

海富通现金管理货币市场基金
2015 年半年度报告摘要
2015 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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年八月二十八日

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通现金管理货币	
基金主代码	519528	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 3 月 13 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,732,102.45 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通现金管理货币 A	海富通现金管理货币 B
下属分级基金的交易代码	519528	519529
报告期末下属分级基金的份额总额	2,615,132.19 份	5,116,970.26 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资风险和保持较高流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金投资策略将审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，力求将各类风险降到最低，在控制投资组合良好流动性的前提下为投资者获取稳定的收益。
业绩比较基准	七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	洪渊
	联系电话	021-38650891	010-66105799
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588

传真	021-33830166	010-66105798
----	--------------	--------------

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.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

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（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）	
	海富通现金管理货币 A	海富通现金管理货币 B
本期已实现收益	95,227.18	229,003.74
本期利润	95,227.18	229,003.74
本期净值收益率	0.9524%	1.0719%
3.1.2 期末 数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
	海富通现金管理货币 A	海富通现金管理货币 B
期末基金资产净值	2,615,132.19	5,116,970.26
期末基金份额净值	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. 海富通现金管理货币 A:

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	① - ③	② - ④
----	--------------	--------------	--------------	--------------	-------	-------

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	0.0694%	0.0016%	0.1103%	0.0000%	-0.0409%	0.0016%
过去三个月	0.2266%	0.0017%	0.3349%	0.0000%	-0.1083%	0.0017%
过去六个月	0.9524%	0.0038%	0.6672%	0.0000%	0.2852%	0.0038%
过去一年	2.6813%	0.0037%	1.3500%	0.0000%	1.3313%	0.0037%
自基金合同 生效起至今	6.2892%	0.0036%	3.1342%	0.0000%	3.1550%	0.0036%

2. 海富通现金管理货币 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
过去一个月	0.0896%	0.0016%	0.1103%	0.0000%	-0.0207%	0.0016%
过去三个月	0.2875%	0.0017%	0.3349%	0.0000%	-0.0474%	0.0017%
过去六个月	1.0719%	0.0038%	0.6672%	0.0000%	0.4047%	0.0038%
过去一年	2.9294%	0.0037%	1.3500%	0.0000%	1.5794%	0.0037%
自基金合同 生效起至今	6.8791%	0.0036%	3.1342%	0.0000%	3.7449%	0.0036%

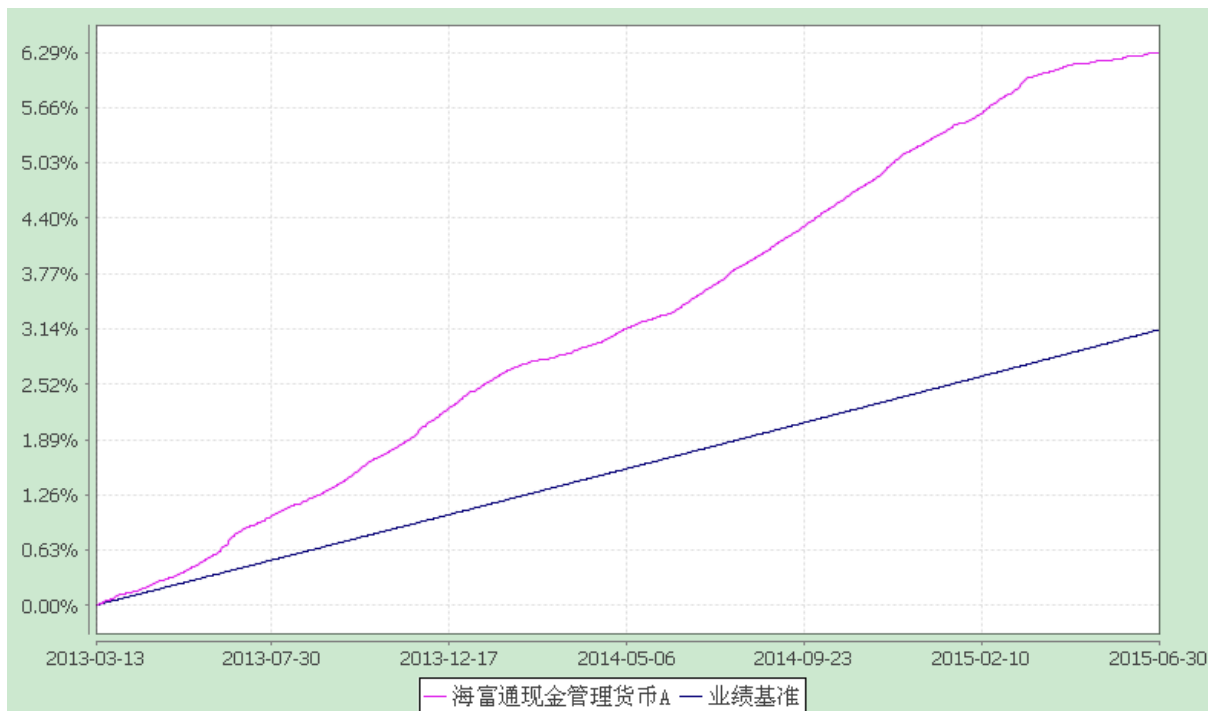
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通现金管理货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

