海富通货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要

(2012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2004年11月19日出具的《关于同意海富通货币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。

投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止日为2012年7月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2012年6月30日,财务数据和净值表现未经审计。

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
办公地址: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
法定代表人:邵国有
成立时间:2003年4月18日
电话:021-38650999
联系人:包瑾
注册资本:1.5亿元
股权结构:海通证券股份有限公司51%、法国巴黎投资管理BE控股公司49%。

(二)主要人员情况

邵国有先生,董事长,副教授。历任吉林大学校党委副书记、长春师范学院校党委书记、长春新世纪广场有限公司副董事长兼总经理、海通证券股份有限公司宣传培训中心总经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事长。

吉宇光先生,董事,硕士,高级经济师。历任交通银行北京分行办公室副主任、交通银行北京分行证券部经理、海通证券北京朗家园营业部总经理等职。1997年至今任海通证券股份有限公司副总裁。

艾德加(Stewart Edgar)先生,董事,英国籍,学士。历任英国Ivory & Sime公共有限公司基金经理,美国Fiduciary国际信托公司研究部主任、高级副总裁,英国HD国际有限公司高级基金经理、董事,美国F&C管理公司高级基金经理、董事,比利时富通基金管理公司董事总经理,法国巴黎投资管理公司亚太区董事总经理。

田仁灿先生,董事、总经理,比利时籍,工商管理硕士。历任法国金融租赁Euroequipement S.A.公司总裁助理,富通银行区域经理、大中华地区主管,富通基金管理亚洲有限公司投资经理、业务发展部总经理、首席执行官。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

张文伟先生,董事、副总经理,硕士,高级经济师。历任交通银行郑州分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长,海通证券办公室主任,海通证券投资银行总部副总经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、副总经理。

郑国汉先生,独立董事,经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长,现任商学院院长及经济系讲座教授。

巴约特(Marc Bayot)先生,独立董事,比利时籍,布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授,Pionner投资公司独立副董事长、Fundconnect独立董事长、Degroof资产管理公司独立董事和法国巴黎银行B Flexible SICAV 独立董事。

杨国平先生,独立董事,硕士,高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记,上海市公用事业管理局党办副主任,上海市出租汽车公司党委书记,现任大众交通(集团)股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用事业(集团)股份有限公司董事长、上海交大昂立股份有限公司董事长。

王明权先生,独立董事,硕士,高级经济师。历任武汉市人民政府副市长、交通银行行长、党委(组)书记、副董事长、中国光大(集团)总公司董事长、党委书记。现任全国人大代表、全国人大财经委员会委员。

李础前先生,监事长,经济学硕士,高级经济师。历任安徽省财政厅中企处副主任科员,安徽省国有资产管理局科长,海通证券计划财务部副总经理、总经理和财务总监。

余毓繁先生,监事,英国籍,工商管理荣誉学士。历任比利时通用银行香港分行资金部司库、富通银行亚洲区环球金融市场业务主管、富通银行亚洲区商人银行董事总经理,富通银行香港分行行政总裁。

奚万荣先生,监事,经济学硕士。中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管、海通证券股份有限公司监察稽核部稽核员。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司稽核经理,监察稽核总监。

章明女士,督察长,硕士。历任加拿大BBCC Tech & Trade Int'l Inc公司高级财务经理、加拿大Future Electronics公司产品专家,国信证券业务经理和副高级研究员,海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司督察长。

陈洪先生,副总经理兼投资总监,硕士。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司投资总监兼海富通精选混合基金基金经理,2005年7月至2006年9月任海富通股票基金基金经理,2006年3月至9月任海富通收益增长混合基金基金经理,2006年5月起,任海富通基金管理有限公司副总经理,2007年2月至2007年8月任海富通风格优势股票基金基金经理,2007年4月至2007年8月任海富通精选贰号混合基金基金经理,2008年6月至2011年2月任海富通中国海外股票(QDII)基金基金经理。

阎小庆先生,副总经理,硕士。历任中国人民银行上海分行助理经济师、富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部市场经理、法国农业信贷银行上海华东区首席代表、富通基金管理公司上海代表处首席代表、海富通基金管理有限公司市场总监,2006年5月起,任海富通基金管理有限公司副总经理。

