

海富通货币市场证券投资基金
2018 年半年度报告摘要
2018 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：二〇一八年八月二十四日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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 2018 年 1 月 1 日起至 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	15,455,577,231.08 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	353,342,099.77 份	15,102,235,131.31 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	姓名	奚万荣	王永民

负责人	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

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（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）	
	海富通货币 A	海富通货币 B
本期已实现收益	7,644,803.54	404,848,456.34
本期利润	7,644,803.54	404,848,456.34
本期净值收益率	1.9635%	2.0849%
3.1.2 期末 数据和指标	报告期末(2018 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	353,342,099.77	15,102,235,131.31
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
过去一个月	0.3063%	0.0005%	0.1224%	0.0000%	0.1839%	0.0005%
过去三个月	0.9385%	0.0006%	0.3719%	0.0000%	0.5666%	0.0006%
过去六个月	1.9635%	0.0008%	0.7410%	0.0000%	1.2225%	0.0008%
过去一年	3.9290%	0.0009%	1.5000%	0.0000%	2.4290%	0.0009%
过去三年	9.9707%	0.0022%	4.6926%	0.0003%	5.2781%	0.0019%
自基金合同 生效起至今	53.9656%	0.0064%	38.6817%	0.0020%	15.2839%	0.0044%

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
过去一个月	0.3260%	0.0005%	0.1224%	0.0000%	0.2036%	0.0005%
过去三个月	0.9987%	0.0006%	0.3719%	0.0000%	0.6268%	0.0006%
过去六个月	2.0849%	0.0008%	0.7410%	0.0000%	1.3439%	0.0008%
过去一年	4.1788%	0.0009%	1.5000%	0.0000%	2.6788%	0.0009%
过去三年	10.7646%	0.0022%	4.6926%	0.0003%	6.0720%	0.0019%
自基金合同 生效起至今	52.9200%	0.0064%	34.8450%	0.0021%	18.0750%	0.0043%

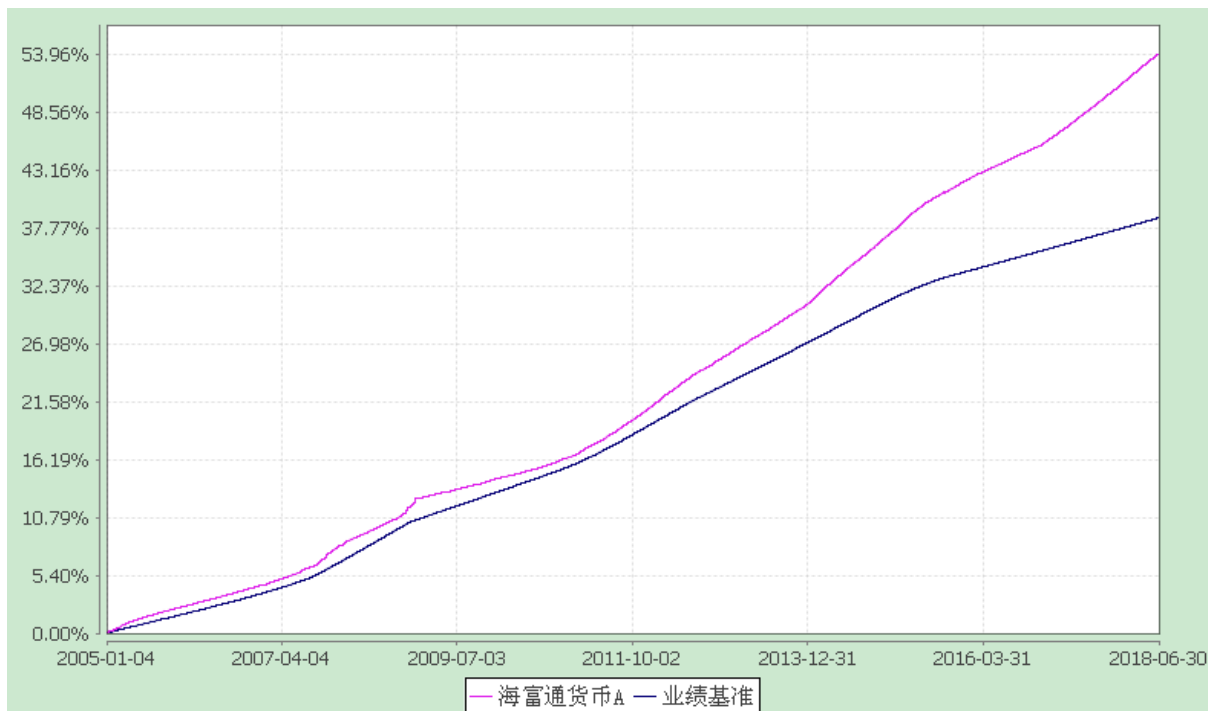
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