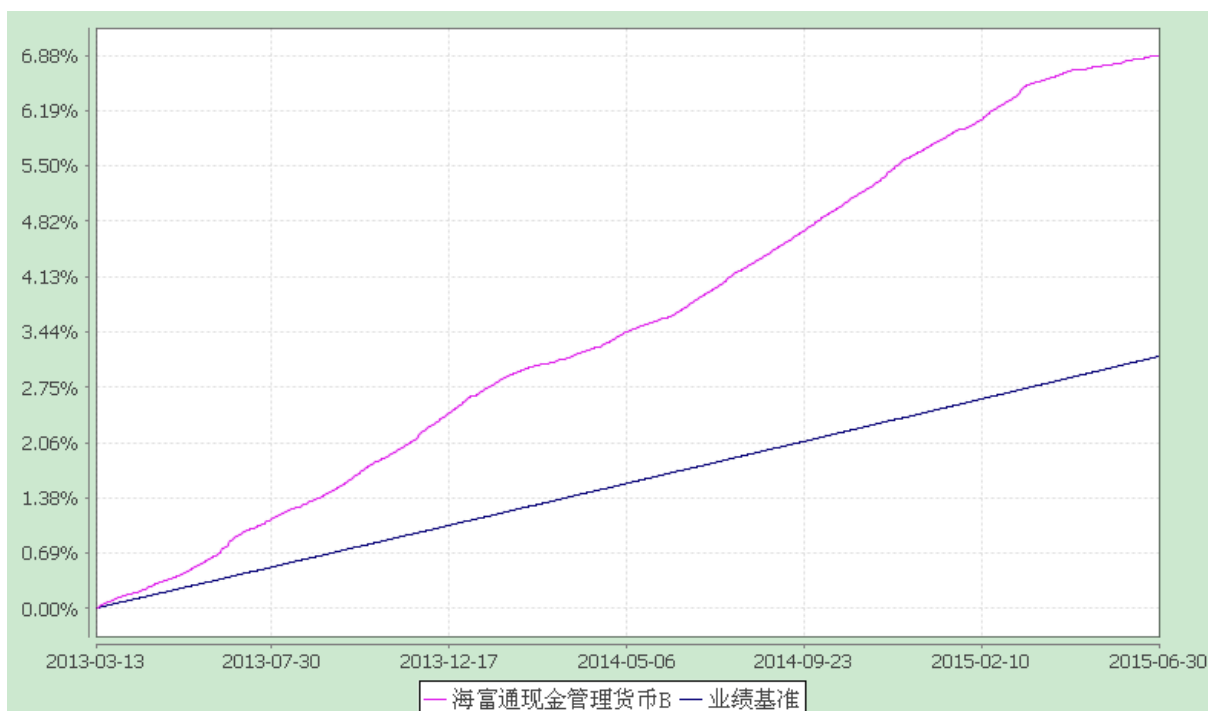
1. 海富通现金管理货币 A

(2013 年 3 月 13 日至 2015 年 6 月 30 日)



2. 海富通现金管理货币 B

(2013 年 3 月 13 日至 2015 年 6 月 30 日)



注：本基金合同于 2013 年 3 月 13 日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 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十二条（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

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。截至 2015 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 32 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、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。