张丽洁女士,经济学硕士学位,2002年7月至2004年7月就职于南京银行股份有限公司,从事债券交易工作,2004年8月加入海富通基金管理有限公司,任助理固定收益分析师、组合经理,2008年2月起担任海富通货币基金基金经理,2011年9月起担任海富通稳进增利分级债券基金经理。

本基金历任基金经理为邵佳民先生,任职时间为2005年1月至2008年2月。

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会常设委员有:田仁灿,总经理;陈洪,副总经理兼投资总监;戴德舜,股票绝对收益组合部总监;蒋征,股票相对收益组合部总监;丁俊,研究总监;邵佳民,固定收益组合管理部总监;杜晓海,定量及风险管理总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的,则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司(简称"中国银行"),基本情况如下:

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
变更注册登记日期:2004年8月26日
注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人:肖 钢
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管及投资者服务部总经理:李爱华
托管部门信息披露联系人:唐州徽
电话:(010)66594855
传真:(010)66594942

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

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
办公地址: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
法定代表人:邵国有
电话:021-38650999
联系人:康旭
客户服务中心电话:40088-40099(免长途话费)
电话:021-38650797
传真:021-33830160

2. 场外代销机构

(1)中国银行股份有限公司
地址:北京市西城区复兴门内大街1 号
法定代表人:肖钢
电话:010-66596688
传真:010-66593777
客户服务电话:95566
网址:www.boc.cn

(2)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
传真:010-66275654
客户服务电话:95533
联系人:张静
网址:www.ccb.com

(3)中国工商银行股份有限公司
地址:北京市西城区复兴门内大街55号(100032)
法定代表人:姜建清
客户服务电话:95588
电话:010-66107900
传真:010-66107914
网址:www.icbc.com.cn

(4)交通银行股份有限公司
地址:上海市银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
客户服务电话:95559
联系人:曹榕
网址:www.bankcomm.com

(5)招商银行股份有限公司
地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:傅育宁
客户服务电话:95555
联系人:邓炯鹏
网址:www.cmbchina.com

(6)广发银行股份有限公司
注册地址:广州市越秀区东风东路713号
法定代表人:董建岳
客户服务电话:95508
联系人:詹全鑫 张大奕
网址:http://www.cgbchina.com.cn/

(7)兴业银行股份有限公司
地址:福州市湖东路154号
法定代表人:高建平
客户服务电话:95561
联系人:梁曦
网址:www.cib.com.cn

(8)深圳发展银行股份有限公司
地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:肖遂宁
客户服务电话:95501
联系人:姜聃
网址:www.sdb.com.cn

(9)中国民生银行股份有限公司
地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
客户服务电话:95568
联系人:董云巍、吴海鹏
网址:www.cmbc.com.cn

(10)上海浦东发展银行股份有限公司
地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
客户服务电话:95528
联系人:徐伟、汤嘉惠
网址:www.spdb.com.cn

(11)浙商银行股份有限公司
地址:中国杭州市庆春路288号
法定代表人:张达洋
客户服务电话:95527
联系人:毛真海
网址:www.czbank.com

(12)宁波银行股份有限公司
地址:宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人:陆华裕
客户服务电话:96528/962528
联系人:胡技勋
网址:www.nbcb.com.cn

(13)华夏银行股份有限公司
地址:北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人:吴建
客户服务电话:95577
网址:www.hxb.com.cn

(14)海通证券股份有限公司
地址:上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人:王开国
客户服务电话:021-95553或4008888001
联系人:李笑鸣
网址:www.htsec.com

(15)中信证券股份有限公司
地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
电话:010-84588266
联系人:陈忠
网址:www.ecitic.com

(16)光大证券股份有限公司
地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
客户服务电话:400-8888-788
联系人:刘晨、沈雯斐
网址:www.ebscn.com

(17)国泰君安证券股份有限公司
地址:上海市浦东新区商城路618号
法定代表人:万建华
客户服务电话:400-8888-666
联系人:芮敏祺、吴倩
网址:www.gtja.com

(18)中信建投证券股份有限公司
地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
客户服务电话: 400-8888-108
联系人:权唐
网址:www.csc108.com

(19)招商证券股份有限公司
地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
客户服务电话:400-8888-111或95565
联系人:林生迎
网址:www.newone.com.cn

(20)兴业证券股份有限公司
地址:福建省福州市湖东路99号标力大厦
法定代表人:兰荣
客户服务电话:95562
联系人:谢高得
网址:www.xyzq.com.cn

