海富通货币市场证券投资基金

2013 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:二〇一四年三月三十一日

§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2014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2013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	
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	2,276,933,203.48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	453,650,041.29份	1,823,283,162.19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	郑万荣	唐州徽
	联系电话	021-38650891	95566
	电子邮箱	wrzz@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	2013年		2012年		2011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	27,571,637.22	130,685,924.61	42,849,850.68	120,476,765.88	34,804,497.93	153,108,586.07
本期利润	27,571,637.22	130,685,924.61	42,849,850.68	120,476,765.88	34,804,497.93	153,108,586.07
本期净值收益率	3.6487%	3.8981%	4.0713%	4.3199%	3.9368%	4.1859%
3.1.2期末数据和指标	2013年末		2012年末		2011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	453,650,041.29	1,823,283,162.19	2,156,358,314.79	7,029,249,501.99	759,029,037.90	2,211,656,339.39
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

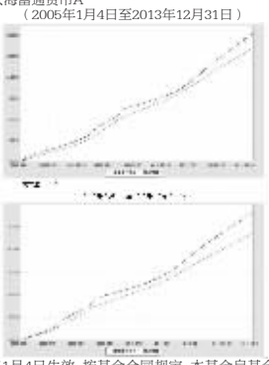
3.1.1期间数据和指标	份额净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9268%	0.0024%	0.7478%	0.0000%	0.1790%	0.0024%
过去六个月	1.8638%	0.0025%	1.5012%	0.0000%	0.3626%	0.0025%
过去一年	3.6487%	0.0030%	3.0000%	0.0000%	0.6487%	0.0030%
过去三年	12.1152%	0.0042%	9.8303%	0.0006%	2.2849%	0.0036%
过去五年	16.0856%	0.0053%	14.8889%	0.0013%	1.1967%	0.0040%
自基金合同生效起至今	30.6600%	0.0073%	27.0719%	0.0019%	3.5881%	0.0054%

2、 海富通货币B

阶段	份额净值收益率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
过去三个月	0.9878%	0.0024%	0.7478%	0.0000%	0.2400%	0.0024%
过去六个月	1.9869%	0.0025%	1.5012%	0.0000%	0.4857%	0.0025%
过去一年	3.8981%	0.0030%	3.0000%	0.0000%	0.8981%	0.0030%
过去三年	12.9234%	0.0042%	9.8303%	0.0006%	3.0931%	0.0036%
过去五年	17.4857%	0.0053%	14.8889%	0.0013%	2.5968%	0.0040%
自基金合同生效起至今	28.3831%	0.0075%	23.5564%	0.0017%	4.8267%	0.0058%

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

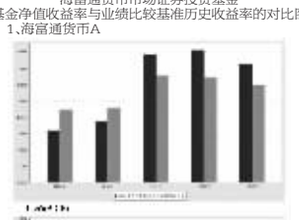
海富通货币市场证券投资基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
1、海富通货币A
(2005年1月4日至2013年12月31日)



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
基金净值收益率与业绩比较基准历史收益率的对比图
1、海富通货币A



3.3过去三年基金的利润分配情况

1、海富通货币A

金额单位: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
2013	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	-
2011年	26,632,181.04	7,421,573.26	750,743.63	34,804,497.93	-
合计	86,248,977.95	19,142,682.73	-165,674.85	105,225,985.83	-

2、海富通货币B

金额单位: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
2013	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	-
2011年	128,099,808.98	25,364,024.04	-355,246.95	153,108,586.07	-
合计	334,661,161.98	70,954,809.43	-1,344,694.85	404,271,276.56	-

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。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公募基金;除本基金外,基金管理人目前还管理着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、海富通精选武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、海富通稳进增利分级债券型证券投资基金、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和海富通内需热点股票型证券投资基金二十五只公募基金。

