海富通稳健添利债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十九日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月18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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通稳健添利债券	
基金主代码	519023	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年10月24日	
报告期末基金份额总额	27,400,194.75份	
投资目标	在强调本金安全的基础上,积极追求资产长期稳健的增值。	
投资策略	本基金通过价值分析,采用自上而下确定投资策略,采取久期管理、类属配置和现金管理策略等积极投资策略,发现、确认并利用细分市场失衡,实现组合增值。	
业绩比较基准	中证全债指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于中低风险品种。其预期收益和风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	海富通稳健添利债券A	海富通稳健添利债券C
下属两级基金的交易代码	519024	519023
报告期末下属两级基金的份额总额	3,358,127.14份	24,042,067.61份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)	
	海富通稳健添利债券A	海富通稳健添利债券C
1.本期已实现收益	137,739.47	1,023,047.18
2.本期利润	207,283.76	2,033,524.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0340	0.0366
4.期末基金资产净值	3,782,915.82	26,737,768.59
5.期末基金份额净值	1.126	1.112

注:(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)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。

(3)海富通稳健添利债券型证券投资基金于2009年3月13日刊登公告,自2009年3月18日起增加一种新的收费模式-A类收费模式,该类别收取申购费和赎回费,不收取销售服务费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.海富通稳健添利债券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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.40%	0.17%	2.94%	0.06%	0.46%	0.11%

2.海富通稳健添利债券C:

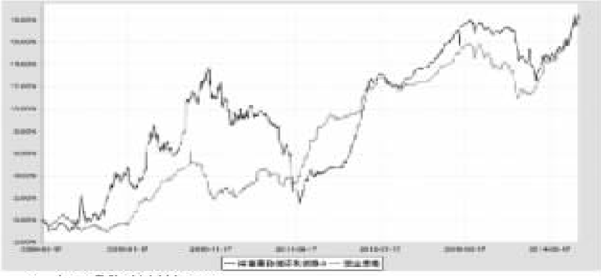
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.35%	0.17%	2.94%	0.06%	0.41%	0.11%

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通稳健添利债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

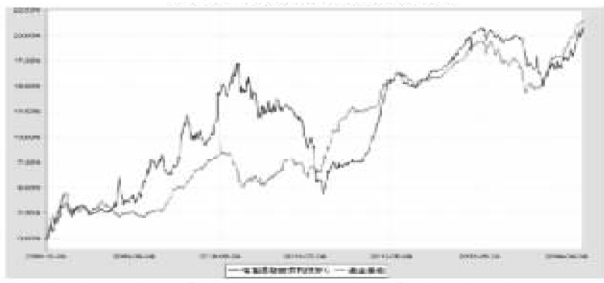
1. 海富通稳健添利债券A

(2009年3月18日至2014年6月30日)



2.海富通稳健添利债券C

(2008年10月24日至2014年6月30日)



注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一章(二)投资范围、(六)投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
邵佳民	本基金的基金经理;海富通强化回报混合基金经理;海富通稳固收益债券基金经理;海富通稳进增利分级债券基金经理;投资副总监	2008-10-24	-	17年	硕士,持有基金从业人员资格证书。历任海通证券公司固定收益部债券业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资部经理。2003年4月任海富通基金管理有限公司固定收益分析师,2005年1月至2008年1月任海富通货币基金经理,2006年5月起任海富通强化回报混合基金经理,2007年10月至2013年1月任固定收益组合管理部总监,2008年10月起兼任海富通稳健添利债券基金经理,2010年11月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2013年1月起任投资副总监并兼任海富通稳进增利分级债券基金经理。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年第二季度债券市场继续上升。中央银行的定向降准很大程度上改善了市场预期,而经济增长数据较为温和、股票市场机会不多等因素也推动了更多资金进入债券市场。债券市场在利率债的带领下,在一级市场招标利率的推动下,出现持续性行情。整体上,5年期以上利率债从5%的区间进入到4%的区间,而城投债则整体下降到7%以下。信用方面虽然不断有一些不利的消息,交易所市场在回购质押入库标准等方面采取了更加严格的标准,但没有对市场构成大的影响;在资金的推动下,中低等级信用债也出现一定的上涨。可转债方面整体维持区间震荡,有小幅度上涨,受股票市场的影响大一些。本组合保持较高比例的配置,以信用债为主,其次是可转债,利率债的配置相对低。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通稳健添利债券C类基金净值增长率为3.35%,同期业绩比较基准收益率为2.94%;海富通稳健添利债券A类基金净值增长率为3.40%,同期业绩比较基准收益率为2.94%。

