

**海富通货币市场证券投资基金**  
**2016 年年度报告摘要**  
**2016 年 12 月 31 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

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

## § 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 2017 年 3 月 24 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 2016 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	14,448,437,249.88 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	936,827,517.79 份	13,511,609,732.09 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	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
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	2016 年		2015 年		2014 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	16,111,912.48	427,949,566.69	37,937,600.49	289,039,589.71	45,990,548.34	175,124,336.26
本期利润	16,111,912.48	427,949,566.69	37,937,600.49	289,039,589.71	45,990,548.34	175,124,336.26
本期净值收益率	2.4126%	2.6588%	3.7616%	4.0103%	4.7915%	5.0416%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 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	936,827,5	13,511,60	1,582,873,	21,381,23	1,538,716,	2,604,349,7

产净值	17.79	9,732.09	053.84	7,216.83	156.45	34.46
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	0.5773%	0.0013%	0.3760%	0.0000%	0.2013%	0.0013%
过去六个月	1.1819%	0.0014%	0.7534%	0.0000%	0.4285%	0.0014%
过去一年	2.4126%	0.0014%	1.5041%	0.0000%	0.9085%	0.0014%
过去三年	11.3567%	0.0044%	6.7326%	0.0018%	4.6241%	0.0026%
过去五年	20.1189%	0.0044%	13.5020%	0.0019%	6.6169%	0.0025%
自基金合同生效起至今	45.4986%	0.0068%	35.6271%	0.0019%	9.8715%	0.0049%

##### 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	0.6376%	0.0013%	0.3760%	0.0000%	0.2616%	0.0013%
过去六个月	1.3038%	0.0014%	0.7534%	0.0000%	0.5504%	0.0014%
过去一年	2.6588%	0.0014%	1.5041%	0.0000%	1.1547%	0.0014%
过去三年	12.1589%	0.0044%	6.7326%	0.0018%	5.4263%	0.0026%

过去五年	21.5650%	0.0044%	13.5020%	0.0019%	8.0630%	0.0025%
自基金合同生效起至今	43.9930%	0.0068%	31.8750%	0.0019%	12.1180%	0.0049%

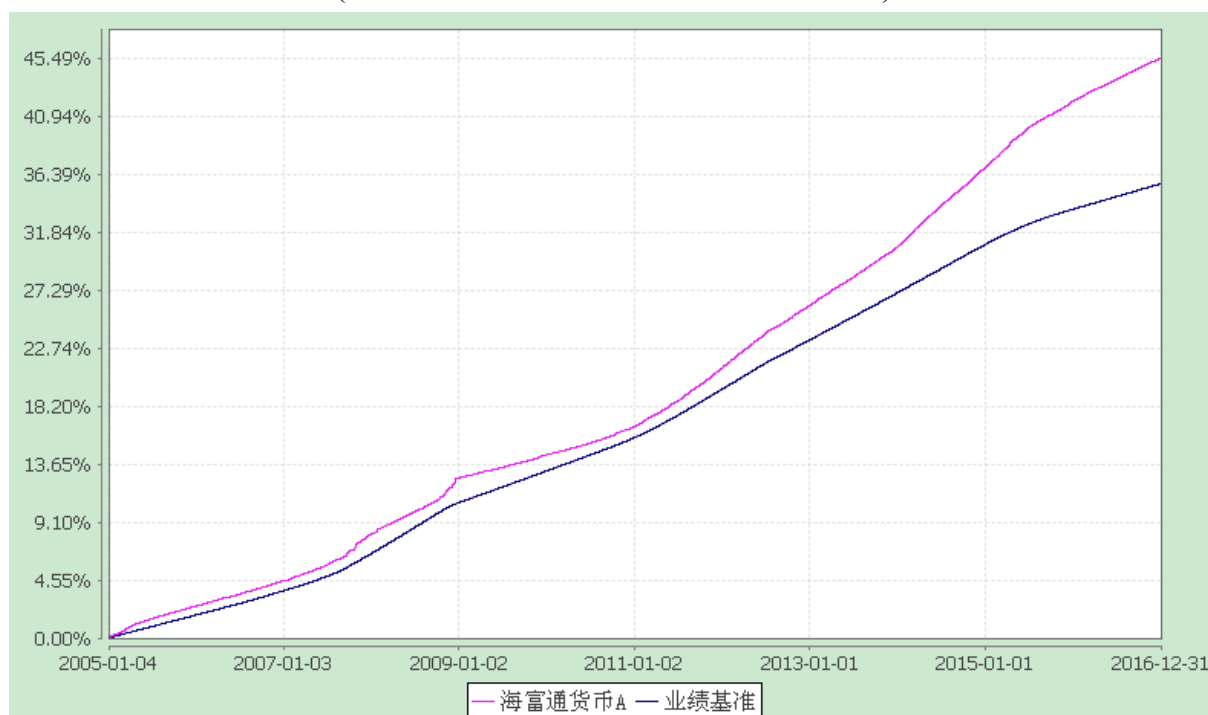
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 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

