

海富通货币市场证券投资基金

2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 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：二〇一一年八月二十九日

1 重要提示及目录

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。本半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 2011 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	7
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现	8
4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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	13
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4	报表附注	19
7	投资组合报告	38
7.1	期末基金资产组合情况.....	38
7.2	债券回购融资情况.....	39
7.3	基金投资组合平均剩余期限.....	39
7.4	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.5	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	41
7.6	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	42
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	42
7.8	投资组合报告附注.....	42
8	基金份额持有人信息.....	43

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	43
9	开放式基金份额变动.....	44
10	重大事件揭示	44
10.1	基金份额持有人大会决议.....	44
10.2	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.....	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4	基金投资策略的改变.....	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	46
10.9	其他重大事件	46
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	48
12	备查文件目录	49
12.1	备查文件目录	49
12.2	存放地点	49
12.3	查阅方式	49

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通货币市场证券投资基金	
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	3,138,341,742.44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	664,321,727.60份	2,474,020,014.84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	唐州徽
	联系电话	021-38650891	010-66594855
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
注册地址		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	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		邵国有	肖钢

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）	
	海富通货币 A	海富通货币 B
本期已实现收益	14,141,913.64	91,800,052.84
本期利润	14,141,913.64	91,800,052.84
本期净值收益率	1.7304%	1.8515%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)	
	海富通货币 A	海富通货币 B
期末基金资产净值	664,321,727.60	2,474,020,014.84
期末基金份额净值	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)	
	海富通货币 A	海富通货币 B
累计净值收益率	18.5576%	15.7954%

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 1 个月	0.3039%	0.0070%	0.2632%	0.0000%	0.0407%	0.0070%
过去 3 个月	0.8835%	0.0060%	0.7972%	0.0002%	0.0863%	0.0058%
过去半年	1.7304%	0.0045%	1.5082%	0.0005%	0.2222%	0.0040%
过去 1 年	2.8588%	0.0054%	2.7075%	0.0010%	0.1513%	0.0044%
过去 3 年	7.8899%	0.0091%	8.0893%	0.0015%	-0.1994%	0.0076%
自基金合同 生效起至今	18.5576%	0.0080%	17.4434%	0.0020%	1.1142%	0.0060%

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 1 个月	0.3239%	0.0070%	0.2632%	0.0000%	0.0607%	0.0070%
过去 3 个月	0.9437%	0.0060%	0.7972%	0.0002%	0.1465%	0.0058%
过去半年	1.8515%	0.0045%	1.5082%	0.0005%	0.3433%	0.0040%
过去 1 年	3.1055%	0.0054%	2.7075%	0.0010%	0.3980%	0.0044%
过去 3 年	8.6683%	0.0091%	8.0893%	0.0015%	0.5790%	0.0076%
自基金合同 生效起至今	15.7954%	0.0085%	14.1943%	0.0019%	1.6011%	0.0066%