4.6 市场展望和投资策略

基金管理人认为,2014年第三季度市场将有小幅度的调整压力。一方面货币政策难以有实质性的放松,通货膨胀的压力还存在;另一方面,债券收益率对投资者的吸引力下降,对发行人推动发债的作用却在增强,加上配置帐户的需求已经满足较多,出现阶段性供需逆转的可能性是存在的。信用方面,相信仍然会爆发一定的风险事件,对信用市场构成压力。可转债的表现仍将实质性地取决于股票。基金将保持一定的流动性,紧密关注市场变化,寻找获得超额收益的机会。

§5 投资组合报告

5.1 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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	31,861,100.00	92.59
	其中:债券	31,861,100.00	92.59
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,290,701.66	6.66
7	其他资产	259,226.19	0.75
8	合计	34,411,027.85	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,006,000.00	6.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	15,263,700.00	50.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	14,591,400.00	47.81
8	其他	-	-
9	合计	31,861,100.00	104.39

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1280185	12普洱国资债	100,000	9,969,000.00	32.66
2	126019	09长虹债	40,000	3,817,200.00	12.51
3	113005	平安转债	30,000	3,204,600.00	10.50
4	110020	南山转债	30,000	2,851,200.00	9.34
5	110023	民生转债	30,000	2,784,000.00	9.12

5.6 报告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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同,本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的平安转债(113005)于2013年10月15日发布《中国平安保险(集团)股份有限公司关于平安证券收到中国证监会处罚事先告知书的公告》,因其控股子公司平安证券有限责任公司在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中没有遵循"合规经营、公开透明"的原则,中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。

对该债券的投资决策程序的说明:该转债发行人是集保险、银行、投资等金融业务为一体的综合金融服务集团,主体和债项均为AAA评级,整体偿债能力较强,违约风险较低,是目前转债市场上唯一的保险公司转债,具有一定的投资价值。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程,该债券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的石化转债(110015)于2014年1月13日公告,国务院对山东省青岛市"11.22"中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告作出批复,同意国务院事故调查组的调查处理结果,认定是一起特别重大责任事故;公司及中国石化相关董事、监事、高级管理人员服从国务院事故调查组对本次事故责任的认定,并接受对相关责任人员的处理决定。

对该债券的投资决策程序的说明:该转债发行人是中国最大的石油产品和主要石化产品生产商和供应商,主体和债项均为AAA评级,整体偿债能力很强,违约风险较低。目前石化转债的混合所有制改革预期将继续发酵,绝对价格不高,具备一定债性,同时向上弹性较大,是波段操作的重点大盘转债品种。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程,该债券被纳入本基金的实际投资组合。

其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	22,028.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	237,198.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	259,226.19

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	3,204,600.00	10.50
2	110020	南山转债	2,851,200.00	9.34
3	110023	民生转债	2,784,000.00	9.12
4	110015	石化转债	2,159,400.00	7.08
5	110011	歌华转债	2,027,600.00	6.64
6	128003	华天转债	1,221,460.00	4.00
7	110022	同仁转债	343,140.00	1.12

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	海富通稳健添利债券A	海富通稳健添利债券C
报告期期初基金份额总额	6,854,181.71	63,095,716.01
报告期期间基金总申购份额	78,298.55	119,134.94
减:报告期期间基金总赎回份额	3,574,353.12	39,172,783.34
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	3,358,127.14	24,042,067.61

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 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28只公募基金。截至2014年6月30日,海富通管理的公募基金资产规模为237亿元人民币。