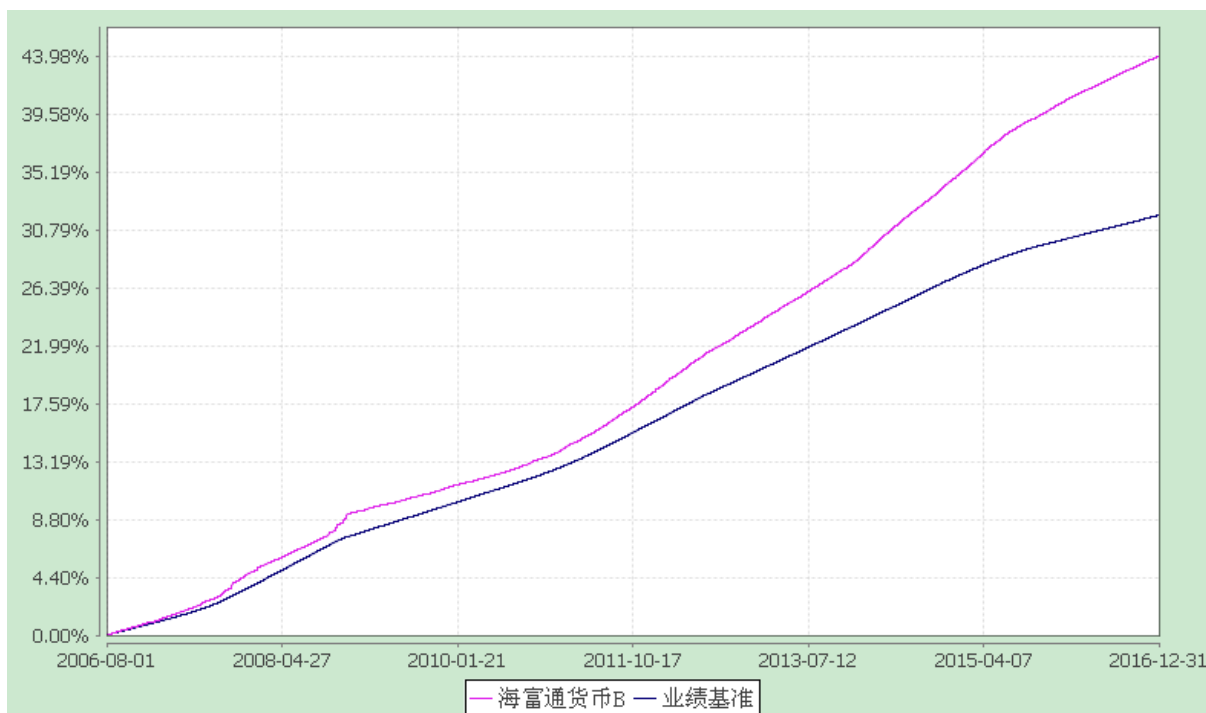
##### 1. 海富通货币 A

(2005 年 1 月 4 日至 2016 年 12 月 31 日)



##### 2. 海富通货币 B

(2006 年 8 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日)