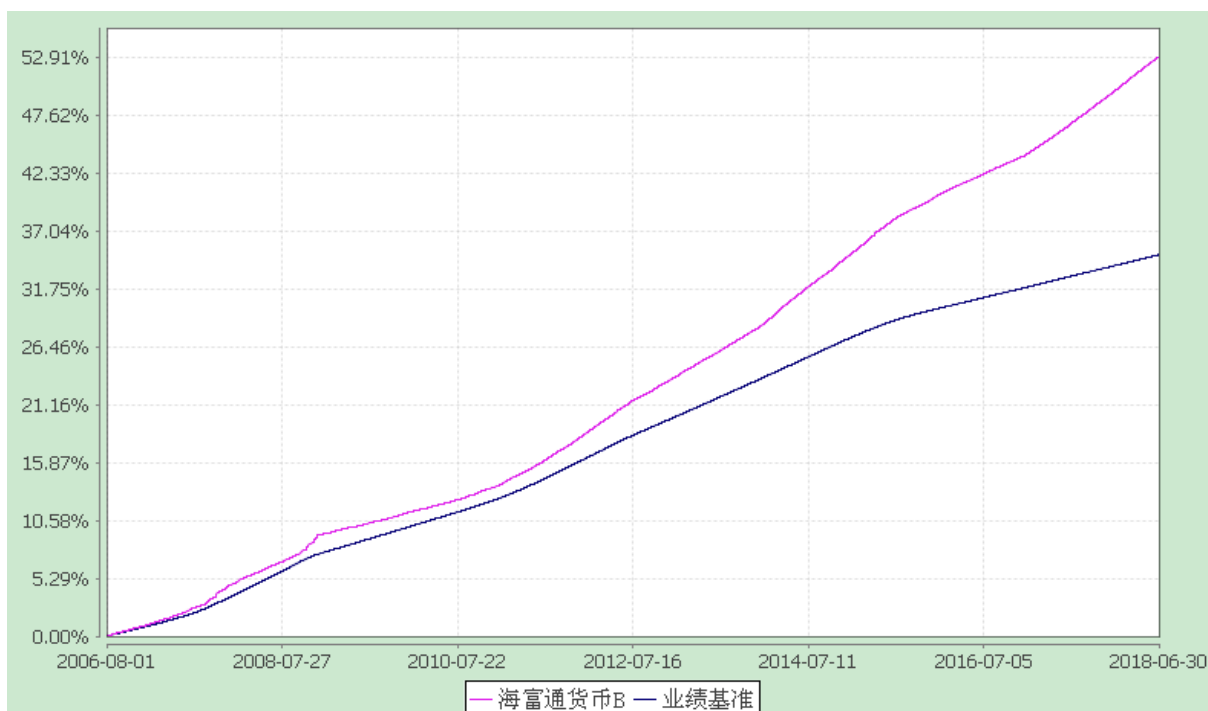
1. 海富通货币 A

(2005 年 1 月 4 日至 2018 年 6 月 30 日)



2. 海富通货币 B

(2006 年 8 月 1 日至 2018 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“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 54 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、海富通安颐收益混合型证券投资基金（原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、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通富睿混合型证券投资基金、海富通欣悦灵活配置混合型证券投资基金、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、海富通瑞福一年定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子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；海富通瑞丰一年定开债券基金经理；海富通美元债（QDII）基金经理；海富通上证周期产业	2013-08-29	-	9 年	博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投资副总监。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 月起兼任海富通上证可质押城投债 ETF 基金经理。2015 年 12 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 9 月兼任海富通稳进增利债券（LOF）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 月起兼任海富通瑞丰一年定开债券基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 11 月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016 年 11 月起兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2017 年 1 月起兼任海富通上证周期产业债 ETF 基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 6 月