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2014年6月30日,海富通为80多家企业超过311亿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2014年6月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模近54亿元。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。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。

2004年末开始,海富通为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2014年6月30日,投资咨询及海外业务规模超过215亿元人民币。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3月,国内权威财经媒体《中国证券报》等授予海富通基金管理有限公司"中国基金业金牛基金管理公司"大奖,《证券时报》授予 海富通精选混合基金"2011年中国基金业明星奖—五年持续回报平衡混合型明星基金"荣誉。2013年4月,《上海证券报》授予海富通精选混合基金2012年"金基金"奖——分红基金奖。

海富通同时还在不断践行其社会责任。公司自2008年启动"绿色与希望-橄榄枝公益环保计划",针对汶川震区受灾学校、上海民工小学、安徽老区小学进行了物资捐赠,向内蒙古库伦旗捐建了环保公益林。几年来,海富通的公益行动进一步升级,持续为上海民工小学学生捐献生活物资,并向安徽农村小学捐献图书室。此外,海富通还积极推进投资者教育工作,推出了以"幸福投资"为主题和特色的投资者教育活动,向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通稳健添利债券型证券投资基金的文件
(二)海富通稳健添利债券型证券投资基金基金合同
(三)海富通稳健添利债券型证券投资基金招募说明书
(四)海富通稳健添利债券型证券投资基金托管协议
(五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
(六)报告期内海富通稳健添利债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

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层本基金管理人办公地址。

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇一四年七月十九日

海富通稳进增利分级债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十九日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月18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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通稳进增利分级债券(场内简称:海富增利)	
基金主代码	162308	
基金运作方式	契约型基金,本基金基金合同生效后,封闭期为三年(含三年),封闭期届满后转为上市开放式基金(LOF)。	
基金合同生效日	2011年9月1日	
报告期末基金份额总额	220,512,565.45份	
投资目标	本基金在控制风险和保持资产适当流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金为债券型基金,对债券类资产的投资比例不低于基金资产的80%。在此约束下本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断,对固定收益类资产、权益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪,从而决定其配置比例。固定收益类资产中,本基金将采取久期管理、收益率曲线策略、类属配置等积极投资策略,在不同券种之间进行配置。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=中证全债指数×90%+沪深300指数×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通稳进增利分级债券A(场内简称:增利A)	海富通稳进增利分级债券B(场内简称:增利B)
下属两级基金的交易代码	150044	150045
报告期末下属两级基金的份额总额	176,410,051.34份	44,102,514.11份
下属两级基金的风险收益特征	增利A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征	增利B份额则表现出较高风险、收益相对较高的特征

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	1,827,389.18
2.本期利润	7,577,963.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.0344
4.期末基金资产净值	271,430,694.09
5.期末基金份额净值	1.231

注:(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)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。

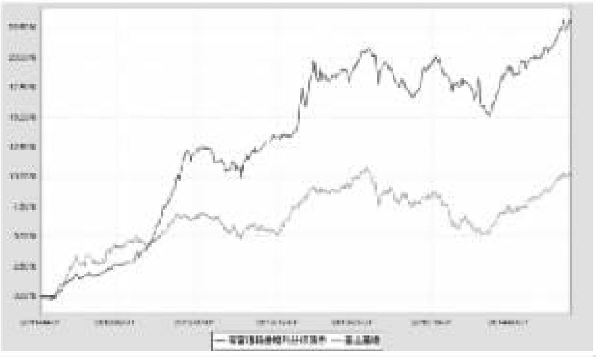
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.84%	0.14%	2.73%	0.09%	0.11%	0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通稳进增利分级债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年9月1日至2014年6月30日)



注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分(二)投资范围、(六)投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
邵佳民	本基金的基金经理;海富通稳健添利债券基金经理;海富通强化回报混合基金经理;海富通稳固收益债券基金经理;投资副总监	2013-1-6	-	17年	硕士,持有基金从业人员资格证书。历任海通证券公司固定收益部债券业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资部经理。2003年4月任海富通基金管理有限公司固定收益分析师,2005年1月至2008年1月任海富通货币基金经理,2006年5月起任海富通强化回报混合基金经理,2007年10月至2013年1月任固定收益组合管理部总监,2008年10月起兼任海富通稳健添利债券基金经理,2010年11月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2013年1月起任投资副总监并兼任海富通稳进增利分级债券基金经理。

