2012年12月31日,海南通富管理的公募基金资产规模达343亿元人民币。

2005年12月,海南通富与多家企业共同发起设立海南企业基金投资管理公司,截至2012年12月31日,海南通富为该企业累计超过207亿元人民币的企业基金担任了投资管理公司。作为其担任投资管理公司管理业务资格的基金管理人,截至2012年12月31日,海南通富下专户理财管理资产规模超过37亿元人民币。2010年12月,海南通富基金管理有限公司被中国社会福利基金理事会确认为境内受托投资管理公司。2012年9月,中国保监会核准海南通富基金管理有限公司为合格境外机构投资者(QFII)及其他多类海内外投资组合担任投资咨询顾问,截至2012年12月31日,投资咨询海外及境外业务规模达218亿元人民币。

2010年11月25日,海南通富全资子公司——海南通富资产管理(香港)有限公司正式开业,注册资本为6000万美元。2011年12月,海南通富资产管理(香港)有限公司获得中国证监会核准RQFII(人民币合格境外机构投资者)资格,成为首家在内地设立人民币基金并开展人民币基金业务的境外资产管理公司。截至2012年12月31日,海南通富资产管理(香港)有限公司已募集发行专户RQFII产品1只。

2012年3月,因股权结构媒体、中国证券报等授予海南通富资产管理(香港)有限公司“中国基金金牛基金管理人”称号。东方财富网授予海南通富资产管理金牛奖。2011年中国基金业金牛奖一年度持续回报奖。

海南通富还在不断履行其社会责任。公司自2008年启动“慈善与社会责任—援建校舍工程环保计划”,针对汶川震后受灾学校、上海民工子弟学校、安徽长小巷进行了物资捐赠;向内蒙古包头捐建了环保保护站。几年来,海南通富的公益行动逐步深入,涉及上海民工子弟学校学生赈灾物资捐赠,并向安徽农村小学捐赠图书,并与“壹基金”合作参与资助孤儿儿童项目。此外,海南通富还积极倡导投资者参与工作,推出了以“幸福投资”为主题和特色的投资者教育活动,向投资者传播长期理念。

海南通富基金管理有限公司
二〇一三年三月十七日

序号	项目	金额	金额占收入人民币元 的比重(%)
1	固定收益投资 其中：债券 资产支持证券	1,809,971,969.14 1,809,971,969.14	18.14 18.14
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	5,615,352,406.51 -	56.29 -
3	银行存款和结算备付金合计	2,508,266,324.25	25.14
4	其他各项资产	42,591,629.89	0.43
	合计	9,976,181,329.79	100.00

1	30天以内	77.55	8.38
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债		
2	30天(含)~60天	5.86	
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.05	
3	60天(含)~90天	7.52	
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.98	
4	90天(含)~180天	6.84	
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.18	

4	其中：政策性金融债	573,190,651.55	6.24
4	企业债	185,395,786.80	2.02
5	企业间借贷及转融通资金	1,050,838,530.79	11.44
6	中期票据		
7	其他		
8	合计	1,809,971,969.14	19.70
8.6	其中：按摊余成本计量的金融资产	386,580,695.82	4.21

8.6 期末按摊余成本计量的金融资产净值比例大于或等于80%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	金额单位：人民币元 占期末摊余成本比例(%)
----	------	------	---------	------	---------------------------

10	441200039	1424160000 (CFO)	600,000	60,067,998.84	0.65
8. 2. 2 对于净资产与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离					
					偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25% 至 0.5% 间的次数					70
报告期内偏离度的最高值					0.4081%
报告期内偏离度的最低值					0.0431%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值					0.1840%
注：以上数据按交易日统计。					
8.8 期末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。					
9. 2 投资组合报告附注					

3	应收利息	42,574,329.89
4	应收申购款	17,300.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	42,591,629.89

89 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	持有人户数	户均持有的基金份额	
			持有人结构
			机构投资者
			个人投资者

注：	合计	862,871.32	0.0094%
注：1、本基金本报告期末，本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门人员持有前海富通货币A份额占总基金资产净值0.0094%。			
2、本基金本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金。			
	开放式基金资产变动		
	\$10		单位：份
项目	前海富通货币A	前海富通货币B	
基金合同生效日（2005年1月4日）	964,512,079.20	-	-
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	759,029,037.90	21,616,339.39	21,616,339.39
本报告期基金份额总额	8,741,029,232.33	19,235,822,643.23	19,235,822,643.23
基金份额变动	7,981,999,194.43	17,619,483,303.84	17,619,483,303.84

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼、仲裁事项。

11.4 基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所名称。

报告期内,本基金未改聘为审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是100,000.00元。目前所支付审计机构的服务费按年支付是8万。

报告期内,本基金及其高级管理人员、基金经理均未受到监管部门的稽查、处罚。

本基金的管理人、托管人及高级管理人员在报告期内未受到监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元用于证券投资股票及佣金支付情况

金额单位:人民币元

11.7.2 基金租用证券交易单元进行其他证券交易的情况					
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
每笔费率	-	-	-	-	-
<p>11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况</p> <p>本基金在本报告期内偏离度绝对值未超过0.5%。</p> <p>本基金投资于科创板股票占基金总资产比例8.12%，影响本基金的风险收益特征。本基金的重要信息为科创板股票投资比例，本基金投资于科创板股票占基金总资产比例8.12%。</p> <p>本基金最近聘请了中诚信证券评估有限公司作为信用评级机构，负责本基金的信用评级工作。本基金最近聘请了中诚信证券评估有限公司作为信用评级机构，负责本基金的信用评级工作。</p>					

(香港)有限公司已集齐发展首批RQFII产品。
自2012年3月，国内机构投资者(包括中国证券投资基金业协会等境内有基金业务管理的机构)开始可投资于境外证券基金。2011年中国基金业协会的统计显示，截至去年底，国内基金管理公司共发行人民币基金产品16只，规模约180亿元。

此外，中国证监会在2011年批准了首只跨境人民币基金——嘉实国际对冲基金(RQFII)，并允许其进行社会责任投资。公司自2008年起启动“绿色与社会责任”战略计划，针对汶川地震受灾学校、上海民工大学、安徽老幼小学进行了物资捐赠，向内蒙古-库伦科技环保提供了环保设备。几年来，嘉实的公益行动进一步升级，持续关注上海民工大学学生创业生活状况，并向安徽农村小学捐赠了以“幸福投资”为主题和特色的投资者教育教材，向投资者们传递长期投资观、理性投资观。

嘉實通泰資產管理有限公司
Q—至三月三十一日