	<p>债 ETF 基金 经理； 海富通 瑞利债 券基金 经理； 海富通 瑞合纯 债基金 经理； 海富通 富睿混 合基金 经理； 海富通 欣悦混 合基金 经理； 海富通 瑞福一 年定开 债券基 金经理； 海富通 瑞祥一 年定开 债券基 金经理； 海富通 恒丰定 开债券 基金经 理。固 定收益 投资副 总监。</p>				<p>兼任海富通富源债券基金 经理。2017 年 3 月起兼任 海富通瑞合纯债基金经理。 2017 年 5 月起兼任海富通 富睿混合基金经理。 2017 年 7 月起兼任海富通 欣悦混合、海富通瑞福一 年定开债券、海富通瑞祥 一年定开债券基金经理。 2018 年 4 月起兼任海富通 恒丰定开债券基金经理。</p>
谈云飞	<p>本基金的基金 经理； 海富通 季季增 利理财 债券基 金经理；</p>	2016-02-26	-	13 年	<p>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。</p>

	海富通新内需混合基金经理；海富通稳健添利债券基金经理；海富通安颐收益混合基金经理；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；海富通强化回报混合基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通季季通利理财债券基金经理。				2014 年 7 月至 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 月至 2017 年 6 月兼任海富通纯债债券、海富通双福债券（原海富通双福分级债券）、海富通双利债券基金经理。2016 年 4 月起兼任海富通安颐收益混合（原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。2017 年 3 月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 7 月起兼任海富通季季通利理财债券基金经理。
何谦	本基金的基金经理；海富通纯债债券基金	2016-05-06	-	7 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

	经理； 海富通 双福债 券基金 经理； 海富通 集利债 券基金 经理； 海富通 添益货 币基金 经理。			货币基金经理助理。 2016 年 5 月至 2017 年 10 月兼任海富通双利债券 基金经理。2016 年 5 月起 任海富通纯债债券、海富 通双福债券（原海富通双 福分级债券）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。2017 年 8 月起兼 任海富通添益货币基金经 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、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、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、投资部门、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，保证本报告期内公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

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

上半年的债券市场呈现利率牛市、信用分化的特征。从宏观层面看，上半年政策仍延续“去杠杆”的思路，经济总体保持韧性但边际趋弱，通胀表现温和。具体来看，上半年工业生产相对旺盛，制造业投资尤其是中上游行业在盈利驱动下有所回暖，而基建投资受非标和融资渠道收紧的影响逐月下滑；房地产投资虽在前期土地购置费的支撑下保持高增速，但在政策和资金压力下动能也在转弱。融资方面，资管新规后表外融资渠道的收缩并未伴随着表内信贷增速的明显上行，社融增速出现下滑，“紧信用”对实体的压力正在逐步显现。此外，上半年中美贸易摩擦不断，外围环境的变化也对经济产生一定的不确定性。在这种宏观背景下，上半年央行货币政策态度产生了边际变化，为对冲金融收紧和经济下行的风险，央行实行稳健偏松的货币政策，并多次定向降准，缓解银行负债端压力和支持小微企业融资。上半年债券市场的资金面整体保持平稳，而无风险利率呈现震荡下行的态势，半年的时间 10 年期国债收益率下行 41BP，10 年期国开债收益率下行 57BP，利率债呈现“小牛市”。而信用债却出现分化，上半年民营企业债券违约事件频发，城投非标逾期等负面消息不断，市场一直笼罩在违约阴影下，风险偏好急剧下降，信用利差也随之大幅走扩，3 年期 AA 级企业债信用利差抬升 23BP。4 月中旬央行宣布年内第二次定向降准的消息，市场情绪随之高涨，10 年期国债收益率快速下行至 3.5%，但随后出现回调；5 月中旬至 6 月，随着中美贸易摩擦不断反复，5 月经济数据又出现超预期的下滑，央行宽货币的意图进一步明确，不仅未跟随美联储加息，随之又宣布第三次定向降准以支持银行“债转股”项目和解决小微企业融资问题。央行货币政策边际放松的趋势在二季度进一步明确，季末 3 个月存款收益率快速下行至 17 年以来的低点。整个上半年，3 个月 SHIBOR 下行 76bp，1 年期国开债收益率下行 100bp，270 天 AAA 短融收益率下行 87bp。但信用利差走扩，270 天 AA 短融收益率仅下行 52BP。