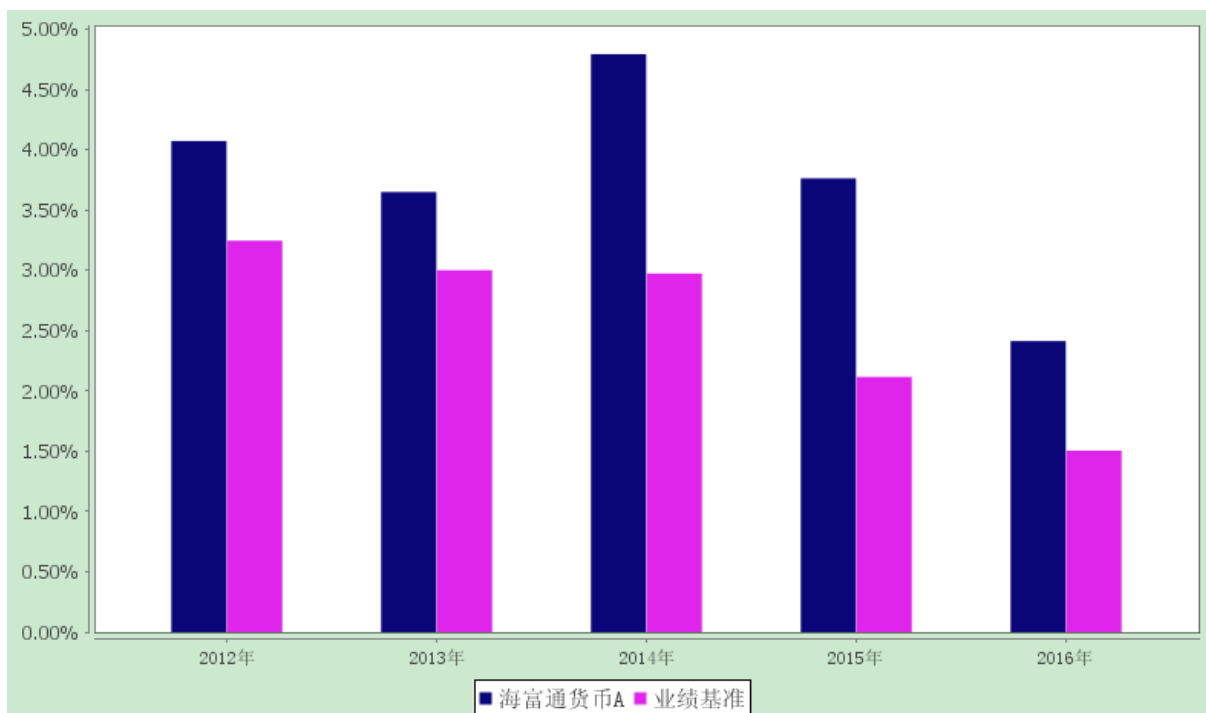
注：本基金合同于 2005 年 1 月 4 日生效,按基金合同规定,本基金自基金合同生效起 3 个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十五条(二)投资范围、(六)投资组合中规定的各项比例。