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为:自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年第二季度债券市场继续上升。中央银行的定向降准很大程度上改善了市场预期,而经济增长数据较为温和、股票市场机会不多等因素也推动了更多资金进入债券市场。债券市场在利率债的带领下,在一级市场招标利率的推动下,出现持续性行情。整体上,5年期以上利率债从5%的区间进入到4%的区间,而城投债则整体下降到7%以下。信用方面虽然不断有一些不利的消息,交易所市场在回购质押入库标准等方面采取了更加严格的标准,但没有对市场构成大的影响;在资金的推动下,中低等级信用债也出现一定的上涨。可转债方面整体维持区间震荡,有小幅度上涨,受股票市场的影响大一些。本组合保持较高比例的配置,以信用债为主,其次是可转债,利率债的配置相对低。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通稳进增利债券型证券投资基金的净值增长率为2.84%,同期业绩比较基准收益率为2.73%。

4.6 市场展望和投资策略

基金管理人认为,2014年第三季度市场将有小幅度的调整压力。一方面货币政策难以有实质性的放松,通货膨胀的压力还存在;另一方面,债券收益率对投资者的吸引力下降,对发行人推动发债的作用却在增强,加上配置帐户的需求已经满足较多,出现阶段性供需逆转的可能性是存在的。信用方面,相信仍然会爆发一定的风险事件,对信用市场构成压力。可转债的表现仍将实质性地取决于股票。基金将保持目前仓位,提高资产流动性,寻找获得超额收益的机会。

§5 投资组合报告

5.1 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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	255,935,723.22	92.19
	其中:债券	255,935,723.22	92.19
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	10,000,000.00	3.60
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,351,070.54	0.49
7	其他资产	10,336,479.86	3.72
8	合计	277,623,273.62	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,024,000.00	1.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	179,328,373.22	66.07
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	73,583,350.00	27.11
8	其他	-	-
9	合计	255,935,723.22	94.29

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	124351	13克州债	240,000	23,373,600.00	8.61
2	111051	09怀化债	199,720	21,250,208.00	7.83
3	1280030	12丹投债	200,000	20,922,000.00	7.71
4	122661	12怀化债	198,540	20,846,700.00	7.68
5	122840	11临汾债	200,000	20,700,000.00	7.63

5.6 报告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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同,本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的石化转债(110015)于2014年1月13日公告,国务院对山东省青岛市"11.22"中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告作出批复,同意国务院事故调查组的调查处理结果,认定是一起特别重大责任事故;公司及中国石化相关董事、监事、高级管理人员服从国务院事故调查组对本次事故责任的认定,并接受对相关责任人员的处理决定。

对该债券的投资决策程序的说明:该转债发行人是中国最大的石油产品和主要石化产品生产商和供应商,主体和债项均为AAA评级,整体偿债能力很强,违约风险较低。目前石化转债的混合所有制改革预期将继续发酵,绝对价格不高,具备一定债性,同时向上弹性较大,是波段操作的重点大盘转债品种。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程,该债券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,827.28
2	应收证券清算款	5,007,083.33
3	应收股利	-
4	应收利息	5,282,322.18
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.07
8	其他	-
9	合计	10,336,479.86

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	11,136,000.00	4.10
2	110015	石化转债	10,797,000.00	3.98
3	110024	隧道转债	9,711,000.00	3.58
4	110020	南山转债	9,504,000.00	3.50
5	127001	海直转债	6,478,750.00	2.39
6	113005	平安转债	5,341,000.00	1.97
7	110012	海运转债	5,122,500.00	1.89
8	110011	歌华转债	5,069,000.00	1.87
9	127002	徐工转债	1,879,260.00	0.69
10	110022	同仁转债	1,143,800.00	0.42