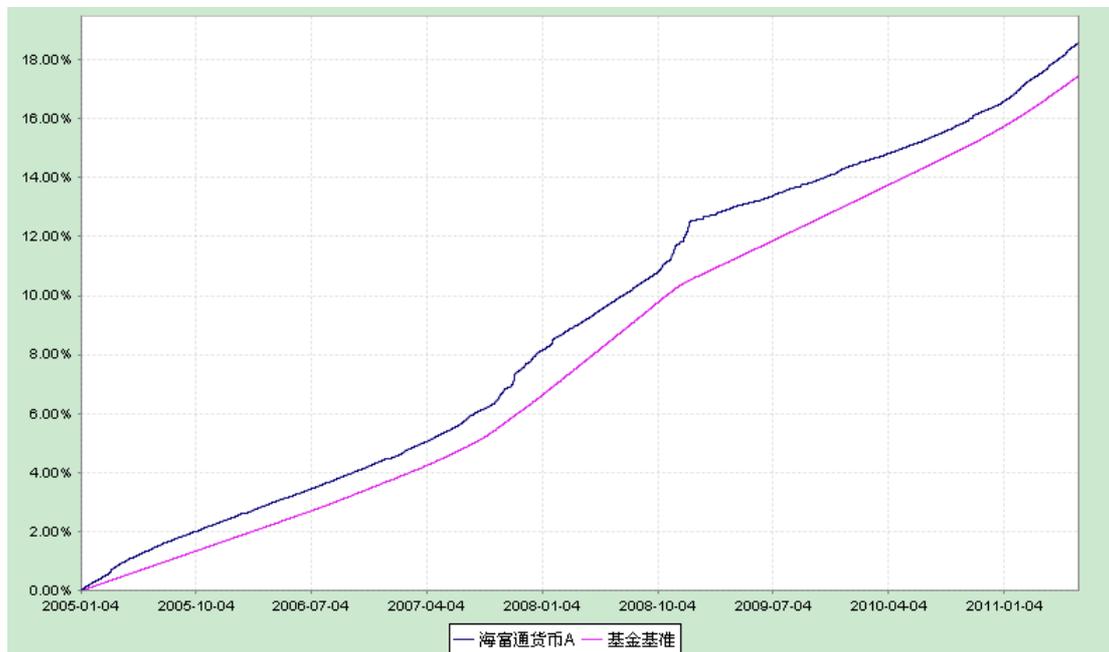
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

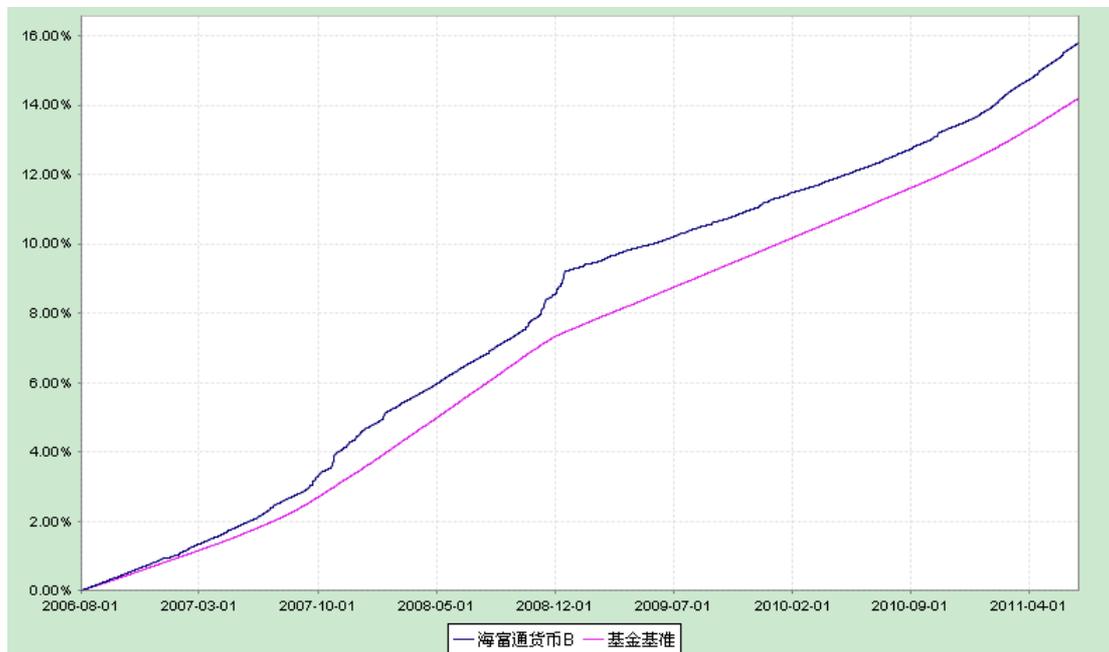
1、海富通货币 A

(2005 年 1 月 4 日至 2011 年 6 月 30 日)



2、海富通货币 B

(2006 年 8 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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。

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开放式基金；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、海富通精选贰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和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十七只开放式基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张丽洁	本基金的基金经理	2008-02-14	-	8 年	经济学学士学位，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，现任海富通货币基金基金经理。

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为：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 管理人对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