(21)华泰证券股份有限公司
地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
客户服务电话:95597
联系人:肖亦玲
网址:www.htsc.com.cn

(22)华泰联合证券有限责任公司
地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦25、24、10层
法定代表人:马昭明
客户服务电话:400-8888-555、95513
联系人:盛宗凌
网址:www.lhzq.com

(23)广发证券股份有限公司
地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼
法定代表人:林治海
客户服务电话:95575或致电各地营业网点
联系人:黄岚
网址:www.gf.com.cn

(24)长江证券股份有限公司
地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
客户服务电话:95579或4008-888-999
联系人:李良
网址:www.95579.com

(25)申银万国证券股份有限公司
地址: 上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
客户服务电话:962505
联系人:邓寒冰
网址:www.sywg.com.cn

(26)中银国际证券有限责任公司
地址:上海市浦东银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:许刚
客户服务电话:400-6208-888
联系人:张静
网址:www.bocichina.com.cn

(27)东方证券股份有限公司
地址:上海市中山南路318号2号楼21层-29层
法定代表人:潘鑫军
客户服务电话:95503
联系人:吴宇
网址:www.dfzq.com.cn

(28)国信证券股份有限公司
地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层到26层
法定代表人:何如
客户服务电话:95536
联系人:齐晓燕
网址:www.guosen.com.cn

(29)中国银河证券股份有限公司
地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:顾伟国
客户服务电话:4008-888-888
联系人:田薇
网址:www.chinastock.com.cn

(30)平安证券有限责任公司
地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
客户服务电话:95511
联系人:郑舒丽
网址:http://stock.pingan.com/

(31)世纪证券有限责任公司
地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人:卢长才
电话:0755-83199511
联系人:张婷
网址:www.csco.com.cn

(32)中信证券(浙江)有限责任公司
地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人:沈强
客户服务电话:0571-96598
联系人:俞会亮
网址:www.bigsun.com.cn

(33)中信万通证券有限责任公司
地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层
法定代表人:杨宝林
客户服务电话:电话:0532-96577
联系人:吴忠超
网址:www.zxwt.com.cn

(34)东北证券股份有限公司
地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
客户服务电话: 4006000686
联系人: 潘锴
网址:www.nesc.cn

(35)财通证券有限责任公司
地址:杭州市杭大路15号嘉华国际中心
法定代表人:沈继宁
客户服务电话:96336(浙江),40086-96336(全国)
联系人:徐轶青
网址:www.ctsec.com

(36)天相投资顾问有限公司
地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座
法定代表人:林义相
客户服务电话:010-66045678
联系人:莫晓丽
网址:www.txsec.com

(37)国海证券股份有限公司
地址:广西南宁市滨湖路46号
法定代表人:张雅锋
客户服务电话:95563
联系人:武斌
网址:www.ghzq.com.cn

(38)恒泰证券股份有限公司
地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:庞介民
电话:0471-4961259
联系人:张同亮
网址:www.cnht.com.cn

(39)瑞银证券有限责任公司
地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人:刘弘
客户服务电话:400-887-8827
联系人:谢亚凡
网址:www.ubssecurities.com

(40)中航证券有限公司
地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人:杜航
客服电话:4008866567
联系人:余雅娜
网址:www.scstock.com

(41)国元证券股份有限公司
地址:安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
客户服务电话:95578
联系人:陈琳琳
网址:www.gyzq.com.cn

(42)德邦证券有限责任公司
住所:上海市福山路500号城建大厦26层
法定代表人:姚文平
客户服务电话:4008888128
联系人:罗芳
网址:www.tebon.com.cn

(43)宏源证券股份有限公司
公司注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
客户服务电话:400-800-0562
联系人:李巍
网址:www.hysec.com

(44)齐鲁证券有限公司
地址:山东省济南市经七路86 号
法定代表人:李玮
客户服务电话:95538
联系人:孙豪志
网址:www.qlzq.com.cn

(45)第一创业证券有限责任公司
地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
法定代表人:刘学民
客户服务电话:4008881888
联系人:魏颖
网址:www.firstcapital.com.cn

(46)湘财证券有限责任公司
地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人:林俊波
客户服务电话:400-888-1551
联系人:钟康莺
网址:www.xcsc.com

(47)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35层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
客户服务电话:400-800-1001
联系人:陈剑虹
网址:www.essence.com.cn

