海富通现金管理货币市场基金

【2014】半年度报告摘要

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:二〇一四年八月二十九日

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2014年8月28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2014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	1,076,576,360.28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	102,488,650.64份	974,087,709.64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	葛方荣	赵会军
	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.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(2014年1月1日至2014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	138,385.30	4,127,842.35
本期利润	138,385.30	4,127,842.35
本期净值收益率	1.0840%	1.2038%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014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	102,488,650.64	974,087,709.64
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	份额净值增长率标准差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	0.2222%	0.0029%	0.1103%	0.0000%	0.1119%	0.0029%
过去三个月	0.5769%	0.0028%	0.3349%	0.0000%	0.2420%	0.0028%
过去六个月	1.0840%	0.0030%	0.6672%	0.0000%	0.4168%	0.0030%
过去一年	2.6997%	0.0032%	1.3500%	0.0000%	1.3497%	0.0032%
自基金合同生效起至今	3.5137%	0.0036%	1.7604%	0.0000%	1.7533%	0.0036%

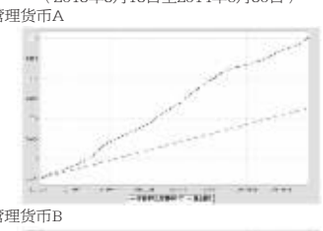
2. 海富通现金管理货币B:

阶段	份额净值收益率①	份额净值增长率标准差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	0.2415%	0.0029%	0.1103%	0.0000%	0.1312%	0.0029%
过去三个月	0.6366%	0.0028%	0.3349%	0.0000%	0.3017%	0.0028%
过去六个月	1.2038%	0.0030%	0.6672%	0.0000%	0.5366%	0.0030%
过去一年	2.9458%	0.0032%	1.3500%	0.0000%	1.5958%	0.0032%
自基金合同生效起至今	3.8373%	0.0036%	1.7604%	0.0000%	2.0769%	0.0036%

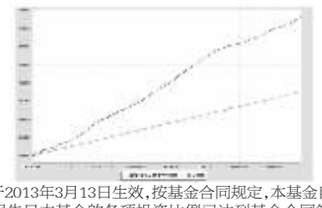
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
(2013年3月13日至2014年6月30日)

1、海富通现金管理货币A



2、海富通现金管理货币B



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。本海富通现金管理货币市场基金是基金管理人管理的第二十二只公募基金;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、海富通货币市场证券投资基金、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、海富通精选武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、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、海富通稳进增利分级债券型证券投资基金、海富通国策导向股票型证券投资基金、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、海富通内需热点股票型证券投资基金、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二十七只公募基金。

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		
凌超	本基金的基金经理,海富通一年定开债券基金经理;海富通纯债债券基金经理	2013-03-13	-	7年	中国国籍,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。

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。

3、本公司于2014年7月31日发布公告,自2014年7月30日起,聘任谈云飞女士担任本基金基金经理,与凌超先生共同管理本基金。

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

2014年初以来,尤其是二月至五月,债券市场从弱势转变为强势特征,走出了一番波澜壮阔的行情,一季度在资金宽松的情况下,利率债市场表现出短端下行显著,收益率曲线陡峭化;进入二季度,定向降准引发货币政策松动预期,市场做多情绪升温,交易盘、配置盘交投踊跃;进入六月份,十年期国债从4.77%走低至4.01%;十年国开从5.92%下行至4.87%;信用债收益也有大幅下行,1年期AAA短融从6.30%下降致4.70%;债市走牛主要受益于流动性宽松、银行配置盘年初配置需求强烈以及各类型理财产品规模的持续增长,加之供给相对较低;一季度信用债收益率曲线进一步陡峭化下行,信用利差继续收缩;二季度后,经济数据疲弱,央行多次采取定向宽松政策,延续了年初以来的单边牛市;在配置需求的支撑下,5月信用债收益率的下行继续延续;进入六月,各机构均准备了大量资金到期应对去年的"钱荒"可能造成的赎回,"钱荒"在钱荒的预期中消失,市场相对平稳。

本基金组合主要以流动性管理为主要侧重点,利率债券配置比例相对较低,主要以存款、逆回购资产为主。目前基金资产风险较低、流动性状态也较为良好,收益率也处于一个相对稳定的区间。

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1.0840%,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1.2038%,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

全球流动性宽松局面形成,但新兴市场不确定性加大。再加上人民币汇率双向波动预期的形成,外汇占款维持在千亿元左右甚至以下的低位可能成为常态,中国央行对流动性掌控力提升。随着定向降准、PSL等工具的持续运用,国内流动性稳健的基调不变。我们预计三季度的R007中枢位于3.5%附近,某些紧张时点可能出现短暂上冲,但是不会改变市场对于流动性适中预期。对于三季度而言,我们持谨慎乐观,目前收益率曲线平坦,年内市场行情不确定性大,投资者的偏好首选短期资产;短融收益率有可能进一步下行,但下行空间小于上半年,三季度为震荡市的概率比较大;首先基于经济基本面疲弱,反弹力度在刺激政策下不确定,其次、通胀低位运行,近期无忧,但三、四季度是通胀上行的传统时段;第三是央行定向宽松的持续依靠于经济复苏是否达标;有鉴于此,本基金将努力维持结构的稳定性,保持好组合流动性和收益性之间的平衡,在保证安全性的前提下,力争为持有人创造更好的投资收益。