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		
凌超	本基金的基金经理，海富通一年定期债券基金经理；海富通纯债债券	2013-03-13	-	8 年	硕士,持有基金从业人员资格证书，先后任职于长江证券股份有限公司、光大保德信基金管理有限公司，曾任光大保德信货币基金经理。2006 年 7 月至 2009 年 6 月在长江证券股份有限公司先后担任债券高级研究员、投资经理；2009 年 7 月至 2010 年 2 月

	基金经 理；海 富通稳 固收益 债券基 金经理； 海富通 稳进增 利债券 （LOF ）基金 经理				在光大保德信基金管理有 限公司担任债券研究员， 2010 年 2 月至 2010 年 8 月 担任光大保德信增利收益 债券基金经理助理， 2010 年 9 月至 2012 年 2 月担任光大保德信货币基 金经理；2012 年 3 月加入 海富通基金管理有限公司， 2013 年 3 月起，任海富通 现金管理货币基金经理。 2013 年 12 月起兼任海富通 一年定开债券基金经理。 2014 年 4 月起兼任海富通 纯债债券基金经理。 2014 年 12 月起兼任海富通 稳固收益债券和海富通稳 进增利债券（LOF）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 稳健添 利债券 基金经 理；海 富通新 内需混 合基金 经理	2014-07-30	-	10 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 月起任海富通现 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。

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 公平交易制度的执行情况

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。

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。

报告期内，公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、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）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，检验结果表明，在 T 日、T+3 日和 T+5 日不同循环期内，不管是买入或是卖出，公司各组合间买卖价差并不显著，表明报告期内公司对旗下各基金进行了公平对待，不存在各投资组合之间进行利益输送的行为。

4.3.2 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

上半年经济基本面总体疲弱，工业、投资等多项经济数据屡屡创下近年来的新低，一季度 GDP 增速 7% 也已接近政府“底线”。在这种情况下政府显现出强烈的稳增长意愿，货币政策延续宽松，上半年央行接连实施了三次降准和三次降息，并持续通过 SLF、MLF 等定向手段向市场注入流动性。但由于一季度人民币贬值预期加重，外汇占款减少，IPO 分流资金，导致一季度货币市场利率维持在高位。四月央行降准之后，短端宽松政策明确，短端利率开始大幅下降，7 天回购利率一度维持 2% 以下，一年期 AAA 短融收益率在 6 月底比一季末下降了 140bp，银行同业存款利率也大幅下降，一年内同业存款利率全面低于 4%。但是长端利率却始终处于区间震荡而无法突破下行。利率债收益率曲线从年初的“极度平坦”转变为目前的“极度陡峭”，说明宽货币释放的大量资金被淤积在银行间而未有效投向实体，降低实体经济融资成本的目标仍任重道远。

本基金组合主要以流动性管理为主要侧重点，根据客户流动性需求，配置交易所回购以最大幅度增加流动性。目前基金资产风险较低、流动性状态也较为良好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，海富通现金管理货币 A 类基金净值收益率为 0.9524%，同期业绩比较基准收益率为 0.6672%；海富通现金管理货币 B 类基金净值收益率为 1.0719%，同期业绩比较基准收益率为 0.6672%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前各项经济数据显示基本面仍未企稳，未来仍有下行压力；通胀维持低位，央行货币政策难以转向，而且从手段上看无论是定向工具的运用还是降准、降息都还有放松的空间；但另一方面，市场对下半年经济企稳和通胀反弹的预期在增强，加上地方债置换供给不断、利率市场化的推进、股市分流效应使得债券长端利率水平受到压制，而短端利率已难以更低。货币政策从短端向长端传导不畅，从金融向实体传导不畅，央行的政策目标可能会发生微调。目前看货币宽松的大方向不会变，但经历了多次降息降准后未来货币政策的重点可能在于疏通传导，因此央行的操作会变得更为“平衡”，这种平衡包括短期和长期资金的平衡、利率和汇率的平衡。

本基金仍将致力于做好流动性管理，控制好组合的各项风险指标。在此基础上，抓住关键时点做好资产配置。

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 95,227.18 元，货币 B 级 229,003.74 元。

二、已实施的利润分配：货币 A 级已分配 94,299.34 元，货币 B 级已分配 226,665.63 元。

三、应分配但尚未实施的利润：已分配但未支付的利润 3,265.95 元。应于收益支付日 2015 年 7 月 15 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