(48)中国中投证券有限责任公司
地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第18层至21层
法定代表人:龙增来
客户服务电话:95532或4006008008
联系人:刘毅
网址:www.cjis.cn

(49)中国国际金融有限公司
地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:李剑阁
公司总机:010-65051166(北京);021-58796226(上海)
联系人:易建军
网址:www.cicc.com.cn

(50)中国民族证券有限责任公司
地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层-9层
法定代表人:赵大建
客户服务电话:400-889-5618
联系人:李薇
网址:www.e5618.com

(51)华宝证券有限责任公司
地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
法定代表人:陈林
客户服务电话:4008209898
联系人:刘闻川
网址:www.cnhbstock.com

(52)信达证券股份有限公司
地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:高冠江
客户服务电话:400-800-8899
联系人:唐静
网址:www.cindasc.com

(53)长城证券有限责任公司
地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
客户服务电话:4006666888
联系人:高峰
网址:www.cgws.com

(54)方正证券股份有限公司
地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
客户服务电话:95571
联系人:彭博
网址:www.foundersc.com

(55)华福证券有限责任公司
地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人:黄金琳
客户服务电话:0591-96326
联系人:张腾
网址:www.gfhfzq.com.cn

(56)渤海证券股份有限公司
地址:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人:杜庆平
客户服务电话:400-651-5988
联系人:王兆权
网址:www.bhzq.com

(57)东莞证券有限责任公司
地址: 广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:游锦辉
客户服务电话:961130
联系人:梁建伟
网址:www.dgzq.com.cn

(58)广州证券有限责任公司
地址: 广州市越秀区先烈中路69号东山广场主楼17楼
法定代表人:刘东
客户服务电话:020-961303
联系人:林洁茹
网址:www.gzs.com.cn

(59)上海证券有限责任公司
地址:上海市黄浦区西藏中路336号
法定代表人:郁忠民
客户服务电话:4008918918
联系人:陈翔
网址:www.962518.com

(60)大通证券股份有限公司
地址:大连市沙河口区会展路129号
法定代表人:于宏民
客户服务电话:4008169169
联系人:谢立军
网址:www.daton.com.cn

(61)江海证券有限公司
地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
客户服务电话:400-666-2288
联系人:郭玲
网址:www.jhzq.com.cn

(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
客户服务电话:400-666-1618
联系人:张志国
网址:www.i618.com.cn

(63)国都证券有限责任公司
地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
法定代表人:常喆
客户服务电话:400-818-8118
联系人:黄静
网址:www.guodu.com

(64)东兴证券有限责任公司
地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:徐勇力
客户服务电话:4008-888-993
联系人:汤漫川
网址:www.dxzq.net

(65)财富证券有限责任公司
地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人:周晖
电话:0731-84403360
传真:0731-84403330
联系人:朱友谊
网址:www.cfzq.com

(66)民生证券有限责任公司
地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A层
法定代表人:岳献春
客户服务电话:4006198888
联系人:赵明
网址:http://www.mszq.com/

(67)华龙证券有限责任公司
地址:甘肃省兰州市东岗西路638号
法定代表人:李晓安
客户服务电话:4006898888
联系人:李昕田
网址:http://www.hlzqgs.com

(68)英大证券有限责任公司
地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人:赵文安
客户服务电话:4008698698
联系人:李欣
网址:www.ydsc.com.cn

(69)中山证券有限责任公司
地址: 深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人: 吴永良
客户服务电话: 4001022011
联系人: 李珍
网址:www.zszq.com

(70)红塔证券股份有限公司
地址:云南省昆明市北京路155号附一号红塔大厦9楼
法定代表人:况雨林
客户服务电话:0871 - 3577888
联系人:刘晓明
网址:www.hongtastock.com

(71)日信证券有限责任公司
地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人:孔佑杰
客户服务电话:010-88086830
联系人:冯杰
网址:www.rxzq.com.cn

(72)深圳众禄基金销售有限公司
地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人:薛峰
客户服务电话:4006-788-887
联系人:张玉静
网址:www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(73)杭州数米基金销售有限公司
地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
客户服务电话:4000-766-123
联系人:周嬿旻
网址:www.fund123.cn

3、场内代销机构

本基金自2012年7月2日起通过上海证券交易所开放式销售系统办理申购赎回业务。具有开放式基金代销资格的、经中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员可成为本基金的场内销售机构,相关信息同时通过上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)登载。