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138,385.30元,货币B级4,127,842.35元。

二、已实施的利润分配:货币A级已分配123,123.83元,货币B级已分配3,234,693.72元。

三、应分配但尚未实施的利润:已分配但未支付的利润908,410.10元。应于收益支付日2014年7月15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,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2014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:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	65,813,512.60	8,026,992.24
结算备付金	4,294,500.00	4,823,809.52
存出保证金	-	-
交易性金融资产	49,982,744.36	-
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	49,982,744.36	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	518,000,000.00	47,000,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,741,122.94	35,781.87
应收股利	-	-
应收申购款	453,850,682.80	60,900.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,093,682,562.70	59,947,483.63
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	15,781,668.07	3,998,335.00
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	169,367.22	85,583.23
应付托管费	51,323.36	25,934.33
应付销售服务费	6,640.18	7,614.90
应付交易费用	1,275.00	875.00
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	908,410.10	93,141.50
递延所得税负债	-	-
其他负债	187,518.49	329,000.00
负债合计	17,106,202.42	4,540,483.96
所有者权益:		
实收基金	1,076,576,360.28	55,406,999.67
未分配利润	-	-
所有者权益合计	1,076,576,360.28	55,406,999.67
负债和所有者权益总计	1,093,682,562.70	59,947,483.63

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.000元,基金份额总额1,076,576,360.28份,其中A级基金份额102,488,650.64份,其中B级基金份额974,087,709.64份。

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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年3月13日(基金合同生效日)至2013年6月30日
一、收入	5,227,808.03	4,706,885.36
1.利息收入	5,227,190.36	4,742,191.15
其中:存款利息收入	340,689.76	296,066.51
债券利息收入	133,745.69	217,603.95
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,752,754.91	4,228,520.69
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	617.67	-35,305.79
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	617.67	-35,305.79
资产支持证券投资收益	-	-
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)	-	-
减:二、费用	961,580.38	858,073.58
1.管理人报酬	567,252.92	489,385.11
2.托管费	171,894.84	148,298.52
3.销售服务费	31,825.13	83,500.15
4.交易费用	-	-
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	190,607.49	136,889.80
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	4,266,227.65	3,848,811.78
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	4,266,227.65	3,848,811.78

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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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(基金净值)	1,076,576,360.28	-	1,076,576,360.28
项目	上年度可比期间 2013年3月13日(基金合同生效日)至2013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)	1,101,186,692.48	-	1,101,186,692.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,848,811.78	3,848,811.78
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)	-706,739,015.06	-	-706,739,015.06
其中:1.基金申购款	198,601,785.32	-	198,601,785.32
2.基金赎回款	-905,340,800.38	-	-905,340,800.38
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)	-	-3,848,811.78	-3,848,811.78
五、期末所有者权益(基金净值)	394,447,677.42	-	394,447,677.42

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: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2014年8月28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2014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2014年6月30日的财务状况以及2014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、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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年3月13日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	567,252.92	489,385.11
其中:支付销售机构的客户维护费	14,721.31	116,522.39

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年3月13日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	171,894.84	148,298.52

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 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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年3月13日(基金合同生效日)至2013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	59,636.74	613.75	60,250.49
海通证券	74.60	-	74.60
海富通	76.48	8,697.12	8,773.60
合计	59,787.82	9,310.87	69,098.69

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

单位:份

关联方名称	海富通现金管理货币B本期末 2014年6月30日		海富通现金管理货币B上年度末 2013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	500,388,118.31	51.37%	-	-

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年3月13日(基金合同生效日)至2013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	15,813,512.60	107,689.64	8,334,721.00	138,582.33

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(2014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	49,982,744.36	4.57
	其中:债券	49,982,744.36	4.57
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	518,000,000.00	47.36
	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	70,108,012.60	6.41
4	其他各项资产	455,591,805.74	41.66
5	合计	1,093,682,562.70	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	-
	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	- -
	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????????	20
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	23
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

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	49.98	1.47
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	0.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	4.64	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	3.71	-
	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	59.27	1.47

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	49,982,744.36	4.64
	其中:政策性金融债	49,982,744.36	4.64
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	49,982,744.36	4.64
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	110257	11国开57	200,000	20,002,163.70	1.86
2	110418	11农发18	200,000	19,959,794.67	1.85
3	090306	09进出06	100,000	10,020,785.99	0.93

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