2011 年上半年经济略有降温，外围经济相对平稳，通胀压力迅速上升，6 月份 CPI 达到 6.4% 的历史高位。为应对不断创新高的通胀压力，央行 2 次上调利率，6 次上调准备金率，货币政策转向明显。随着准备金调整，市场资金全面抽紧，特别在银行应付春节流动资金以及 6 月末的存款考核日，货币市场利率 2 次大幅飙升，短期资金利率一次又一次超过 8% 的年历史高点。今年初债券曾经走过一段小阳行情，由于信用债票面收益较高，市场在静待利率政策的同时，优先选择信用债券，但是随着资金成本的不断高企，债券收益率一路上行，信用利率债券无一幸免。特别到了 6 月份维持较长时间的资金紧张，使得债券市场溃不成军。

加上出台了保障房的债券融资信号,使得信用债特别是城投类债券下半年的发行预期大幅度增加。一时之间,信用债从去年的香饽饽到了今日无人问津。

海富通货币基金上半年规模下降明显,特别在半年末遭遇大额赎回。海富通货币在二季度中降低了信用债券的投资比例,但是由于半年底规模缩水所以比例反而被动提高,在上半年一直维持高比例的存款,利率债券投资比例下降。总体而言海富通货币保持了较好的流动性和稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内, A 级基金净值收益率为 1.7304%, 同期业绩比较基准收益率为 1.5082%; B 级基金净值收益率为 1.8515%, 同期业绩比较基准收益率为 1.5082%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金认为三季度通胀仍将小幅回落,但是市场对于央行再一次加息还是有强烈预期。准备金的上调频率会明显小于上半年,所以资金面变化应不会再如上半年剧烈。但是城投债流动性缺失引发的信用债甚至是整个债券市场的调整一触即发,最终的政策取向和市场认同大家都在静待结果,所以认为目前不是大幅加仓和延长久期的适当时机,应该综合考虑经济发展和宏观政策的变动。不过本基金认为下半年的机会应该要好于上半年,接下来的两个季度将适时增加利率债券久期和仓位。

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,并经本公司业务管理委员会批准后实施。

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 14,141,913.64 元，货币 B 级 91,800,052.84 元。

二、已实施的利润分配：货币 A 级已分配 13,329,023.53 元，货币 B 级已分配 88,612,510.93 元。

三、应分配但尚未实施的利润：已分配但未支付的利润 4,000,432.02 元。应于收益支付日 2011 年 7 月 17 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。

5.3 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	910,103,762.27	1,925,087,253.56
结算备付金		-	1,365,909.09
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,716,807,316.75	2,482,727,563.97
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,716,807,316.75	2,482,727,563.97
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	823,741,835.61	2,122,912,129.35
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	28,282,011.36	20,912,541.30
应收股利		-	-
应收申购款		4,767,616.99	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,483,702,542.98	6,553,005,397.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日

负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		333,199,633.40	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,728,433.45	45,383,609.39
应付管理人报酬		1,463,212.03	1,367,214.34
应付托管费		443,397.59	414,307.36
应付销售服务费		245,764.89	151,863.15
应付交易费用	6.4.7.7	35,159.11	75,920.68
应交税费		988,000.00	988,000.00
应付利息		46,101.72	-
应付利润		4,000,432.02	5,153,112.32
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	210,666.33	421,150.15
负债合计		345,360,800.54	53,955,177.39
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,138,341,742.44	6,499,050,219.88
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		3,138,341,742.44	6,499,050,219.88
负债和所有者权益总计		3,483,702,542.98	6,553,005,397.27

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 3,138,341,742.44 份，其中 A 级基金份额 664,321,727.60 份，其中 B 级基金份额 2,474,020,014.84 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通货币市场证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		121,553,769.29	64,135,318.61
1.利息收入		117,870,446.74	60,433,578.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	36,489,149.38	18,110,067.29
债券利息收入		43,497,056.52	36,949,602.81
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收入		37,884,240.84	5,373,908.51
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,683,322.55	3,701,740.00
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	3,683,322.55	3,701,740.00
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	-	-
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.15	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.16	-	-
减：二、费用		15,611,802.81	15,842,528.87