### 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

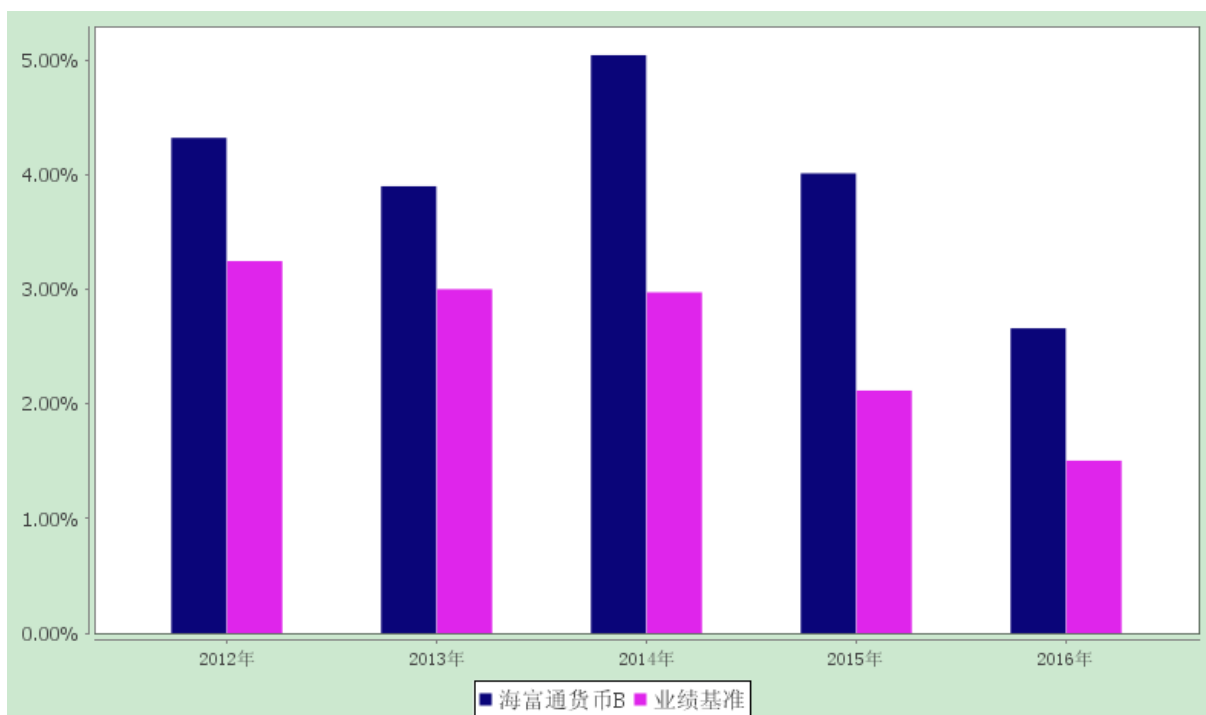
海富通货币市场证券投资基金

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
2016 年	14,198,721.9 1	2,370,371.89	-457,181.32	16,111,912.4 8	-
2015 年	31,386,302.8 3	8,501,317.07	- 1,950,019.41	37,937,600.4 9	-
2014 年	35,133,247.3 4	8,760,368.84	2,096,932.16	45,990,548.3 4	-
合计	80,718,272.0 8	19,632,057.8 0	-310,268.57	100,040,061. 31	-

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
2016 年	350,910,204. 39	79,891,738.4 4	- 2,852,376.14	427,949,566. 69	-
2015 年	236,319,135. 97	43,464,609.4 3	9,255,844.31	289,039,589. 71	-
2014 年	148,603,415. 97	23,694,176.1 1	2,826,744.18	175,124,336. 26	-
合计	735,832,756. 33	147,050,523. 98	9,230,212.35	892,113,492. 66	-

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 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人  
共管理 42 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、海富通强化回报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、海富通精选贰号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、海富通稳进增利债券型证券投资基金（LOF）、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、海富通东财大数据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、海富通瑞益债券型证券投资基金、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。

#### 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	2013-08-29	-	7 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

	金经理；海富通稳进增利债券（LOF）基金经理；海富通稳固收益债券基金经理；海富通一年定开债券基金经理；海富通富祥混合基金经理；海富通瑞益债券基金经理；海富通瑞丰一年定开债券基金经理；海富通美元债（QDII）基金经理				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。2015 年 12 月兼任海富通稳进增利债券（LOF）及海富通稳固收益债券基金经理。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 月起兼任海富通瑞益债券和海富通瑞丰一年定开债券基金经理。2016 年 11 月起兼任海富通美元债（QDII）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	2016-02-26	-	11 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

	金经理；海富通稳健添利债券基金经理；海富通双福分级债券基金经理；海富通双利债券基金经理；海富通养老收益混合基金经理；海富通纯债债券基金经理；海富通欣益混合基金经理；海富通聚利债券基金经理；海富通欣荣混合基金经理				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 月起兼任海富通纯债债券、海富通双福分级债券、海富通双利债券及海富通养老收益混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣益混合、海富通聚利债券及海富通欣荣混合基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通强化回报混合基金经理。
何谦	本基金的基金经理；海富通纯债债券基金经理；海富通双福分级基金	2016-05-06	-	6 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 月起任海富通纯债债券、

