

海富通货市市场证券投资基金更新招募说明书摘要

(2011年第2号)

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

重要提示

海富通货市市场证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2004年11月19日出具的《关于同意海富通货市市场证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2004]194号)文批准募集。本基金的基金合同于2005年1月4日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况 名称:海富通基金管理有限公司 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

(二)基金托管人概况 名称:中国银行股份有限公司 注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号

(三)基金销售机构 1. 直销机构 名称:海富通基金管理有限公司 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

(四)基金募集 基金名称:海富通货市市场证券投资基金 基金代码:519001 基金简称:海富通货币

(五)基金投资策略 本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括:一年以内(含)一年期银行定期存款、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。

(六)基金业绩 截至2011年6月30日,本基金资产净值为1,716,807,316.75元,基金份额净值为1.0622元。自基金合同生效以来,本基金累计净值增长率为15.9576%,同期业绩比较基准收益率为14.4343%。

(七)基金费用 基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

(八)基金风险 本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括:一年以内(含)一年期银行定期存款、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。

(九)基金管理人承诺 基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

(十)基金托管人承诺 基金托管人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

(十一)基金销售机构 1. 直销机构 名称:海富通基金管理有限公司 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

(十二)基金募集 基金名称:海富通货市市场证券投资基金 基金代码:519001 基金简称:海富通货币

(十三)基金投资策略 本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括:一年以内(含)一年期银行定期存款、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。

(十四)基金业绩 截至2011年6月30日,本基金资产净值为1,716,807,316.75元,基金份额净值为1.0622元。自基金合同生效以来,本基金累计净值增长率为15.9576%,同期业绩比较基准收益率为14.4343%。

(十五)基金费用 基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

(十六)基金风险 本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括:一年以内(含)一年期银行定期存款、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。

(十七)基金管理人承诺 基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

(十八)基金托管人承诺 基金托管人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

(十九)基金销售机构 1. 直销机构 名称:海富通基金管理有限公司 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

(二十)基金募集 基金名称:海富通货市市场证券投资基金 基金代码:519001 基金简称:海富通货币

(二十一)基金投资策略 本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括:一年以内(含)一年期银行定期存款、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。

(二十二)基金业绩 截至2011年6月30日,本基金资产净值为1,716,807,316.75元,基金份额净值为1.0622元。自基金合同生效以来,本基金累计净值增长率为15.9576%,同期业绩比较基准收益率为14.4343%。

(二十三)基金费用 基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

6大通证券股份有限公司 地址:天津市滨海新区泰达大街129号 法定代表人:王凤武 客服电话:4008169169

61上海证券有限责任公司 地址:上海市虹口区四川北路1088号 法定代表人:龚兵 客服电话:40066-2288

62山西证券股份有限公司 地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼 法定代表人:侯巍 客服电话:400-666-1618

63招商证券股份有限公司 地址:北京市东城区东直门内大街2号 法定代表人:李勇 客服电话:400-818-8118

64东方证券股份有限公司 地址:上海市浦东新区世纪大道1588号 法定代表人:王益 客服电话:4008-888-993

65华泰证券股份有限公司 地址:南京市江东中路228号 法定代表人:吴万善 客服电话:95597

66民生证券股份有限公司 地址:北京市朝阳区朝阳门内大街2号民生金融中心A层 法定代表人:盛程 客服电话:4006198888

67华龙证券股份有限公司 地址:甘肃省兰州市静宁路308号 法定代表人:陈奇 客服电话:95353

68兴业证券股份有限公司 地址:福州市湖东路155号 法定代表人:兰荣 客服电话:95512

69安信证券股份有限公司 地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦34楼 法定代表人:牛冠霖 客服电话:95511

70信达证券股份有限公司 地址:深圳市福田区福中三路1006009号新世界中心29层 法定代表人:张志刚 客服电话:4001201111

71方正证券股份有限公司 地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 法定代表人:雷杰 客服电话:95524

72光大证券股份有限公司 地址:上海市静安区南京西路1666号 法定代表人:薛峰 客服电话:95528

73国信证券股份有限公司 地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号 法定代表人:何如 客服电话:95536