本基金自 2015 年 1 月 26 日至 2015 年 6 月 30 日，已连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，本基金已于 2015 年 6 月 25 日至 2015 年 7 月 20 日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议通过了《关于终止海富通现金管理货币市场基金基金合同有关事项的议案》，并于 2015 年 7 月 23 日进入财产清算期。

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，本基金托管人在对海富通现金管理货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，海富通现金管理货币市场基金的管理人——海富通基金管理有限公司在海富通现金管理货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的海富通现金管理货币市场基金 2015 年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、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：海富通现金管理货币市场基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,439,067.77	9,400,110.38
结算备付金		169,000.00	5,795,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	-	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	6,200,000.00	45,000,000.00
应收证券清算款		675.89	-
应收利息	6.4.7.5	1,426.81	26,169.28
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,810,170.47	60,221,279.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,207.93	107,694.57
应付托管费		740.36	32,634.73

应付销售服务费		841.99	5,895.11
应付交易费用	6.4.7.7	-	1,950.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		3,265.95	45,909.87
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	71,011.79	343,500.00
负债合计		78,068.02	537,584.28
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	7,732,102.45	59,683,695.38
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		7,732,102.45	59,683,695.38
负债和所有者权益总计		7,810,170.47	60,221,279.66

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 7,732,102.45 份，其中 A 级基金份额 2,615,132.19 份，其中 B 级基金份额 5,116,970.26 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体：海富通现金管理货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		432,927.83	5,227,808.03
1.利息收入		432,927.83	5,227,190.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	63,761.76	340,689.76
债券利息收入		-	133,745.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		369,166.07	4,752,754.91
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-	617.67

其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	617.67
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）	6.4.7.13	-	-
减：二、费用		108,696.91	961,580.38
1. 管理人报酬		38,864.35	567,252.92
2. 托管费		12,399.56	171,894.84
3. 销售服务费		11,316.21	31,825.13
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.15	46,116.79	190,607.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		324,230.92	4,266,227.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		324,230.92	4,266,227.65

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通现金管理货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	59,683,695.38	-	59,683,695.38
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	324,230.92	324,230.92
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)	-51,951,592.93	-	-51,951,592.93
其中：1.基金申购款	47,918,327.24	-	47,918,327.24
2.基金赎回款	-99,869,920.17	-	-99,869,920.17
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)	-	-324,230.92	-324,230.92
五、期末所有者权益 (基金净值)	7,732,102.45	-	7,732,102.45
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	55,406,999.67	-	55,406,999.67
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	4,266,227.65	4,266,227.65
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)	1,021,169,360.61	-	1,021,169,360.61
其中：1.基金申购款	3,614,611,432.25	-	3,614,611,432.25
2.基金赎回款	-2,593,442,071.64	-	-2,593,442,071.64
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)	-	-4,266,227.65	-4,266,227.65
五、期末所有者权益	1,076,576,360.28	-	1,076,576,360.28

(基金净值)			
--------	--	--	--

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：

基金管理人负责人：刘颂，主管会计工作负责人：陶网雄，会计机构负责人：胡正万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通现金管理货币市场基金(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【2012】1540 号《关于同意海富通现金管理货币市场基金设立的批复》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《海富通现金管理货币市场基金合同》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 1,100,933,370.39 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司予以验证。经向中国证监会备案，《海富通现金管理货币市场基金合同》于 2013 年 3 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,101,186,692.48 份基金份额，其中认购资金利息折合 253,322.09 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《海富通现金管理货币市场基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金；通知存款；短期融资券；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单；期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券、中期票据；期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其它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七天通知存款利率（税后）。

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 2015 年 8 月 27 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》、《海富通现金管理货币市场基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年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

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致，本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告不一致。

6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和

私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.2 差错更正的说明

本基金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[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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	38,864.35	567,252.92
其中：支付销售机构的客户维护费	7,057.91	14,721.31

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	12,399.56	171,894.84

注：支付基金托管人中国工商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。

6.4.8.2.3 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- 2015年1月1日至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	海富通现金管理货币 A	海富通现金管理货币 B	合计
中国工商银行	5,233.58	-	5,233.58
海通证券	519.32	-	519.32
海富通	1,039.85	838.87	1,878.72
合计	6,792.75	838.87	7,631.62
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通现金管理货币A	海富通现金管理货币B	合计
中国工商银行	9,306.05	-	9,306.05
海通证券	44.67	-	44.67
海富通	360.67	16,308.01	16,668.68
合计	9,711.39	16,308.01	26,019.40

