

一、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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2008年7月17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。
本报告期为2008年4月1日起至6月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

二、基金产品概况

1.基金简称：	海富通货币
2.基金代码：	A级:519056 B级:519066
3.基金运作方式：	契约型开放式
4.基金合同生效日：	2006年1月14日
5.报告期末基金份额总额：	A级基金份额:1,565,926,540.06份 B级基金份额:5,067,643,516.06份
6.投资目标：	在力保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。
7.投资策略：	（1）投资依据 根据投资策略选择合法、有效的方法和基金合同的规定； （2）投资品种是根据产品的特征决定不同投资策略的配比； （3）投资策略分析师、基金经理分析、定期分析各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。 2.操作程序 （1）整体配置策略 根据宏观经济指标，决定债券组合的剩余期限。根据债券的信用等级，决定组合的投资期限。 （2）类别资产配置策略 根据基金的类别资产，决定组合中类别资产的配置内容和各类别资产的比例。 3.投资管理方法 （1）利率策略 （2）收益率曲线策略 （3）期限配置策略 （4）久期策略 （5）流动性管理策略 （6）风险管理策略 （7）滚动配置策略 4.业绩比较基准： 税后一年期银行定期存款利率 5.风险收益特征： 货币市场基金是具有较低风险、流动性的证券投资基金品种。 6.基金管理人： 海富通基金管理有限公司 7.基金托管人： 中国银行股份有限公司

三、主要财务指标和基金净值表现

（一）主要财务指标	
1. 项目	A级 B级
1 本期利润(元)	10,176,570.06 29,214,460.21
2 期末基金份额净值(元)	1,565,926,540.06 5,067,643,516.06
3 期末基金份额总额(元)	10,000.00 10,000.00
4 本期份额收益率	0.0722% 0.0821%
5 五日平均收益率	0.9876% 0.9596%

注：（1）本基金收益分配是按月结转份额。
（2）上述基金业绩报酬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据。
在计算主要财务指标时，A级基金与分级前基金连续计算，B级基金自2008年8月1日开始计算。
（3）所列数据截止到2008年6月30日。

（二）本报告期收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

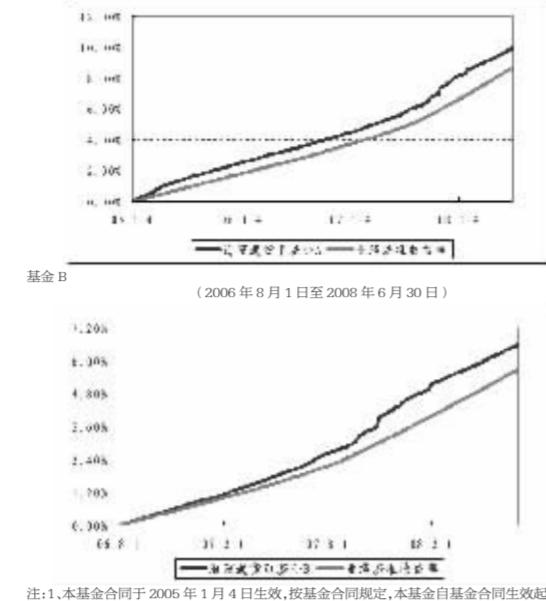
基金类别	阶段	基金净值增长率 标准差(1)	业绩比较基准 收益率(2)	业绩比较基准 标准差(3)	(1)-(3)	(2)-(4)
A级	过去3个月	0.0722% 0.0015%	0.0664% 0.0000%	0.0000%	-0.1842% 0.0015%	0.0015%
B级	过去3个月	0.0821% 0.0015%	0.0664% 0.0000%	0.0000%	-0.1243% 0.0015%	0.0015%

（三）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：

基金 A
(2005年1月4日至2008年6月30日)

海富通货币市场证券投资基金

2008年第二季度报告



基金 B
(2006年8月1日至2008年6月30日)

基金 B
(2006年8月1日至2008年6月30日)

准备金比例上调的可能性偏大；利率政策方面，下半年央行有加息的可能性，但是不存在大幅度加息可能，在目前的经济环境下，下半年央行将保持弱势整理格局，本基金将继续采用哑铃型配置策略，在有效管理流动性的条件下，增加配置央行票据品种，减少信用产品的投资比例。

（1）公平交易执行情况
公司自成立以来，就建立了公平交易制度，并通过系统控制和事前、事中、事后的监控确保公平交易制度严格执行。中国证监会于2008年3月20日颁布了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司根据该指导意见的具体要求，已完善现有的业务流程，建立了公平交易监控系统，并进行定期监控，以切实保护投资者的合法权益。