基金管理人可以根据需要,增加其他符合要求的机构代理销售本基金,并按照相关规定及时公告。

(二)注册登记人

名称: 中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:金颖
电话:010-59378835
传真:010-59378907
联系人:任瑞新

(三)出具法律意见书的律师事务所

北京市金杜律师事务所
地址:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座40层
负责人:王玲
电话:010-58785588
传真:010-58785599
联系人:靳庆军
联系电话:010-58785588
经办律师:靳庆军、宋萍萍

(四)审计基金财产的会计师事务所

普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法人代表:杨绍信
经办注册会计师:汪棣、金毅
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:金毅

四、基金的名称

本基金名称:海富通货币市场证券投资基金

五、基金类型

基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金的投资目标为: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。

七、基金的投资方向

本基金投资于如下的金融工具: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。

八、基金的投资策略

1. 决策依据

(1)投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定;

(2)投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比;

(3)投资部策略分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告,为投资策略提供依据。

2. 决策程序

(1)整体配置策略

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。

(2)类别资产配置策略

根据整体策略要求,决定组合中类别资产的配置内容和各类别投资的比例。

根据不同类别资产的流动性指标(二级市场存量、二级市场流量、分类资产日均成交量、近期成交量、近期变动量、交易场所),决定类别资产的当期配置比率。

根据不同类别资产的收益率水平(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类别资产收益差异)、市场偏好、法律法规对基金投资的规定、基金合同、基金收益目标、业绩比较基准等决定不同类别资产的目标配置比率。

(3)明细资产配置策略

第一步筛选,根据明细资产的剩余期限、资信等级、流动性指标(流通总量、日均交易量),决定是否纳入组合。

第二步筛选,根据个别债券的收益率(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理)与剩余期限的配比,对照基金的收益要求决定是否纳入组合。

第三步筛选,根据个别债券的流动性指标(发行总量、流通量、上市时间),决定投资总量。

3. 投资管理方法

(1)短期利率水平预期策略

深入分析国家货币政策、短期资金市场利率波动、资本市场资金面的情况和流动性的变化,对短期利率走势形成合理预期,并据此调整基金货币资产的配置策略。

(2)收益率曲线分析策略

根据收益率曲线的变化趋势,采取相应的投资管理策略。货币市场收益率曲线的形状反映当时短期利率水平之间的关系,反映市场对较短期限经济状况的判断及对未来短期经济走势的预期。

(3)组合剩余期限策略、期限配置策略

通过对组合资产剩余期限的设计、跟踪、调整,达到保持合理的现金流,锁定组合剩余期限,以满足可能的、突发的现金需求,同时保持组合的稳定收益;特别在债券投资中,根据收益率曲线的情况,投资一定剩余期限的品种,稳定收益,锁定风险,满足组合目标期限。

(4)类别品种配置策略

在保持组合资产相对稳定的条件下,根据各类短期金融工具的市场规模、收益性和流动性,决定各类资产的配置比例;再通过评估各类资产的流动性和收益性利差,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

(5)流动性管理策略

在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下,通过基金资产安排(包括现金库存、资产变现、剩余期限管理或以其他措施),在保持基金资产高流动性的前提下,确保基金的稳定收益。

(6)无风险套利策略

无风险套利策略包括:

跨市场套利策略:根据各细分短期金融工具的流动性和收益特征,动态调整基金资产在各个细分市场之间的配置比例。

跨品种套利策略:根据各细分市场中不同品种的风险参数、流动性补偿和收益特征,动态调整不同期限结构品种的配置比例。

(7)滚动配置策略

根据具体投资品种的市场特性,采用持续滚动投资的方法,以提高基金资产的整体持续的变现能力。

九、基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为,税后一年期银行定期存款利率。

在合理的市场化利率基准推出的情况下,本基金管理人可根据投资目标和投资策略,确定变更业绩比较基准,并及时公告。

本基金管理人认为,业绩的选择标准需要合理、透明,为广大投资者所接受。本业绩基准是投资者最熟知、最容易获得的低风险收益率。

十、基金的风险收益特征

本货币市场基金是具有较低风险、流动性强的基金品种,其预期风险和预期收益率都低于股票,债券和混合型基金。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