本基金在上半年维持了偏中性的资产配置，顺应货币政策边际放松的趋势，在二季度适度拉长了组合久期，并稳妥地应对了季末的流动性要求。

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 1.9635%，同期业绩比较基准收益率为 0.7410%；海富通货币 B 类基金净值收益率为 2.0849%，同期业绩比较基准收益率为 0.7410%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从基本面看，下半年经济存在一些回落压力。土地购置费支撑房地产投资的效应大概率在下半年逐步消退，在房地产企业融资渠道受限、棚户区改造规模增速放缓的背景下，下半年房地产投资或有所转弱。下半年财政支出和地方债发行或加速，基建投资增速或保持相对平稳甚至小幅反弹。而在中美贸易摩擦、欧美经济走势分化等背

景下，外需存在一定的变数。通胀方面，下半年通胀中枢或较 2017 年温和抬升，市场对通胀的预期已明显弱化，关注原油价格和中美贸易摩擦等不确定因素的影响。政策方面，紧信用环境下实体经济融资难度和成本提高，为对冲经济的下滑，下半年货币政策或延续稳健偏松和灵活操作，定向降准仍有空间，但在美联储加息和人民币汇率可能承压的背景下，货币政策或面临一定制约。上半年受资本充足率、信贷额度和行业等方面的限制，表外融资渠道转表内的过程并不顺畅，下半年信贷政策存在结构性放松的可能。尽管央行货币政策边际放松使货币市场较为宽松，但市场风险偏好下降并未得到修复，资金在货币市场堆积将会继续，我们认为三季度短端收益率仍有进一步下行的机会和空间，可以择机进行配置。信用方面，低资质企业非标转标和直接融资预计仍然比较困难，叠加下半年信用债到期和回售压力较大，信用负面事件对市场的冲击或仍未结束，信用策略总体仍以防守为主，但亦要观察可能出现的政策托底带来的机会。

下半年，本基金在资产端管理中将继续把流动性和安全性放在重要位置，资产配置跟流动性的周期波动相匹配，严格遵守货币基金相关法规，严格控制信用风险；顺应央行货币政策调整节奏，适度提升组合剩余期限。负债端方面，本基金将积极进行负债端管理，稳定负债端，并根据负债端的需求进行资产配置安排。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。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，估值工作小组对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

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 7,644,803.54 元，货币 B 级 404,848,456.34 元。

二、已实施的利润分配：货币 A 级已分配 7,220,353.71 元，货币 B 级已分配 387,563,253.61 元。

三、应分配但尚未实施的利润：已分配但未支付的 17,709,652.56 元。应于收益支付日 2018 年 7 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:2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	9,879,873,286.07	9,742,211,390.95

结算备付金		322,727.27	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,725,270,957.73	5,571,748,526.43
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,725,270,957.73	5,571,748,526.43
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	1,419,336,867.01	5,524,034,486.04
应收证券清算款		36,851.51	220,549,986.94
应收利息	6.4.7.5	159,185,108.51	98,456,801.48
应收股利		-	-
应收申购款		12,549,143.23	4,900.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		16,196,574,941.33	21,157,006,091.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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		714,999,042.50	82,169,838.91
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		342,184.51	348,540.83
应付管理人报酬		5,479,893.25	5,032,506.61
应付托管费		1,660,573.73	1,525,002.01
应付销售服务费		236,945.09	248,644.33
应付交易费用	6.4.7.7	188,479.10	203,647.39
应交税费		40,067.63	-
应付利息		120,556.14	27,135.63
应付利润		17,709,652.56	25,294,878.47
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.8	220,315.74	449,000.06
负债合计		740,997,710.25	115,299,194.24
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	15,455,577,231.08	21,041,706,897.60
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		15,455,577,231.08	21,041,706,897.60
负债和所有者权益总计		16,196,574,941.33	21,157,006,091.84