74广发证券股份有限公司 地址:广州市天河区珠江新城华夏路10号 法定代表人:孙树培 客服电话:95575

75国联证券股份有限公司 地址:无锡市太湖新城金融一街8号 法定代表人:姚文平 客服电话:95579

76申银万国证券股份有限公司 地址:上海市浦东新区世纪大道160号 法定代表人:储晓明 客服电话:95523

77中银国际证券股份有限公司 地址:上海市浦东新区银城中路200号 法定代表人:许国平 客服电话:4006208888

78中泰证券股份有限公司 地址:济南市经二路纬三路12号 法定代表人:李玮 客服电话:95538

79齐鲁证券有限公司 地址:济南市经二路纬三路12号 法定代表人:李玮 客服电话:95538

80华安证券股份有限公司 地址:合肥市政务区天鹅湖路198号 法定代表人:李玮 客服电话:95538

81华林证券股份有限公司 地址:深圳市福田区金田路2222号 法定代表人:王敬刚 客服电话:95538

82西南证券股份有限公司 地址:重庆市渝中区新华路10号 法定代表人:王健 客服电话:95538

83长江证券股份有限公司 地址:武汉市新华路100号 法定代表人:胡运春 客服电话:95538

84安信证券股份有限公司 地址:深圳市福田区金田路4018号 法定代表人:牛冠霖 客服电话:95511

85招商证券股份有限公司 地址:北京市东城区东直门内大街2号 法定代表人:李勇 客服电话:400-818-8118

86东方证券股份有限公司 地址:上海市浦东新区世纪大道1588号 法定代表人:王益 客服电话:4008-888-993

87华泰证券股份有限公司 地址:南京市江东中路228号 法定代表人:吴万善 客服电话:95597

88民生证券股份有限公司 地址:北京市朝阳区朝阳门内大街2号民生金融中心A层 法定代表人:盛程 客服电话:4006198888

89华龙证券股份有限公司 地址:甘肃省兰州市静宁路308号 法定代表人:陈奇 客服电话:95353

90兴业证券股份有限公司 地址:福州市湖东路155号 法定代表人:兰荣 客服电话:95512

91安信证券股份有限公司 地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦34楼 法定代表人:牛冠霖 客服电话:95511

92信达证券股份有限公司 地址:深圳市福田区福中三路1006009号新世界中心29层 法定代表人:张志刚 客服电话:4001201111

93方正证券股份有限公司 地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号 法定代表人:雷杰 客服电话:95524

94光大证券股份有限公司 地址:上海市静安区南京西路1666号 法定代表人:薛峰 客服电话:95528

95国信证券股份有限公司 地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号 法定代表人:何如 客服电话:95536

96广发证券股份有限公司 地址:广州市天河区珠江新城华夏路10号 法定代表人:孙树培 客服电话:95575

97国联证券股份有限公司 地址:无锡市太湖新城金融一街8号 法定代表人:姚文平 客服电话:95579

98申银万国证券股份有限公司 地址:上海市浦东新区世纪大道160号 法定代表人:储晓明 客服电话:95523

99中银国际证券股份有限公司 地址:上海市浦东新区银城中路200号 法定代表人:许国平 客服电话:4006208888

100华安证券股份有限公司 地址:合肥市政务区天鹅湖路198号 法定代表人:李玮 客服电话:95538

101华林证券股份有限公司 地址:深圳市福田区金田路2222号 法定代表人:王敬刚 客服电话:95538

102西南证券股份有限公司 地址:重庆市渝中区新华路10号 法定代表人:王健 客服电话:95538

103长江证券股份有限公司 地址:武汉市新华路100号 法定代表人:胡运春 客服电话:95538

104安信证券股份有限公司 地址:深圳市福田区金田路4018号 法定代表人:牛冠霖 客服电话:95511

105招商证券股份有限公司 地址:北京市东城区东直门内大街2号 法定代表人:李勇 客服电话:400-818-8118

106东方证券股份有限公司 地址:上海市浦东新区世纪大道1588号 法定代表人:王益 客服电话:4008-888-993

107华泰证券股份有限公司 地址:南京市江东中路228号 法定代表人:吴万善 客服电话:95597

108民生证券股份有限公司 地址:北京市朝阳区朝阳门内大街2号民生金融中心A层 法定代表人:盛程 客服电话:4006198888

109华龙证券股份有限公司 地址:甘肃省兰州市静宁路308号 法定代表人:陈奇 客服电话:95353

4. 报告期内按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%)

5. 报告期内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

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券数量(张), 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%)

6. 影子定价与摊余成本法计量的偏离度

报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数: 11次

报告期内偏离度的最高值: 0.3160%

报告期内偏离度的最低值: 0.0142%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值: 0.1831%

8. 投资组合报告附注

2007年7月1日基金实施新会计准则后,本基金持有的债券(包括国债)采用摊余成本法进行估值,即按摊余成本进行估值,公允价值变动不计入损益。

1. 历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较

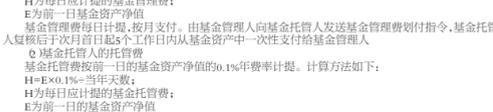
Table with columns: 阶段, 净值增长率(1), 净值增长率标准差(2), 业绩比较基准收益率(3), 业绩比较基准标准差(4), (1)-(3), (2)-(4)

Table with columns: 阶段, 净值增长率(1), 净值增长率标准差(2), 业绩比较基准收益率(3), 业绩比较基准标准差(4), (1)-(3), (2)-(4)

Table with columns: 阶段, 净值增长率(1), 净值增长率标准差(2), 业绩比较基准收益率(3), 业绩比较基准标准差(4), (1)-(3), (2)-(4)

Table with columns: 阶段, 净值增长率(1), 净值增长率标准差(2), 业绩比较基准收益率(3), 业绩比较基准标准差(4), (1)-(3), (2)-(4)

注:本基金收益分配按按月结转。 2. 自基金合同生效以来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



注:按照本基金合同约定,本基金自2005年7月4日(含)起至2005年4月4日(含)止为建仓期,建仓期间本基金的各项投资比例未达到本基金合同第十五条、第十六条规定的比例及建仓期。

一、基金费用的种类 1. 与基金运作有关的费用 1) 基金管理人的管理费

2) 基金托管人的托管费 3) 销售服务费 4) 基金份额持有人服务费

二、基金费用的计提和支付方式 1. 基金管理人的管理费

2. 基金托管人的托管费 3. 销售服务费 4. 基金份额持有人服务费

三、基金费用的调整 1. 基金管理人的管理费 2. 基金托管人的托管费

3. 销售服务费 4. 基金份额持有人服务费