	经理； 海富通 双利债 券基金 经理； 海富通 集利债 券基金 经理			海富通双福分级债券、 海富通双利债券及海 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。
--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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

经历了 2014、2015 两年的牛市, 2016 年的债券市场表现可谓一波三折, 收益率先下后上, 总体震荡收跌。从 10 年期国债的收益率走势看可以将 2016 年的债券市场分为三个阶段: 1-5 月区间窄幅震荡, 6-10 月收益率突破下行并创下历史新低, 11-12 月则出现恐慌式的大幅调整。每一阶段背后都有其对应的市场环境和逻辑, 而其中政策因素是贯穿全年的主导因素。具体分阶段来看, 年初政府稳增长意愿强烈, 信贷投放加大, 地产政策放松, 央行降低准备金率, 经济出现短暂回升。这一阶段债券收益率区间震荡, 只是 4 月中旬受违约风险扩散影响, 信用债出现了一波调整。5 月政策风向出现转变, 权威人士讲话后政策重心从需求侧刺激转为供给侧改革, 工业产出、房地产投资以及出口纷纷出现回落, 信贷和社融也开始下滑。货币政策则维持稳健偏宽松, 虽然央行并未采取降准降息等手段, 但是灵活运用公开市场操作、MLF、SLF、SLO 等工具进行货币投放, 资金面依旧宽松。这时的经济政策环境开始对债市变得有利, 而 6 月下旬英国脱欧公投则成为了债市的助燃剂, 避险情绪和对货币进一步宽松的预期推动了债市出现快速上涨。与此同时, 随着利率的走低, 银行资产出表化、委外投资迅猛扩大, 整个金融体系的杠杆与资产价格正反馈强化, “资产荒” 成为市场主旋律。无论是超长期利率债还是低评级信用债, 只要收益率相对较高, 都成为市场博取收益的对象, 期限利差、信用利差被持续压缩。这一情况于 8 月中旬到达极致, 10 年期国债一度达到 2.65% 的历史新低, 信用利差也来到了近乎历史最低的分位水平。进入四季度, 供给侧改革取得初步成效, PPI 由负转正, 企业盈利改善, 经济企稳回升。鉴于美国加息预期渐近人民币贬值压力加大和国内日益增长的地产泡沫, 管理层政策重心转向“防风险”和“挤泡沫”, 一方面严格实施地产调控, 另一方面货币政策边际收紧。央行通过持续公开市场“锁短放长”操作, 不断抬升资金成本, 并加强理财监管考核。起初市场不以为意, 认为地产调控会加剧资产荒和对经济的悲观预期, 10 年期国债收益率于 10 月中下旬再次逼近 8 月份的低点。然而进入 11 月, 负债端的剧烈波动使得原本就脆弱的市场开始急转直下, 尤其在 11 月底资金面紧张加剧, 货基遭遇赎回, 国海证券“代持违约”事件更是雪上加霜, 大量杠杆盘被迫抛出, 10 年期

国开债收益率相对年内低点一度上行 100bps 左右。信用债也难以幸免，收益率以及信用利差大幅上升，二级市场亦成交寥寥，债市流动性受到重创。四季度货币基金主动降低了债券的仓位，预留了足够的头寸应对年末流动性紧张的情况，各项指标在合理区间运作。全年货币基金维持了流动性管理为主题的操作思路，有效的规避了信用风险和流动性风险。