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 基金份额变动

单位:份

	海富通稳进增利分级债券A	海富通稳进增利分级债券B
报告期期初基金份额总额	176,410,051.34	44,102,514.11
报告期期间总申购份额	-	-
减:报告期期间总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	176,410,051.34	44,102,514.11

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 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28只公募基金。截至2014年6月30日,海富通管理的公募基金资产规模为237亿元人民币。

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2014年6月30日,海富通为80多家企业超过311亿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2014年6月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模近54亿元。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。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。

2004年末开始,海富通为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2014年6月30日,投资咨询及海外业务规模超过215亿元人民币。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3月,国内权威财经媒体《中国证券报》等授予海富通基金管理有限公司"中国基金业金牛基金管理公司"大奖,《证券时报》授予 海富通精选混合基金"2011年中国基金业明星奖—五年持续回报平衡混合型明星基金"荣誉。2013年4月,《上海证券报》授予海富通精选混合基金2012年"金基金"奖——分红基金奖。

海富通同时还在不断践行其社会责任。公司自2008年启动"绿色与希望-橄榄枝公益环保计划",针对汶川震区受灾学校、上海民工小学、安徽老区小学进行了物资捐赠,向内蒙古库伦旗捐建了环保公益林。几年来,海富通的公益行动进一步升级,持续为上海民工小学学生捐献生活物资,并向安徽农村小学捐献图书室。此外,海富通还积极推进投资者教育工作,推出了以"幸福投资"为主题和特色的投资者教育活动,向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通稳进增利分级债券型证券投资基金的文件
(二)海富通稳进增利分级债券型证券投资基金基金合同
(三)海富通稳进增利分级债券型证券投资基金招募说明书
(四)海富通稳进增利分级债券型证券投资基金托管协议
(五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
(六)报告期内海富通稳进增利分级债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

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层本基金管理人办公地址。

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇一四年七月十九日

海富通现金管理货币市场基金

2014 第二季度 报告

2014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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十九日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月18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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	1,076,576,360.28份	
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。	
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	
下属两级基金的基金简称	海富通现金管理货币A	海富通现金管理货币B
下属两级基金的交易代码	519528	519529
报告期末下属两级基金的份额总额	102,488,650.64份	974,087,709.64份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日-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
1.本期已实现收益	56,344.40	3,325,621.10
2.本期利润	56,344.40	3,325,621.10
3.期末基金资产净值	102,488,650.64	974,087,709.64

注:(1)本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

(2)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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值收益率①	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
过去三个月	0.5769%	0.0028%	0.3349%	0.0000%	0.2420%	0.0028%

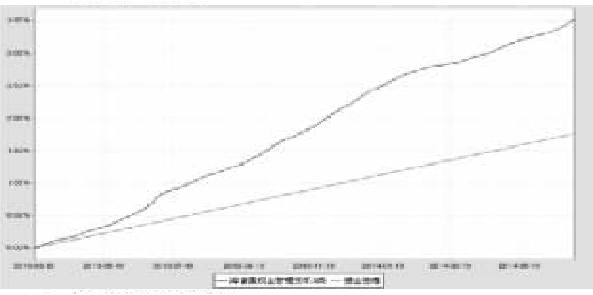
2.海富通现金管理货币B:

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.6366%	0.0028%	0.3349%	0.0000%	0.3017%	0.0028%

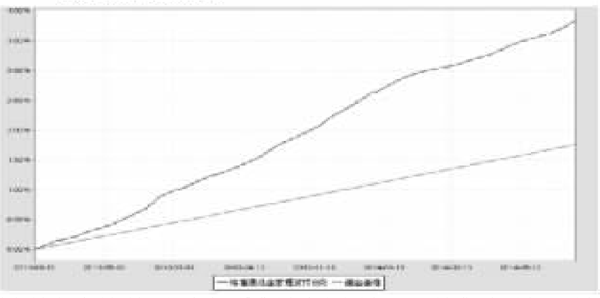
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通现金管理货币市场基金
份额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: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 基金经理(或基金经理小组)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	2013-3-13	-	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。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