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2012年8月2日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据为截至2012年6月30日("报告期末")的季报数据,本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,378,549,452.01	43.72
	其中:债券	1,378,549,452.01	43.72
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	97,500,386.25	3.09
	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	1,609,539,321.11	51.04
4	其他各项资产	67,801,033.39	2.15
5	合计	3,153,390,192.76	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.69	
	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	9,999,875.00	0.32
	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%。

3、基金投资组合平均剩余期限

(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	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	82

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

在本报告期本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180 天。

(2)报告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	6.63	0.32
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	31.35	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	6.03	-
3	60天(含)—90天	14.12	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.89	-
4	90天(含)—180天	31.01	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.45	-
5	180天(含)—397天(含)	15.73	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.84	0.32

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	401,479,898.30	12.86
	其中:政策性金融债	401,479,898.30	12.86
4	企业债券	185,401,724.07	5.94
5	企业短期融资券	791,667,829.64	25.36
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,378,549,452.01	44.16
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	386,252,151.03	12.37

5、报告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

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(%)
1	071202001	12国泰君安CP001	1,300,000	129,964,578.31	4.16
2	070219	07国开19	1,200,000	120,428,690.53	3.86
3	110206	11国开06	1,100,000	110,572,429.09	3.54
4	041161012	11浙交投CP001	1,000,000	100,321,929.51	3.21
5	100236	10国开36	900,000	90,277,997.87	2.89
6	058031	05中信债1	800,000	78,347,471.44	2.51
7	068007	06首都机场债	800,000	77,789,492.05	2.49
8	041158008	11皖高速CP001	700,000	70,177,643.18	2.25
9	070419	07农发19	400,000	40,265,106.56	1.29
10	041262009	12东方CP001	400,000	40,199,038.45	1.29

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	62次
报告期内偏离度的最高值	0.4081%
报告期内偏离度的最低值	0.2572%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3132%

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8、投资组合报告附注

(1)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。

(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。

(3)本基金投资的前十名证券的发行主体本期末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。

(4)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	25,250,830.74
4	应收申购款	42,550,202.65
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	67,801,033.39

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2012年6月30日。

基金管理人依照恪尽职守、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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较:

海富通货币基金A

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)
2005.1.4-2005.12.31	2.4894%	0.0070%	1.7852%	0.0000%	0.7042%	0.0070%
2006.1.1-2006.12.31	1.9236%	0.0040%	1.8797%	0.0003%	0.0439%	0.0037%
2007.1.1-2007.12.31	3.4972%	0.0090%	2.7827%	0.0018%	0.7145%	0.0072%
2008.1.1-2008.12.31	4.1075%	0.0134%	3.7717%	0.0012%	0.3358%	0.0122%
2009.1.1-2009.12.31	1.6104%	0.0053%	2.2500%	0.0000%	-0.6396%	0.0053%
2010.1.1-2010.12.31	1.9003%	0.0043%	2.3040%	0.0003%	-0.4037%	0.0040%
2011.1.1-2011.12.31	3.9368%	0.0037%	3.2798%	0.0007%	0.6570%	0.0030%
2012.1.1-2012.6.30	2.2528%	0.0057%	1.7147%	0.0002%	0.5381%	0.0055%
2005.1.4-2012.6.30	23.8577%	0.0078%	21.5420%	0.0020%	2.3157%	0.0058%

海富通货币基金B

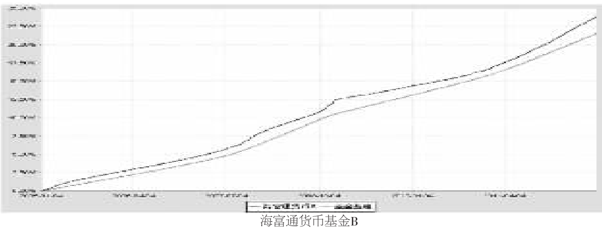
阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2006.8.1-2006.12.31	0.9344%	0.0036%	0.8296%	0.0002%	0.1048%	0.0034%
2007.1.1-2007.12.31	3.7454%	0.0090%	2.7827%	0.0018%	0.9627%	0.0072%
2008.1.1-2008.12.31	4.3553%	0.0134%	3.7717%	0.0012%	0.5836%	0.0122%
2009.1.1-2009.12.31	1.8551%	0.0053%	2.2500%	0.0000%	-0.3949%	0.0053%
2010.1.1-2010.12.31	2.1453%	0.0043%	2.3040%	0.0003%	-0.1587%	0.0040%
2011.1.1-2011.12.31	4.1859%	0.0037%	3.2798%	0.0007%	0.9061%	0.0030%
2012.1.1-2012.6.30	2.3743%	0.0057%	1.7147%	0.0002%	0.6596%	0.0055%
2006.8.1-2012.6.30	21.2618%	0.0082%	18.1796%	0.0019%	3.0822%	0.0063%