1. 管理人报酬		9,554,880.67	9,127,491.29
2. 托管费		2,895,418.44	2,765,906.50
3. 销售服务费		1,279,175.71	1,250,067.60
4. 交易费用	6.4.7.17	-	-
5. 利息支出		1,632,656.88	2,416,534.72
其中：卖出回购金融资产支出		1,632,656.88	2,416,534.72
6. 其他费用	6.4.7.18	249,671.11	282,528.76
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		105,941,966.48	48,292,789.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		105,941,966.48	48,292,789.74

6.3 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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)	6,499,050,219.88	-	6,499,050,219.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	105,941,966.48	105,941,966.48
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)	-3,360,708,477.44	-	-3,360,708,477.44

其中：1. 基金申购款	18,585,776,152.31	-	18,585,776,152.31
2. 基金赎回款	-21,946,484,629.75	-	-21,946,484,629.75
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）	-	-105,941,966.48	-105,941,966.48
五、期末所有者权益（基金净值）	3,138,341,742.44	-	3,138,341,742.44
项目	上年度可比期间		
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 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）	11,134,497,053.54	-	11,134,497,053.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	48,292,789.74	48,292,789.74
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）	-5,016,788,877.33	-	-5,016,788,877.33
其中：1. 基金申购款	10,778,254,140.58	-	10,778,254,140.58
2. 基金赎回款	-15,795,043,017.91	-	-15,795,043,017.91
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）	-	-48,292,789.74	-48,292,789.74
五、期末所有者权益（基金净值）	6,117,708,176.21	-	6,117,708,176.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 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,本基金将基金份额分为不同的类别,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 2011 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 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”)、中国证监会公告[2010]5号《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2011年上半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2011年6月30日的财务状况以及2011年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本基金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一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错。

6.4.6 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》及其他相关税务法规和实务操作,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。
- (2)基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	10,103,762.27
定期存款	900,000,000.00
其中:存款期限1-3个月	700,000,000.00
存款期限1个月以内(包括1个月)	200,000,000.00

其他存款	-
合计	910,103,762.27

注：定期存款的存款期限为定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	1,716,807,316.75	1,717,394,000.00	586,683.25	0.0187
	合计	1,716,807,316.75	1,717,394,000.00	586,683.25	0.0187

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间	823,741,835.61	-
合计	823,741,835.61	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	10,305.05
应收定期存款利息	5,048,888.47
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	17,701,980.19
应收买入返售证券利息	5,516,654.52
应收申购款利息	4,183.13
其他	-
合计	28,282,011.36

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	35,159.11
合计	35,159.11

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	372.95
预提费用	210,293.38
合计	210,666.33

6.4.7.9 实收基金

海富通货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	814,445,461.42	814,445,461.42
本期申购	4,142,131,024.96	4,142,131,024.96
本期赎回（以“-”号填列）	-4,292,254,758.78	-4,292,254,758.78
本期末	664,321,727.60	664,321,727.60

海富通货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	5,684,604,758.46	5,684,604,758.46
本期申购	14,443,645,127.35	14,443,645,127.35
本期赎回（以“-”号填列）	-17,654,229,870.97	-17,654,229,870.97
本期末	2,474,020,014.84	2,474,020,014.84

注：申购含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调减份额。

6.4.7.10 未分配利润

海富通货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	14,141,913.64	-	14,141,913.64
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-14,141,913.64	-	-14,141,913.64
本期末	-	-	-

海富通货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	91,800,052.84	-	91,800,052.84
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-91,800,052.84	-	-91,800,052.84
本期末	-	-	-

注：本基金根据基金合同按日结转，按月分配。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	402,130.95
定期存款利息收入	35,905,555.69
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	17,250.61
其他	164,212.13
合计	36,489,149.38

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,747,223,889.21
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,701,438,099.88
减：应收利息总额	42,102,466.78
债券投资收益	3,683,322.55

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期末持有衍生工具。

6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.15 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.17 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	57,027.67
信息披露费	148,765.71
银行费用	34,877.73
债券托管账户维护费	9,000.00
合计	249,671.11