#### 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 2.4126%，同期业绩比较基准收益率为 1.5041%；B 级基金净值收益率为 2.6588%，同期业绩比较基准收益率为 1.5041%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济基本面看，2017 年经济可能继续维持弱势平稳。虽然近期工业增长、固定资产投资阶段性回升，一季度经济增速仍能维持在较高水平，但中期看补库存推动是否能发展为需求推动仍存在较大不确定性，尤其是经历严厉调控后的地产投资情况、财政对基建的支持力度、PPP 的落地情况等还有待观察。如果需求无法恢复，下半年经济依然面临回落压力。通胀方面，2017 年通胀中枢上移是大概率事件。PPI 回升对 CPI 的传导、重要资源品价格上涨带来可能的输入性通胀都使得通胀预期抬升，但目前看还不具备全面通胀的条件。货币政策方面，2016 年下半年以来货币政策面临汇率贬值、金融去杠杆、地产去泡沫的多重压力，货币政策边际收紧，这一状态可能仍会持续较长一段时间。但是，货币政策仍是服务于国内经济，随着贬值压力的逐步释放，货币政策可能获得更多的独立性，届时将视国内经济和通胀水平来选择政策偏紧或是偏松。总体看，2017 的债市环境可能与今年类似，趋势性不强、预期变化快，主要原因还是在于管理层政策重心的摇摆。2017 年下半年迎来“十九大”，届时可能确立未来的政策重心，但在此之前市场可能仍延续区间波动的特征。另外全球经济政治的不稳定加剧、不确定因素增多也是重要的扰动因素，尤其是美国换届后的经济和货币政策直接影响了全球风险偏好和资金的流向，对我国经济和资本市场也有重要影响。在此环境下，我们对 2017 年债市保持中性看法，风险和机会共存，经济和政策的预期差或是投资机会的所在。从品种上看，结构性机会下利率债依旧是性价比较好的波段品种，可择机参与。信用债信用利差过窄的局面已有所改善，但保护依然不足，可能有进一步走扩的风险，需更多关注配置时点。

基于此，2017 年资金面紧平衡或许会成为常态，资金利率的底部约束了长端利率的下行空间。但资产荒下配置需求依然旺盛，尤其是地产调控后银行表内资产配置有望向债券市场倾斜。而出于对基本面短期平稳中长期向下的预期会强化债市的做多情绪，一季度收益率曲线可能趋于陡峭，我们将密切关注流动性变化带来的收益率变化。

#### 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 16,111,912.48 元,货币 B 级 427,949,566.69 元。

二、已实施的利润分配:货币 A 级已分配 15,303,935.37 元,货币 B 级已分配 416,194,857.40 元。

三、应分配但尚未实施的利润:已分配但未支付的 12,562,686.40 元。应于收益支付日 2017 年 1 月 17 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6,623,758,227.87	10,842,795,641.45
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	2,681,473,332.86	3,616,570,413.60
其中：股票投资	-	-

基金投资	-	-
债券投资	2,681,473,332.86	3,596,570,413.60
资产支持证券投资	-	20,000,000.00
贵金属投资		
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	5,099,397,249.11	7,894,420,658.08
应收证券清算款	-	-
应收利息	61,468,957.65	74,900,684.44
应收股利	-	-
应收申购款	100.00	559,732,659.52
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	14,466,097,867.49	22,988,420,057.09
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016 年 12 月 31 日</b>	<b>2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>		
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	-	-
应付赎回款	685,718.89	2,944,274.81
应付管理人报酬	2,824,101.47	3,572,863.22
应付托管费	855,788.31	1,082,685.83
应付销售服务费	206,494.25	281,815.67
应付交易费用	76,828.25	126,901.98
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	12,562,686.40	15,872,243.86
递延所得税负债	-	-
其他负债	449,000.04	429,001.05
负债合计	17,660,617.61	24,309,786.42
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	14,448,437,249.88	22,964,110,270.67

未分配利润	-	-
所有者权益合计	14,448,437,249.88	22,964,110,270.67
负债和所有者权益总计	14,466,097,867.49	22,988,420,057.09

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 14,448,437,249.88，其中 A 级基金份额 936,827,517.79 份，其中 B 级基金份额 13,511,609,732.09 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>529,207,840.79</b>	<b>379,004,748.17</b>
1.利息收入	515,111,046.29	348,030,198.77
其中：存款利息收入	349,610,268.84	212,202,600.98
债券利息收入	123,134,853.23	118,244,711.83
资产支持证券利息收入	510,295.89	2,508,504.11
买入返售金融资产收入	41,855,628.33	15,074,381.85
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	14,096,794.50	30,836,949.40
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	14,096,794.50	30,836,949.40
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）	-	137,600.00