（2）同类交易公平性说明
根据公司制度，公司旗下无投资风格与本基金相似的其他基金。

（3）异常交易的专项说明
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。

五、投资组合报告

（一）报告期末基金资产组合情况

资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
债券投资	5,267,628,466.00	78.84
买入返售证券	1,151,282,166.92	17.23
其中：买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00
资产支持证券	0.00	0.00
银行存款和结算备付金合计	77,906,873.55	1.16
其他资产	0.00	0.00
合计	6,884,824,634.56	100.00

（二）报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资本金额	3,328,143,065.62	0.81
2	其中：买断式回购融资本金额	0.00	0.00
3	报告期内债券回购融资本金额最高值	1,151,282,166.92	0.00
4	报告期内债券回购融资本金额最低值	0.00	0.00
5	报告期内债券回购融资本金额平均值	643,280,787.00	0.00
6	报告期内债券回购融资本金额浮动利率值	270,057,770.00	0.00
7	报告期内债券回购融资本金额浮动利率平均值	245,534,881.76	0.00
8	报告期内债券回购融资本金额浮动利率最低值	199,964,907.58	0.00
9	报告期内债券回购融资本金额浮动利率最高值	199,421,902.72	0.00
10	报告期内债券回购融资本金额浮动利率平均值	197,943,907.58	0.00

注：上表中“债券回购”中的“自有资金”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券投资所对应的金额。

（五）“影子定价法”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

报告期内偏离度的绝对值在0.2%以内—0.5%的次数 0

报告期内的最高偏离 0.2457%

报告期内的最低偏离 0.1094%

报告期内的平均偏离度的绝对值的简单的平均值 0.1888%

注：以上数据仅为部分机构的统计结果。

（六）以上数据仅供参考

（七）投资组合报告附注

2008年1月1日至3月31日期间持有的债券投资组合在报告期内按公允价值进行摊余成本法进行摊余成本法核算，按摊余成本法或定期利率并考虑其购买时的溢价与折价，在其余期间按摊余成本法或浮动利率法进行摊余成本法核算，每日计价。

2.本报告期内不存在剩余期限小于377天但剩余到期期限超过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.本报告期内没有新的证明的证据表明投资决策和招募说明书进行，所有投资品种均没有超出投资

品种的范围，没有特别说明的补充的。

4.其他资产的构成

序号 项目 其他资产 金额(元)

1 交易保证金 0.00

2 待估值证券 0.00

3 应收申购款 35,249,015.93

4 应收申购款 149,575,562.97

5 其他应收款 0.00

6 待摊费用 0.00

7 其他 0.00

合计 184,824,634.56

5.报告期内本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.开放式基金份额变动

序号 项目 A级 B级

1 本报告期初基金份额总额 1,492,410,767.18

2 本报告期基金份额申购额 8,409,010,629.09

3 本报告期基金份额赎回额 2,312,025,273.97

4 本报告期基金份额总额 1,565,924,540.66

5.报告期内的平均剩余期限

注：上表中“债券回购”中的“自有资金”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券投资所对应的金额。

（八）报告期末支持证券市值占基金净资产的比例以及按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

项目 偏离情况

1.基金定价方法说明

2.报告期末支持证券市值占基金净资产的0.2457%的次数 0

3.报告期内的最高偏离 0.2457%

4.报告期内的最低偏离 0.1094%

5.报告期内的平均偏离度的绝对值的简单的平均值 0.1888%

注：以上数据仅为部分机构的统计结果。

（九）以上数据仅供参考

（十）报告期末支持证券市值占基金净资产的比例以及按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

项目 偏离情况

1.基金定价方法说明

2.报告期末支持证券市值占基金净资产的0.2457%的次数 0

3.报告期内的最高偏离 0.2457%

4.报告期内的最低偏离 0.1094%

5.报告期内的平均偏离度的绝对值的简单的平均值 0.1888%

注：以上数据仅为部分机构的统计结果。

（十一）报告期末支持证券市值占基金净资产的比例以及按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

项目 市值(人民币)(元) 市值占净值比例

国债 240,240,000.00 73.89%

金融债券 0.00 0.00%

央行票据 0.00 0.00%

企业债 80,669,000.00 2.65%

债券组合合计 320,909,000.00 105.4%

（十二）报告期末按券种分类的债券投资组合