注：1、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 15,455,577,231.08 份，其中 A 级基金份额 353,342,099.77 份，其中 B 级基金份额 15,102,235,131.31 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：海富通货币市场证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		461,345,311.70	309,060,962.68
1.利息收入		460,040,897.57	309,657,730.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	262,795,529.33	207,524,477.63
债券利息收入		116,972,375.86	63,880,161.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		80,272,992.38	38,253,091.11
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,257,614.13	-596,767.37
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	1,257,614.13	-596,767.37
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
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）	6.4.7.14	46,800.00	-
减：二、费用		48,852,051.82	38,855,472.55
1. 管理人报酬		32,912,609.01	23,051,140.21
2. 托管费		9,973,517.90	6,985,194.01
3. 销售服务费		1,464,452.03	1,287,393.04
4. 交易费用	6.4.7.15	-	-
5. 利息支出		4,165,701.43	7,260,296.17
其中：卖出回购金融资产支出		4,165,701.43	7,260,296.17
6.税金及附加		23,334.18	-
7. 其他费用	6.4.7.16	312,437.27	271,449.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		412,493,259.88	270,205,490.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		412,493,259.88	270,205,490.13

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	21,041,706,897.60	-	21,041,706,897.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	412,493,259.88	412,493,259.88

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）	-5,586,129,666.52	-	-5,586,129,666.52
其中：1.基金申购款	45,417,759,127.31	-	45,417,759,127.31
2.基金赎回款	-51,003,888,793.83	-	-51,003,888,793.83
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）	-	-412,493,259.88	-412,493,259.88
五、期末所有者权益（基金净值）	15,455,577,231.08	-	15,455,577,231.08
项目	上年度可比期间		
	2017年1月1日至2017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）	14,448,437,249.88	-	14,448,437,249.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	270,205,490.13	270,205,490.13
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）	1,186,921,427.89	-	1,186,921,427.89
其中：1.基金申购款	46,853,328,169.94	-	46,853,328,169.94
2.基金赎回款	-45,666,406,742.05	-	-45,666,406,742.05
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）	-	-270,205,490.13	-270,205,490.13
五、期末所有者权益（基金净值）	15,635,358,677.77	-	15,635,358,677.77

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：任志强，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 2018 年 8 月 24 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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。

6.4.5 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。

6.4.6 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》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税

人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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

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 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	2,710,000,000.00	100.00%	343,200,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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	29,810.00	100.00%	6,743.00	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	3,775.20	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。

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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	32,912,609.01	23,051,140.21
其中：支付销售机构的客户维护费	338,303.37	457,501.23

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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,973,517.90	6,985,194.01

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。

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- 2018年1月1日至2018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	69,963.59	3,125.86	73,089.45
海通证券	4,498.22	23,330.82	27,829.04
海富通	47,322.57	921,067.40	968,389.97
合计	121,784.38	947,524.08	1,069,308.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	109,752.74	1,849.48	111,602.22
海通证券	5,590.49	462.01	6,052.50
海富通	34,187.76	638,594.53	672,782.29
合计	149,530.99	640,906.02	790,437.01

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

单位：人民币元

本期 2018年1月1日至2018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	100,788,540.22	102,506,453.69	-	-	8,682,955,000.00	1,109,124.14
上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	-	300,018,883.35	-	-	-	-

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。

海富通货币 B

份额单位：份

关联方名称	海富通货币B本期末 2018年6月30日		海富通货币B上年度末 2017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

海通证券股份有限公司	200,000,000.00	1.32%	1,100,000,000.00	5.23%
------------	----------------	-------	------------------	-------

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	873,286.07	126,456.39	3,238,982.08	168,664.95
中国银行-定期存款	-	-	300,000,000.00	483,320.00

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。

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在承销期内参与关联方承销证券。

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（2018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。

6.4.9.2 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等流通受限股票。

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

截至本报告期末 2018 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 714,999,042.50 元，是以如下债券作为抵押：

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
180301	18 进出 01	2018-07-02	100.29	89,000	8,925,810.00
189916	18 贴现国债	2018-07-02	99.88	500,000	49,940,000.00

	16				
187702	18 贴现国开 02	2018-07-02	99.69	600,000	59,814,000.00
170207	17 国开 07	2018-07-02	100.00	2,900,000	290,000,000.00
150214	15 国开 14	2018-07-02	100.05	357,000	35,717,850.00
170410	17 农发 10	2018-07-02	100.03	2,800,000	280,084,000.00
合计				7,246,000	724,481,660.00