<b>减：二、费用</b>	<b>85,146,361.62</b>	<b>52,027,557.97</b>
1. 管理人报酬	56,025,668.02	30,346,917.27
2. 托管费	16,977,475.27	9,196,035.56
3. 销售服务费	3,310,409.72	3,370,121.86
4. 交易费用	120.00	-
5. 利息支出	8,270,284.06	8,558,549.39
其中：卖出回购金融资产支出	8,270,284.06	8,558,549.39
6. 其他费用	562,404.55	555,933.89
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>444,061,479.17</b>	<b>326,977,190.20</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>444,061,479.17</b>	<b>326,977,190.20</b>

### 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	22,964,110,270.67	-	22,964,110,270.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	444,061,479.17	444,061,479.17
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）	-8,515,673,020.79	-	-8,515,673,020.79
其中：1.基金申购款	87,452,059,334.28	-	87,452,059,334.28
2.基金赎回款	-95,967,732,355.07	-	-95,967,732,355.07
四、本期向基金份	-	-444,061,479.17	-444,061,479.17

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）			
五、期末所有者权益（基金净值）	14,448,437,249.88	-	14,448,437,249.88
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	4,143,065,890.91	-	4,143,065,890.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	326,977,190.20	326,977,190.20
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）	18,821,044,379.76	-	18,821,044,379.76
其中：1.基金申购款	63,686,218,818.27	-	63,686,218,818.27
2.基金赎回款	-44,865,174,438.51	-	-44,865,174,438.51
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）	-	-326,977,190.20	-326,977,190.20
五、期末所有者权益（基金净值）	22,964,110,270.67	-	22,964,110,270.67

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：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(以下简称“中国银行”)。

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。

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 2017 年 3 月 24 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本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[2004]78 号《财政部、国家税务总局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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1)于 2016 年 5 月 1 日前, 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。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自

2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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 2016年1月1日至2016年12月 31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	288,000,000.00	100.00%	35,000,000.00	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 2016年1月1日至2016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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	385.00	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 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	56,025,668.02	30,346,917.27
其中：支付销售机构的客户维护费	1,153,962.94	2,867,563.72

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 2016年1月1日至2016年12月	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月
----	--------------------------	-------------------------------

	31日	31日
当期发生的基金应支付的托管费	16,977,475.27	9,196,035.56

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 2016年1月1日至2016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	416,670.34	12,115.18	428,785.52
海通证券	20,760.77	1,928.97	22,689.74
海富通	98,719.56	1,465,342.88	1,564,062.44
合计	536,150.67	1,479,387.03	2,015,537.70
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	1,010,166.76	48,881.74	1,059,048.50
海通证券	42,793.71	321.10	43,114.81
海富通	92,901.52	722,975.38	815,876.90
合计	1,145,861.99	772,178.22	1,918,040.21

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	本期 2016年1月1日至2016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	交易金额	利息支出

关联方名称				入		
中国银行	10,226,566.45	149,813,246.72	-	-	10,135,318,000.00	702,684.99
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	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	-	80,095,209.18	-	-	12,940,410,000.00	1,050,909.93

#### 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

海富通货币 B

份额单位：份

关联方名称	海富通货币B本期末 2016年12月31日		海富通货币B上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
海通证券	300,000,000.00	2.08%	-	-

##### 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	3,758,227.87	225,855.06	42,795,641.45	136,248.27
中国银行-定期存款	460,000,000.00	260,666.68	-	-
合计	463,758,227.87	486,521.74	42,795,641.45	136,248.27

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 2016 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 3.21%(2015 年 12 月 31 日：0.19%)。

#### 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（2016 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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

##### 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 2016 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 2,681,473,332.86 元，无属于第一层次和第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第二层次 3,616,570,413.6 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化。