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

	宣告日	分配收益所属期间
2011 年度		
—第 7 号收益支付公告	2011/07/18	2011/06/16-2011/07/17
—第 8 号收益支付公告	2011/08/16	2011/07/18-2011/08/15

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金代销机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	2,450,000,000.00	100.00%	1,090,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30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	26,950.00	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	11,990.00	100.00%	11,550.00	100.00%
------	-----------	---------	-----------	---------

注：佣金的比率是公允的，符合证监会有关规定。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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,554,880.67	9,127,491.29
其中：支付销售机构的客户 维护费	1,027,838.40	990,339.43

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 × 0.33% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	2,895,418.44	2,765,906.50

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 × 0.1% / 当年天数。

6.4.10.2.3 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 2011年1月1日至2011年6月30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	130,388.47	7,695.39	138,083.86
海通证券	20,879.80	935.05	21,814.85
海富通基金	57,321.42	175,333.48	232,654.90
合计	208,589.69	183,963.92	392,553.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	236,147.06	6,896.21	243,043.27
海通证券	4,860.51	617.97	5,478.48
海富通基金	57,646.39	181,845.59	239,491.98
合计	298,653.96	189,359.77	488,013.73

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。

6.4.10.3 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

本期 2011年1月1日至2011年6月30日						
银行间市场 交易的各关	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

关联方名称						
中国银行	-	-	100,000,000.00	381,921.78	1,465,400,000.00	191,585.71
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	-	-	-	-	951,600,000.00	38,322.97

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	10,103,762.27	402,130.95	39,417,624.65	5,419,962.98
中国银行-定期存款	-	-	-	1,577,000.00

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.6 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通过关联方购买其承销的证券。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况**1、海富通货币 A**

单位：人民币元

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	本期利润分配 合计	备注
10,563,285.45	3,343,696.25	234,931.94	14,141,913.64	-

2、海富通货币B

单位：人民币元

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	本期利润分配 合计	备注
77,078,616.77	16,109,048.31	-1,387,612.24	91,800,052.84	-

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 333, 199, 633. 40 元, 是以如下债券作为质押:

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值 总额
058031	05中信债1	2011-07-01	98.45	1,800,000	177,210,000.00
0980147	09中航工债浮	2011-07-01	102.79	1,600,000	164,464,000.00
合计		-	-	3,400,000	341,674,000.00

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险管理委员会，实施董事会风险委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的四层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发

行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款及部分定期存款存放在本基金的托管行中国银行，其他定期存款存放在具有托管资格的上海银行股份有限公司和中信银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
A-1	545,743,636.31	1,000,637,901.92
A-1 以下	-	-
未评级	249,836,913.69	592,303,868.69
合计	795,580,550.00	1,592,941,770.61

注：未评级部分为央行票据及政策性金融债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
AAA	871,289,453.01	538,809,239.74
AAA 以下	-	-
未评级	49,937,313.74	350,976,553.62
合计	921,226,766.75	889,785,793.36

注：未评级部分为政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资于一家公司发行的短期融资券及短期企业债券不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 180 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的 20%。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金、买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感

性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6 月30日	6个月 以内	6个月-1 年	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产						
银行存款	910,103, 762.27	-	-	-	-	910,103,76 2.27
交易性金 融资产	865,647, 596.66	851,159, 720.09	-	-	-	1,716,807, 316.75
买入返售 金融资产	823,741, 835.61	-	-	-	-	823,741,83 5.61
应收利息	-	-	-	-	28,282,0 11.36	28,282,011 .36
应收申购 款	2,099,70 0.00	-	-	-	2,667,91 6.99	4,767,616. 99
资产总计	2,601,59 2,894.54	851,159, 720.09	-	-	30,949,9 28.35	3,483,702, 542.98
负债						
卖出回购 金融资产 款	333,199, 633.40	-	-	-	-	333,199,63 3.40
应付赎回 款	-	-	-	-	4,728,43 3.45	4,728,433. 45
应付管理 人报酬	-	-	-	-	1,463,21 2.03	1,463,212. 03
应付托管	-	-	-	-	443,397.	443,397.59