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	4,725,270,957.73	29.17
	其中：债券	4,725,270,957.73	29.17
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,419,336,867.01	8.76
	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	9,880,196,013.34	61.00
4	其他各项资产	171,771,103.25	1.06
5	合计	16,196,574,941.33	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	1.54
	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	714,999,042.50	4.63
	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基金资产净值的 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	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	83
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。

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	24.72	4.63
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	28.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	19.95	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	7.59	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

5	120 天(含)—397 天(含)	22.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	103.68	4.63

7.4 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。

7.5 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	69,881,439.94	0.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,195,429,256.49	7.73
	其中：政策性金融债	1,195,429,256.49	7.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	660,670,259.05	4.27
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,799,290,002.25	18.11
8	其他	-	-
9	合计	4,725,270,957.73	30.57

7.6 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

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	170207	17 国开 07	2,900,000	289,984,645.36	1.88
2	170410	17 农发 10	2,800,000	279,930,145.13	1.81
3	111808148	18 中信银行 CD148	2,000,000	198,780,883.47	1.29
4	111894147	18 成都银行 CD081	2,000,000	197,854,553.19	1.28
5	180201	18 国开 01	1,500,000	150,241,761.52	0.97
6	111891119	18 苏州银行 CD013	1,500,000	149,400,939.62	0.97
7	111894365	18 桂林银行 CD047	1,500,000	144,651,623.86	0.94

8	130238	13 国开 38	1,300,000	130,263,726.45	0.84
9	170211	17 国开 11	1,000,000	100,061,673.34	0.65
10	011800616	18 首钢 SCP003	1,000,000	100,009,545.47	0.65

7.7“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	0.0577%
报告期内偏离度的最低值	0.0040%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0203%

注：以上数据按银行间交易日统计。

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%。

7.8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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	36,851.51
3	应收利息	159,185,108.51
4	应收申购款	12,549,143.23
5	其他应收款	-

6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	171,771,103.25

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	95,488	3,700.38	36,005,240.90	10.19%	317,336,858.87	89.81%
海富通货币 B	108	139,835.510.48	14,086,781.241.39	93.28%	1,015,453,889.92	6.72%
合计	95,596	161,675.98	14,122,786.482.29	91.38%	1,332,790,748.79	8.62%

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	海富通货币 A	1,424,890.11	0.4033%
	海富通货币 B	-	-
	合计	1,424,890.11	0.0092%

8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
----	-------	---------	--------

1	银行类机构	1,510,708,521.11	9.77%
2	保险类机构	867,110,399.09	5.61%
3	基金类机构	841,547,278.82	5.44%
4	基金类机构	812,186,984.31	5.25%
5	券商类机构	712,696,219.23	4.61%
6	银行类机构	531,799,550.59	3.44%
7	银行类机构	504,578,936.43	3.26%
8	保险类机构	501,452,649.32	3.24%
9	券商类机构	500,140,572.97	3.24%
10	基金类机构	500,000,000.00	3.24%

8.4 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

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	642,280,282.60	20,399,426,615.00
本报告期基金总申购份额	627,506,751.18	44,790,252,376.13
减：本报告期基金总赎回份额	916,444,934.01	50,087,443,859.82
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	353,342,099.77	15,102,235,131.31

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

- 1、本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、本报告期内，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

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	-	-	29,810.00	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,并报公司总经理办公会核准。

<3>核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后,由基金管理人的总经理办公会核准。

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	-	-	2,710,000,000.00	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%。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 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 61 只公募基金。截至 2018 年 6 月 30 日,海富通管理的公募基金资产规模超过 574.03 亿元人民币。

2004 年末开始，海富通及子公司为 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 2018 年 6 月 30 日，投资咨询及海外业务规模超过 32 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 2018 年 6 月 30 日，海富通为近 80 家企业超过 401 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 2018 年 6 月 30 日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模超过 443 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。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。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。

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“固定收益投资金牛基金公司”。2018 年 3 月，国内权威财经媒体《证券时报》授予海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金为第十三届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金。

海富通基金管理有限公司
二〇一八年八月二十四日