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告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。

6.4.8.4.2 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

海富通现金管理货币 A

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。

海富通现金管理货币 B

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。

6.4.8.5 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	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014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
中国工商银行-活期存款	1,439,067.77	14,551.91	15,813,512.60	107,689.64
中国工商银行-定期存款	-	-	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 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通过关联方购买其承销的证券。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	6,200,000.00	79.38
	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	1,608,067.77	20.59
4	其他各项资产	2,102.70	0.03
5	合计	7,810,170.47	100.00

7.2 债券回购融资情况

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	3
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	15
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本报告期本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 75 天。本基金合同约定：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 75 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	100.99	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	-	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	100.99	0.00

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0000%
报告期内偏离度的最低值	0.0000%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0000%

注：以上数据按交易日统计。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

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	675.89
3	应收利息	1,426.81
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,102.70

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
海富通现金管理货币 A	650	4,023.28	-	-	2,615,132.19	100.00%
海富通现金管理货币 B	1	5,116,970.26	5,116,970.26	100.00%	-	-
合计	651	11,877.27	5,116,970.26	66.18%	2,615,132.19	33.82%

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	海富通现金管理货币 A	20.05	0.0008%
	海富通现金管理货币 B	-	-
	合计	20.05	0.0003%

8.3 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	海富通现金管理货币 A	0~10
	海富通现金管理货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通现金管理货币 A	0
	海富通现金管理货币 B	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通现金管理货币 A	海富通现金管理货币 B
基金合同生效日 (2013 年 3 月 13 日) 基金份额总额	231,393,723.48	869,792,969.00
本报告期期初基金份额总额	9,683,695.38	50,000,000.00
本报告期基金总申购份额	16,261,723.60	31,656,603.64
减：本报告期基金总赎回份额	23,330,286.79	76,539,633.38
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	2,615,132.19	5,116,970.26
--------------	--------------	--------------

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，本基金已于 2015 年 6 月 25 日至 2015 年 7 月 20 日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议通过了《关于终止海富通现金管理货币市场基金基金合同有关事项的议案》，并于 2015 年 7 月 23 日进入财产清算期。

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

2015 年 1 月 17 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司股东会审议通过，聘请俞涛先生担任本公司职工监事，高勇前先生不再担任本公司职工监事。

2015 年 2 月 14 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三十六次临时会议审议通过，同意田仁灿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。

2015 年 4 月 8 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司 2015 年第四次临时股东大会审议通过，同意田仁灿先生辞去本公司董事职务，由简伟信（Vincent Camerlynck）先生继任本公司董事。

2015 年 5 月 4 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三十六次临时会议审议通过，并向中国证券监督管理委员会报告，经中国证券监督管理委员会证监许可【2015】753 号文核准批复。公司聘请刘颂先生任总经理，同时公司董事长张文伟先生不再代行总经理职务。

2015 年 7 月 14 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四十二次临时会议审议通过，聘任奚万荣先生担任公司督察长，原公司督察长章明女士转任公司副总经理。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 报告期内改聘会计师事务所情况

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等情况

海富通基金管理有限公司（以下简称“公司”）于 2015 年 2 月 10 日收到上海证监局《关于对海富通基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，责令公司进行为期 6 个月的整改，上海证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此公司高度重视，对公司内部控制和风险管理工作进行了全面梳理，彻底排查业务中存在的风险隐患，针对性的制定、实施整改措施，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力。目前，公司已经完成相关整改工作并通过了监管部门的检查验收。除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
中金公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元没有发生变更。

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议核准。

<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议核准。

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
中金公司	-	-	487,500,000.00	100.00%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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%。

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 32 只公募基金。截至 2015 年 6 月 30 日,海富通管理的公募基金资产规模超过 451 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 2015 年 6 月 30 日，海富通为 80 多家企业超过 391 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 2015 年 6 月 30 日，海富通旗下专户理财管理资产规模超过 124 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。

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 2015 年 6 月 30 日，投资咨询及海外业务规模超过 144 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。

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
二〇一五年八月二十八日