

海富通现金管理货币市场基金

【2015】半年度报告摘要

“程度陡峭”，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限度增加流动性。目前基金资产风险较低，流动性状态也较为良好。

4.2.2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 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
目前各项经济数据呈现基本面向上企稳，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、降息都还有宽松的空间；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，加上地方债置换给不给、利率市场化的推进、股市分拆或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，从金融向实体经济传导不畅，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，但经历了多次降准降息后未来货币政策的重点可能在疏通传导，因此央行的操作会更为“平衡”，这种平衡包括短期和长期资金的价格、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 管理人对于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委员会制度。

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机构的建议，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，并经公司管理层和风险控制委员会批准后实施。

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 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
一、本基金报告期内应分配：货币A级95, 227.15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228, 686.63元。
三、应分配但尚未实施的利润：已分配但未支付的利润：285.95元。应于收益支付日2015年7月15日按1.00%的份额面值进行结转为基金份额。

4.8报告期内管理人对于本基金持有人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日于2015年7月20日通过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》、《货币市场基金托管暂行规定》、《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、每万份基金净值收益和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》、《货币市场基金托管暂行规定》、《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
本基金托管人依法对海富通现金管理货币市场基金管理人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

资产/负债和所有者权益	期末余额 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：		
货币存款	64.71	1,430,097.77
结算备付金	—	109,000.00
存出保证金	—	—
交易性金融资产	64.72	—
其中：股票投资	—	—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	64.73	—
买入返售金融资产	64.74	8,200,000.00
应收证券利息	—	679.68
应收股利	64.75	1,428.01
其他资产	—	26,389.28
资产总计	7,810,170.47	46,221,279.46
负债和所有者权益：		
负债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
应付短期融资券	64.73	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	—	197,894.87
应付管理人报酬	2,397.98	32,424.72
应付销售服务费	981.93	5,981.11
应付交易费用	64.77	1,950.00
应付利息	—	—
应付利润	3,285.86	46,800.87
递延所得税负债	—	—
其他负债	64.78	71,011.79
负债合计	76,080.02	627,584.28
所有者权益：		
实收基金	64.79	7,732,102.45
未分配利润	64.70	—
所有者权益合计	7,810,170.47	46,221,279.46

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116,970.6份。

2、本报告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

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			
1.利息收入		432,927.03	5,227,393.26
其中：存款利息收入	64.711	43,761.76	340,688.06
债券利息收入	—	—	135,746.89
资产支持证券利息收入	—	—	—
买入返售金融资产收入	—	389,166.67	4,762,764.81
其他利息收入	—	—	—
2.投资收益（损失以“-”号填列）			617.87
其中：股票投资收益	—	—	—
债券投资收益	—	—	617.87
资产支持证券投资损益	—	—	—
其他综合收益	—	—	—
公允价值变动损益	—	—	—
汇兑损益	—	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）			
4.其他收入（损失以“-”号填列）			
其中：手续费收入	—	—	—
其他收入	—	—	—
二、费用			
1.销售费用	11,316.21	131,826.11	—
2.管理费用	12,390.64	171,894.84	—
3.销售服务费	—	—	—
4.交易费用	64.714	—	—
五、利息支出	—	—	—
六、其他费用	64.715	—	—
七、其他综合收益	—	—	—
八、其他费用	64.715	—	—
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）			
减：所得税费用	—	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）			
五、每股收益（每股以“-”号填列）			
六、基本每股收益	—	—	—
七、稀释每股收益	—	—	—

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116,970.6份。

2、本报告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。

6.3 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

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、实收基金			
1.期初余额	—	432,927.03	5,227,393.26
2.本期增减变动金额	64.711	43,761.76	340,688.06
其中：本期发行	—	—	—
3.期末余额	—	476,688.79	5,568,081.32
二、未分配利润			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.714	—	—
其中：本期计提	—	—	—
3.期末余额	—	—	—
三、所有者权益合计			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.715	—	—
3.期末余额	—	—	—
四、所有者权益合计			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.715	—	—
3.期末余额	—	—	—

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116,970.6份。

2、本报告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。

6.4 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

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、实收基金			
1.期初余额	—	432,927.03	5,227,393.26
2.本期增减变动金额	64.711	43,761.76	340,688.06
其中：本期发行	—	—	—
3.期末余额	—	476,688.79	5,568,081.32
二、未分配利润			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.714	—	—
其中：本期计提	—	—	—
3.期末余额	—	—	—
三、所有者权益合计			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.715	—	—
3.期末余额	—	—	—
四、所有者权益合计			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.715	—	—
3.期末余额	—	—	—

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116,970.6份。

2、本报告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。

6.5 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

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、实收基金			
1.期初余额	—	432,927.03	5,227,393.26
2.本期增减变动金额	64.711	43,761.76	340,688.06
其中：本期发行	—	—	—
3.期末余额	—	476,688.79	5,568,081.32
二、未分配利润			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.714	—	—
其中：本期计提	—	—	—
3.期末余额	—	—	—
三、所有者权益合计			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.715	—	—
3.期末余额	—	—	—
四、所有者权益合计			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.715	—	—
3.期末余额	—	—	—

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116,970.6份。

2、本报告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。

6.6 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

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、实收基金			
1.期初余额	—	432,927.03	5,227,393.26
2.本期增减变动金额	64.711	43,761.76	340,688.06
其中：本期发行	—	—	—
3.期末余额	—	476,688.79	5,568,081.32
二、未分配利润			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.714	—	—
其中：本期计提	—	—	—
3.期末余额	—	—	—
三、所有者权益合计			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.715	—	—
3.期末余额	—	—	—
四、所有者权益合计			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.715	—	—
3.期末余额	—	—	—

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116,970.6份。

2、本报告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。

6.7 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

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、实收基金			
1.期初余额	—	432,927.03	5,227,393.26
2.本期增减变动金额	64.711	43,761.76	340,688.06
其中：本期发行	—	—	—
3.期末余额	—	476,688.79	5,568,081.32
二、未分配利润			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.714	—	—
其中：本期计提	—	—	—
3.期末余额	—	—	—
三、所有者权益合计			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.715	—	—
3.期末余额	—	—	—
四、所有者权益合计			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.715	—	—
3.期末余额	—	—	—

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116,970.6份。

2、本报告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。

6.8 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

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、实收基金			
1.期初余额	—	432,927.03	5,227,393.26
2.本期增减变动金额	64.711	43,761.76	340,688.06
其中：本期发行	—	—	—
3.期末余额	—	476,688.79	5,568,081.32
二、未分配利润			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.714	—	—
其中：本期计提	—	—	—
3.期末余额	—	—	—
三、所有者权益合计			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.715	—	—
3.期末余额	—	—	—
四、所有者权益合计			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.715	—	—
3.期末余额	—	—	—

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116,970.6份。

2、本报告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。

6.9 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

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、实收基金			
1.期初余额	—	432,927.03	5,227,393.26
2.本期增减变动金额	64.711	43,761.76	340,688.06
其中：本期发行	—	—	—
3.期末余额	—	476,688.79	5,568,081.32
二、未分配利润			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.714	—	—
其中：本期计提	—	—	—
3.期末余额	—	—	—
三、所有者权益合计			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.715	—	—
3.期末余额	—	—	—
四、所有者权益合计			
1.期初余额	—	—	—
2.本期增减变动金额	64.715	—	—
3.期末余额	—	—	—

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116,970.6份。

2、本报告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。

6.10 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