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	-	8年	中国国籍,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。自2013年1月起任海富通货币基金经理,2013年5月起兼任海富通养老收益混合基金经理,2013年10月起兼任海富通一年定开债券基金经理,2013年12月起兼任海富通双利分级债券基金经理。
陈轶平	本基金的基金经理	2013-08-29	-	4年	中国国籍,博士,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月任瑞银金业管理(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。
张丽洁	本基金的基金经理;海富通稳进增利分级债券基金经理	2008-02-14	2013-01-30	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2月至2013年1月任海富通货币基金经理。2011年9月至2013年1月任海富通稳进增利分级债券基金经理。

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。

3、海富通基金管理有限公司于2014年3月11日发布公告,自2014年3月7日起位健先生不再担任本基金基金经理。

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

货币市场方面,年初资金面开始重回宽松,尤其是1月中下旬央行出台SLO之后,市场关于资金面宽松且平稳的预期高度强烈。在央行SLO大量逆回购的呵护下,资金面的波动幅度显著低于往年。2季度以来资金面受利税集中上缴、财政存款季节性增加、外汇占款下降和3个月央票重启影响较为紧张。6月资金面出现了罕见的极度紧张状态,多项数据均创造历史记录,其影响程度也超出资本市场本身的范畴,6月资金面紧张的根本原因是市场对高层和央行流动性态度转变的估计不足。最终,央行在6月底发布《合理调节流动性维护货币市场稳定》的公告,说明央行的流动性态度有所软化。此外,央行暂停3个月央票的发行。下半年货币市场利率从6月底高点明显回落,从7月中旬开始,受“620钱荒后遗症”、财政存款上缴,外汇占款流入减少等因素影响,货币市场利率止跌回升,资金面总体仍偏紧。8月下旬开始,资金面有所改善,QE延迟退出也缓和了市场对外部流动性的担忧,9月底央行逆回购量著放量,资金面波动并未超出预期。10月下旬遭遇利税上缴冲击,资金面再度趋紧,央行公开市场操作延续“锁长放短”的手法,11月中下旬回购利率再度上行,直至年底央行重启14天逆回购,资金面才得以缓解。进入12月中旬,“钱荒”再度发酵,资金面哀鸿遍野,而央行仍暂停公开市场逆回购,直到央行月底重启7天逆回购,资金面才得以稳定。

本基金在一季度规模较大,债券,存款仓位比例比较合理。在六月底的资金面趋紧的过程中,本基金遭遇巨额赎回。随着银行存款提前支取,后半年间组合债券比例偏高,组合静态收益率偏低。下半年本基金择机减持债券,努力保证了组合的流动性和安全性。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通货币A类基金净值收益率为3.6487%,同期业绩比较基准收益率为3%;海富通货币B类基金净值收益率为3.8981%,同期业绩比较基准收益率为3%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从2012年以来人民币升值开始反复,外汇占款波动性更强。在国内经济疲弱的背景下,估计2014年的外汇占款或因QE缩减而下降,流动性状况更加取决于内部流动性,即央行的态度。我们预计央行仍会继续保持偏紧货币政策。

广义流动性层面,国内企业产能过剩、杠杆率走升,企业自身“造血”能力较差,借新还旧的外部融资需求强烈。依赖于城投、房地产的“稳增长”必将伴随着更大的融资需求,导致低效率融资膨胀与其对经济增长边际贡献减弱并存。高层显然意识到这一点,而在去杠杆的背景下,货币供给难以很快,再加上利率市场稳步推进导致银行负债端成本明显上升,这些因素交织在一起,导致了资金面的供需失衡和资金价格的走升。

狭义流动性层面,由于央行一直以短期操作为主,明年公开市场到期很少,主要的决定权还是在央行手里,货币政策估计仍将以公开市场微调为主,央行会根据资金面的情况,采取逆回购、正回购的灵活操作,我们认为央行不会让货币市场利率大幅走升,但出于调结构和去杠杆的考虑,央行也不会让资金面过于宽松。

本基金认为2014年在国内经济和通胀水平没有发生明显变化前,央行将仍然以维持较紧的流动性为主,货币市场利率的不稳定仍将继续。本基金将优化组合配置,维持适中久期,抓住关键节点,在努力控制流动性风险的同时为投资人创造稳定的收益。