费					59	
应付销售 服务费	-	-	-	-	245,764. 89	245,764.89
应付交易 费用	-	-	-	-	35,159.1 1	35,159.11
应交税费	-	-	-	-	988,000. 00	988,000.00
应付利息	-	-	-	-	46,101.7 2	46,101.72
应付利润	-	-	-	-	4,000,43 2.02	4,000,432. 02
其他负债	-	-	-	-	210,666. 33	210,666.33
负债总计	333,199, 633.40	-	-	-	12,161,1 67.14	345,360,80 0.54
利率敏感 度缺口	2,268,39 3,261.14	851,159, 720.09	-	-	18,788,7 61.21	3,138,341, 742.44
上年度末 2010年12 月31日	6个月以 内	6个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	1,925,08 7,253.56	-	-	-	-	1,925,087, 253.56
交易性金 融资产	869,132, 514.81	1,613,59 5,049.16	-	-	-	2,482,727, 563.97
买入返售 金融资产	2,122,91 2,129.35	-	-	-	-	2,122,912, 129.35
应收利息	-	-	-	-	20,912,5	20,912,541

					41.30	.30
结算备付金	1,365,909.09	-	-	-	-	1,365,909.09
资产总计	4,918,497,806.81	1,613,595,049.16	-	-	20,912,541.30	6,553,005,397.27
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	45,383,609.39	45,383,609.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,367,214.34	1,367,214.34
应付托管费	-	-	-	-	414,307.36	414,307.36
应付销售服务费	-	-	-	-	151,863.15	151,863.15
应付交易费用	-	-	-	-	75,920.68	75,920.68
应交税费	-	-	-	-	988,000.00	988,000.00
应付利润	-	-	-	-	5,153,112.32	5,153,112.32
其他负债	-	-	-	-	421,150.15	421,150.15
负债总计	-	-	-	-	53,955,177.39	53,955,177.39
利率敏感度缺口	4,918,497,806.81	1,613,595,049.16	-	-	-33,042,636.09	6,499,050,219.88

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	市场利率上升25个基点	减少约455.00万元	减少约808.00万元
	市场利率下降25个基点	增加约460.00万元	增加约815.00万元

注：影响金额为约数，精确到万元。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告**7.1 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	1,716,807,316.75	49.28
	其中：债券	1,716,807,316.75	49.28
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	823,741,835.61	23.65
	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	910,103,762.27	26.12
4	其他各项资产	33,049,628.35	0.95
5	合计	3,483,702,542.98	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.32	
	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	333,199,633.40	10.62
	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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	108
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	139
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

报告期内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。

7.3.2 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	43.74	10.62
	其中：剩余存续期超过 397 天 的浮动利率债	5.18	-
2	30 天(含)—60 天	14.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天 的浮动利率债	4.38	-
3	60 天(含)—90 天	6.98	-
	其中：剩余存续期超过 397 天 的浮动利率债	1.59	-
4	90 天(含)—180 天	17.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天 的浮动利率债	7.83	-
5	180 天(含)—397 天(含)	27.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天 的浮动利率债	-	-
6	合计	109.96	10.62

7.4 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	299,774,227.43	9.55
	其中：政策性金融债	299,774,227.43	9.55
4	企业债券	545,743,636.31	17.39
5	企业短期融资券	871,289,453.01	27.76
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,716,807,316.75	54.70
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	595,680,950.05	18.98

7.5 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	058031	05 中信债 1	1,800,000	177,515,680.16	5.66
2	0980147	09 中航工债浮	1,600,000	162,705,829.65	5.18
3	1181252	11 浙商集 CP01	1,500,000	150,251,563.35	4.79
4	110222	11 国开 22	1,500,000	149,873,116.43	4.78
5	068007	06 首都机场债	1,400,000	137,370,783.32	4.38
6	1181084	11 浙小商 CP01	1,000,000	100,147,185.82	3.19
7	100231	10 国开 31	1,000,000	99,963,797.26	3.19
8	1181249	11 神火 CP01	800,000	80,141,826.90	2.55
9	1181067	11 悦达 CP01	700,000	70,182,733.96	2.24