###### (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 2016 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(2015 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	2,681,473,332.86	18.54
	其中：债券	2,681,473,332.86	18.54
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	5,099,397,249.11	35.25
	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	6,623,758,227.87	45.79
4	其他各项资产	61,469,057.65	0.42
5	合计	14,466,097,867.49	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	2.43	
	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	-	-

	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

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%。

## 8.3 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	43
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	102
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 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 120 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	60.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	12.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	18.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	1.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天	-	-

	的浮动利率债		
5	120 天（含）—397 天（含）	7.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	99.70	-

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 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存续期未超过 240 天。

#### 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	740,978,533.41	5.13
	其中：政策性金融债	740,978,533.41	5.13
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	599,956,097.53	4.15
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,340,538,701.92	9.28
8	其他		
9	合计	2,681,473,332.86	18.56
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 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	140201	14 国开 01	5,300,000	530,614,621.82	3.67
2	150302	15 进出 02	1,100,000	110,090,576.41	0.76

3	140302	14 进出 02	1,000,000	100,273,335.18	0.69
4	011699945	16 中核建 SCP002	1,000,000	100,113,302.87	0.69
5	011698290	16 厦港务 SCP004	1,000,000	99,984,521.83	0.69
6	041658044	16 中科资产 CP001	1,000,000	99,950,643.96	0.69
7	111610399	16 兴业 CD399	1,000,000	99,858,564.47	0.69
8	111698905	16 郑州银行 CD107	1,000,000	99,803,721.33	0.69
9	111698942	16 郑州银行 CD109	1,000,000	99,795,500.03	0.69
10	111699453	16 广州银行 CD085	1,000,000	99,685,448.65	0.69

### 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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0485%
报告期内偏离度的最低值	-0.1788%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0239%

注：以上数据按交易日统计。

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

### 8.8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。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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。

**8.9.2** 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

### 8.9.3 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	61,468,957.65
4	应收申购款	100.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	61,469,057.65

## § 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

份额级别	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	91,637	10,223.25	51,070,166.02	5.45%	885,757,351.77	94.55%
海富通货币 B	181	74,649.777.53	12,735,740.394.41	94.26%	775,869,337.68	5.74%
合计	91,818	157,359.53	12,786,810.560.43	88.50%	1,661,626,689.45	11.50%

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	46,717.78	0.0050%
	海富通货币 B	-	-
	合计	46,717.78	0.0003%

### 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	0
	海富通货币 B	0
	合计	0
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	1,582,873,053.84	21,381,237,216.83
本报告期基金总申购份额	3,456,347,602.73	83,995,711,731.55
减：本报告期基金总赎回份额	4,102,393,138.78	91,865,339,216.29
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	936,827,517.79	13,511,609,732.09

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、2016 年 1 月 20 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四十八次临时会议审议通过，同意戴德舜先生辞去公司副总裁的职务。

2、2016 年度，因第四届董事会任期届满，经公司临时股东大会审议通过，同意张文伟、刘颂(Patrick LIU)、杨明、黄正红、陶乐斯(Ligia Torres)、黄金源(Alex NG Kim Guan)、郑国汉(Leonard K.Cheng)、巴约特(Marc Bayot)、杨国平、张馨担任公司第五届董事会董事，其中郑国汉(Leonard K.Cheng)、巴约特(Marc Bayot)、杨国平、张馨为独立董事。

3、2016 年 11 月 5 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第五届董事会第七次会议审议通过，同意阎小庆先生辞去公司副总裁的职务。

4、2017 年 2 月 4 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第五届董事会第十次临时会议审议通过，同意刘颂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。

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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 140,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 12 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
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	-	-	-	-	-

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	-	-	288,000,000.00	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 43 只公募基金。截至 2016 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 443 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 2016 年 12 月 31 日，海富通为近 80 家企业超过 370 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 2016 年 12 月 31 日，海富通旗下专户理财管理资产规模超过 221 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。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 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首批基本养老保险基金投资管理人。

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 2016 年 12 月 31 日，投资咨询及海外业务规模超过 63 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。

2016 年 3 月，国内权威财经媒体《中国证券报》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。

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。

海富通基金管理有限公司

二〇一七年三月二十八日