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27,571,637.22元,货币B级130,685,924.61元。

二、已实施的利润分配:货币A级已分配26,779,906.45元,货币B级已分配127,834,912.76元。

三、应分配但尚未实施的利润:已分配但未支付的3,642,742.62元。 应于收益支付日2014年1月15日按1.000元的份额面值结转为基金份额。

§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。

§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:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	1,202,780,636.03	2,508,265,324.25
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,126,107,568.15	1,809,971,969.14
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,126,107,568.15	1,809,971,969.14
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	5,615,352,406.51
应收证券清算款	20,045,833.33	-
应收利息	26,337,905.43	42,574,329.89
应收股利	-	-
应收申购款	242,985,369.02	17,300.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,678,257,971.96	9,976,181,329.79
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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	394,499,362.75	-
应付证券清算款	-	769,915,388.90
应付赎回款	838,873.81	7,643,030.23
应付管理人报酬	595,445.00	1,856,668.11
应付托管费	180,437.89	562,626.71
应付销售服务费	104,285.06	426,992.26
应付交易费用	44,782.05	60,077.63
应交税费	988,000.00	988,000.00
应付利息	34,443.70	-
应付利润	3,642,742.62	8,711,729.17
递延所得税负债	-	-
其他负债	396,395.60	409,000.00
负债合计	401,324,768.48	790,573,513.01
所有者权益:		
实收基金	2,276,933,203.48	9,185,607,816.78
未分配利润	-	-
所有者权益合计	2,276,933,203.48	9,185,607,816.78
负债和所有者权益总计	2,678,257,971.96	9,976,181,329.79

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.00元,基金份额总额2,276,933,203.48份,其中A级基金份额453,650,041.29份,其中B级基金份额1,823,283,162.19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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	187,026,228.31	188,225,747.73
1.利息收入	180,974,819.01	171,052,281.56
其中:存款利息收入	86,715,422.53	90,345,358.28
债券利息收入	80,428,616.14	60,724,766.97
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	13,830,780.34	19,982,156.31
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	6,051,159.30	17,173,466.17
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6,051,159.30	17,173,466.17
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	28,768,666.48	24,899,131.17
1.管理人报酬	14,040,767.58	13,372,476.21
2.托管费	4,254,778.04	4,052,265.70
3.销售服务费	2,286,864.25	3,075,283.42
4.交易费用	100.00	550.00
5.利息支出	7,688,933.70	3,888,023.80
其中:卖出回购金融资产支出	7,688,933.70	3,888,023.80
6.其他费用	497,222.91	510,532.04
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	158,257,561.83	163,326,616.56
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	158,257,561.83	163,326,616.56

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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	2,970,685,377.29	-	2,970,685,377.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	163,326,616.56	163,326,616.56
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)	6,214,922,439.49	-	6,214,922,439.49
其中:1.基金申购款	28,376,851,875.56	-	28,376,851,875.56
2.基金赎回款	-22,161,929,436.07	-	-22,161,929,436.07
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)	-	-163,326,616.56	-163,326,616.56
五、期末所有者权益(基金净值)	9,185,607,816.78	-	9,185,607,816.78

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:

基金管理公司负责人:田仁灿,主管会计工作负责人:阎小庆,会计机构负责人:高勇前

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2014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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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2013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2013年12月31日的财务状况以及2013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

本基金报告期未未发生会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金报告期未未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	3,100,000,000.00	100.00%	5,335,000,000.00	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 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%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	58,685.00	100.00%	24,750.00	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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	14,040,767.58	13,372,476.21
其中:支付销售机构的客户维护费	1,231,511.68	1,950,150.63

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,254,778.04	4,052,265.70

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 2013年1月1日至2013年12月31日 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
海富通基金	125,446.36	293,154.71	418,601.07
合计	414,082.27	300,049.22	714,131.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日 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	446,024.17	13,879.30	459,903.47
海通证券	22,915.74	2,154.53	25,070.27
海富通基金	126,124.49	196,744.55	322,869.04
合计	595,064.40	212,778.38	807,842.78

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.