注:本基金收益分配按月结转份额。

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:

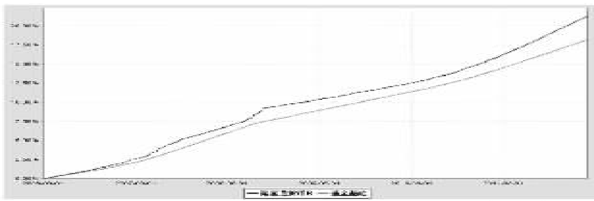
海富通货币基金A

(2005年1月4日至2012年6月30日)



海富通货币基金B

(2006年8月1日至2012年6月30日)



注:按照本基金合同规定,本基金自2005年1月4日合同生效日起至2005年4月4日为建仓期。建仓期满至今,本基金投资组合均达到本基金合同第十五节(二)、(六)规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围

十三、基金的费用和税收

(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

基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计算。计算方法如下:

$H=E\times0.33\%\div$当年天数;

H为每日应计提的基金管理费;

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人

(2)基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times0.1\%\div$当年天数;

H为每日应计提的基金托管费;

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3)与基金运作有关的其他费用

主要包括证券交易费用、基金合同生效后的基金信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费。该等费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

2. 与基金销售有关的费用

(1)转换费

基金转换费率等依照本招募说明书第九节的相关规定。

(2)基金销售服务费

基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用,由基金管理人支配使用。经证监会批准,本基金自2006年8月1日起实行销售服务费AB分级的收费方式。在通常情况下,本基金A级基金份额的销售服务费年费率为0.25%,B级基金份额的年费率为0.01%.。各级基金份额的销售服务费计提的计算方法如下:

$H=E\times R\div$当年天数

H为各级基金份额每日应计提的销售服务费

E为前一日该级基金份额的基金资产净值

R为该级基金份额的销售服务费率

基金管理人可以调整对各级基金份额计提的销售服务费率,但销售服务费年

费率最高不超过0.25%。基金管理人必须在开始调整之日的3个工作日之前至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

基金销售服务费每日计算,每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费支付指令,基金托管人复核后于次月首两个工作日内从基金资产中一次性直接支付给基金销售机构,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

3. 其他费用

按照国家有关规定可以列入的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

(二)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金资产中列支。

(三)基金管理费、基金托管费、转换费、基金销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

基金管理人可调整转换费、基金销售服务费,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

(四)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

海富通货币市场证券投资基金更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金原更新招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

(一)第二节、"释义"部分:

1、更新了对《销售办法》的释义;

2、新增了《办理规则》、《实施细则》、《操作指引》、会员单位、场内、场外的释义。

(二)第三节、"基金管理人"部分:

1、更新了艾德加(Stewart Edgar)先生、郑国汉先生、巴约特(Marc Bayot)先生、杨国平先生、王明权先生、李础前先生、阎小庆先生和张丽洁女士的简历

(三)第四节、"基金托管人"部分,更新了基金托管人证券投资基金托管情况。

(四)第五节、"相关服务机构"部分:

1、场外代销机构:新增深圳众禄基金销售有限公司和杭州数米基金销售有限公司为场外代销机构,并对部分场外代销机构的相关信息进行了更新;

2、场内代销机构:新增场内代销机构的相关信息;

3、出具法律意见书的律师事务所:更新了律师事务所的地址、联系人及联系电话信息。

(五)第八节、"基金份额的申购和赎回"部分:

将"投资者每笔申购申请不得低于1,000元"更新为"场外单次申购申请不得低于1,000元,销售机构在此最低起点金额之上另有规定的,从其规定;场内单次申购的最低金额为1000元,最高金额为99,999,900.00元,且场内单次申购金额必须是100的整数倍。"

(六)第十一节、"基金的投资"和"第十二节、基金的业绩"部分:

根据2012年第二季度报告,更新了基金投资组合报告和基金业绩的内容,相关数据截止期为2012年6月30日。

海富通基金管理有限公司
二〇一二年八月十七日