进入二季度末,经济企稳的信号逐渐增多:中采和汇丰制造业PMI已经连续1个季度改善,且中采PMI环比强于历史同期环比均值,而5月汇丰PMI也重新回到枯荣线以上,录得50.8。但从分项来看,中采PMI主要分项仍全面弱于历史均值。5月当月工业增加值为8.8%,也暂时企稳。

中国央行控制力更强,流动性偏松基调不变。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,国内流动性稳中偏松基调不变。

二季度市场前半段资金面维持较为宽裕的状态,可能会有较大规模的申购与赎回,组合结合负债端管理,对新增申购款进行资产期限匹配,维持着较高流动性。步入6月,基金规模逐步增大,随着季末效应带来资金利率的上行,开展了协议存款、利率债等多元资产的配置,在维持流动性、安全性的背景下,以争取获得更高收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,A级基金净值收益率为0.5769%,同期业绩比较基准收益率为0.3349%;B级基金净值收益率为0.6366%,同期业绩比较基准收益率为0.3349%。

4.6 市场展望和投资策略

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,国内流动性稳中偏松基调不变。我们预计三季度的R007中枢位于3.5%以内,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偏松的预期。对于三季度而言,我们认为短端牛市格局比较明朗,首先基于经济基本面疲弱,反弹力度有限,利好整体债市,其次、通胀低位运行,近期无忧;第三是流动性宽松,央行定向宽松三季度可持续,预计R007价格中枢在3%-3.5%,基于以上短融收益率能够进一步下行,但下行空间小于上半年。

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。

§5 投资组合报告

5.1 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	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	其他资产	455,591,805.74	41.66
5	合计	1,093,682,562.70	100.00

5.2 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	-	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	1

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。

5.3.2 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	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	-	-
	合计	59.27	1.47

5.4 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	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	-	-

5.5 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	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

5.6 "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	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0055%
报告期内偏离度的最低值	-0.0033%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0013%

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

5.8.4 其他各项资产构成

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	1,741,122.94
4	应收申购款	453,850,682.80
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	455,591,805.74

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	海富通现金管理货币A	海富通现金管理货币B
报告期期初基金份额总额	10,999,310.97	35,061,995.84
报告期期间基金总申购份额	109,961,170.50	2,485,820,829.77
减:报告期期间基金总赎回份额	18,471,830.83	1,546,795,115.97
报告期期末基金份额总额	102,488,650.64	974,087,709.64

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 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28只公募基金。截至2014年6月30日,海富通管理的公募基金资产规模为237亿元人民币。

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2014年6月30日,海富通为80多家企业超过311亿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2014年6月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模近54亿元。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。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。

2004年末开始,海富通为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2014年6月30日,投资咨询及海外业务规模超过215亿元人民币。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3月,国内权威财经媒体《中国证券报》等授予海富通基金管理有限公司"中国基金业金牛基金管理公司"大奖,《证券时报》授予 海富通精选混合基金"2011年中国基金业明星奖—五年持续回报平衡混合型明星基金"荣誉。2013年4月,《上海证券报》授予海富通精选混合基金2012年"金基金"奖——分红基金奖。

海富通同时还在不断践行其社会责任。公司自2008年启动"绿色与希望-橄榄枝公益环保计划",针对汶川震区受灾学校、上海民工小学、安徽老区小学进行了物资捐赠,向内蒙古库伦旗捐建了环保公益林。几年来,海富通的公益行动进一步升级,持续为上海民工小学学生捐献生活物资,并向安徽农村小学捐献图书室。此外,海富通还积极推进投资者教育工作,推出了以"幸福投资"为主题和特色的投资者教育活动,向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通现金管理货币市场基金的文件
(二)海富通现金管理货币市场基金基金合同
(三)海富通现金管理货币市场基金招募说明书
(四)海富通现金管理货币市场基金托管协议
(五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
(六)报告期内海富通现金管理货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

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层本基金管理人办公地址。

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇一四年七月十九日