10	1081302	10 万向 CP01	700,000	69,991,141.30	2.23
----	---------	------------	---------	---------------	------

7.6 “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	19
报告期内偏离度的最高值	0.3160%
报告期内偏离度的最低值	-0.0122%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1641%

注：以上数据按银行间交易日统计。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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。

7.8.2 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。

7.8.3 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。

7.8.4 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	28,282,011.36
4	应收申购款	4,767,616.99
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	33,049,628.35

8 基金份额持有人信息

8.1 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	10,229	64,944.93	83,361,640.22	12.55%	580,960,087.38	87.45%
海富通货币 B	90	27,489,111.28	2,269,153,706.70	91.72%	204,866,308.14	8.28%
合计	10,319	304,132.35	2,352,515,346.92	74.96%	785,826,395.52	25.04%

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）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	海富通货币 A	149,424.30	0.0225%
	海富通货币 B	-	-
	合计	149,424.30	0.0048%

9 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	814,445,461.42	5,684,604,758.46
本报告期基金总申购份额	4,142,131,024.96	14,443,645,127.35
减：本报告期基金总赎回份额	4,292,254,758.78	17,654,229,870.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	664,321,727.60	2,474,020,014.84

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。

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理；因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	-	-	26,950.00	100.00%	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算。

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,并报公司业务管理委员会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后,由基金管理人的业务管理委员会核准。

3、本报告期内,本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 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	-	-	2,450,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 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%。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司旗下开放式基金 2010年最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-01-01
2	关于开通海富通稳固收益债券型证券投资基金与公司旗下部分基金之间转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-01-05
3	关于海富通旗下部分基金增加日信证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-01-05
4	关于调整旗下部分基金在中国建设银行定	《中国证券报》、《上	2011-01-18

	定期投资起点金额的公告	海证券报》和《证券时报》	
5	关于海富通货币基金春节长假前两个工作日暂停申购和转换转入业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-01-26
6	于海富通旗下部分基金增加红塔证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-01-26
7	关于旗下部分基金新增华夏银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-02-25
8	海富通基金管理有限公司关于调整网上直销定期定额申购最低起点金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-03-02
9	关于海富通货币基金清明节前两个工作日暂停申购和转换转入业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-03-28
10	海富通基金管理有限公司关于公司股东名称变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-04-07
11	关于海富通货币基金五一假期前两个工作日暂停申购和转换转入业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-04-25
12	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-05-11
13	关于海富通货币基金端午节前两个工作日暂停申购和转换转入业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-05-30

14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在中山证券有限责任公司开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-06-17
15	海富通基金管理有限公司关于在中国银行开立的直销账户银行账号变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-06-17
16	海富通货币市场证券投资基金暂停大额申购、大额定期定额投资的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-06-28

11 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 18 只开放式基金。截至 2011 年 6 月 30 日,海富通管理的公募基金资产规模超过 392 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 2011 年 6 月 30 日,海富通为 50 多家企业超过 150 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 2011 年 6 月 30 日,海富通旗下专户理财管理资产规模近 25 亿元。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 2011 年 6 月 30 日,投资咨询及海外业务规模达 219 亿元人民币。

2011 年 3 月 31 日,海富通在由《证券时报》举办的 2010 年度“中国基金业明星奖”评选中,获“2010 年度十大明星基金公司”奖。4 月 8 日,在《上海证券报》主办的第八届中国“金基金奖”评选中,海富通基金获得“2010 年度金基金公司奖——海外投资回报公司”奖。4 月 10 日,在《中国证券报》主办的“第八届中国基金业金牛奖”评选中,海富通基金获得“2010 年度金牛基金管理公司”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公益林。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。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证券监督管理委员会批准设立海富通货币市场证券投资基金的文件
- (二) 海富通货币市场证券投资基金基金合同
- (三) 海富通货币市场证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通货币市场证券投资基金托管协议
- (五) 中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六) 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

12.2 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 层基金管理人办公地址。

12.3 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

二〇一一年八月二十九日