海富通货币市场证券投资基金

更新招募说明书摘要

基金管理人:海富通基金管理有限公司　基金托管人:中国银行股份有限公司

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。

重要提示

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2008年6月30日,有关财务数据和净值表现截止日为2008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:上海浦东新区世纪大道88号金茂大厦37楼

办公地址:上海浦东新区世纪大道88号金茂大厦37楼

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:包瑶

注册资本:1.5亿元

股权结构:海通证券股份有限公司51%、富通基金管理公司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。1997年至今任富通基金管理公司董事总经理。

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。

董文标先生,独立董事,硕士。历任交通银行郑州分行党委书记、行长,中国民生银行党委委员、副行长,中国民生银行党委书记、行长,现任中国民生银行董事长、党委书记。

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,现任商学院署理院长。

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,EFAMA(欧洲基金和资产管理协会)和比利时基金公会名誉主席,INVESTPROTECT公司(布鲁塞尔)董事总经理、Pionner投资公司(米兰,都柏林,卢森堡)和Degroof资产管理(布鲁塞尔)独立董事,基金联合公会(哥本哈根)独立董事长。

杨国平先生,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,现任上海大众交通(集团)股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用(集团)股份有限公司董事长。

李础前先生,监事长,经济学硕士,高级经济师。历任安徽省社联所属省新科技发展公司副总经理、海通证券计划财务部总经理、海通证券财务总监。

余毓繁先生,英籍华人,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。现任富通银行亚洲区行政总裁。

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基金基金经理,2007年4月至2007年8月任海富通精选或号基金经理,2008年6月起任海富通海外基金经理。

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,经济学学士学位,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市场基金经理。

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;蒋征,股票组合管理部总监;郭杰,股票组合管理部总监;邵佳民,固定收益组合管理部总监;牟永宁,研究总监;戴德舜,研究总监;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:人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

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:董杰

托管部门联系人:宁敏

电话:(010)66594977

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:上海浦东新区世纪大道88号金茂大厦37楼

办公地址:上海浦东新区世纪大道88号金茂大厦37楼

法定代表人:邵国有

电话:021-38650999

联系人:喻群

客户服务中心电话:021-38784858或40088-40099

公司网址:www.htfund.com

2. 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

网址:www.boc.cn

电话:010-66596688

传真:010-66593777

客户服务电话:95566

联系人:客户服务中心

(2)中国建设银行股份有限公司

地址:北京市西城区金融大街25号

法定代表人:郭树清

客户服务电话:95533

联系人:王琳

(3)中国工商银行股份有限公司

地址:中国北京复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

客户服务电话:95588

传真:010-66107914

联系人:田耕

(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:蒋超良

客户服务电话:95559

电话:021-58781234

联系人:曹榕

(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:秦晓

电话:(0755)82090060

客户服务电话:95555

联系人:刘薇

(6)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:潘铃

(7)深圳发展银行

地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人:法兰克纽曼(Frank Neil Newman)

客户服务电话:95501

电话:0755-82088888

联系人:周勤

(8)上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号

法定代表人:金运

电话:021-61618888

联系人:徐伟、汤嘉惠

(9)广东发展银行股份有限公司

注册地址:广州市农林下路83号

法定代表人:李若虹

电话:020-38323704、38322730、38323206

联系人:江璐、罗环宇

(10)中国民生银行股份有限公司

地址:北京市东城区正义路4号

法定代表人:经叔平

客户服务电话:95568

电话:010-58560666

联系人:李群

(11)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

电话:021-23219000

联系人:金芸

(12)中信证券股份有限公司

地址:北京朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人:王东明

电话:010-84864818

联系人:陈忠

(13)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:祝幼一

电话:021-62580818

联系人:芮敏祺

(14)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:谢平

电话:021-54033888

联系人:邓寒冰

(15)中信建投证券有限责任公司

地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:黎晓宏

电话:010-65183888

联系人:权唐

(16)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

电话:0755-82943511

联系人:黄健

(17)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

电话:021-68419974

联系人:杨盛芳

(18)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

电话:025-84457777

联系人:张小波

(19)长江证券股份有限公司

地址:武汉市新华下路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

电话:4008-888-999或027-85808318

联系人:李良

(20)广发证券股份有限公司

地址:广州天河北路大都会广场36、38、41和42楼

法定代表人:王志伟

电话:020-87555888-875

联系人:肖中梅

(21)东方证券股份有限公司

地址:上海市浦东大道720号20楼

法定代表人:王益民

电话:021-62476600

联系人:盛云

(22)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

法定代表人:何如

电话:0755-82130833

联系人:林建闽

(23)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:马国强

电话:0755-82493561

联系人:盛宗凌

(24)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:肖时庆

电话:(010)66568587

联系人:李洋

(25)平安证券有限责任公司

地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人:叶黎成

电话:0755-82262888

联系人:袁月

(26)中信万通证券有限责任公司

地址:青岛市市南区东海路28号

法定代表人:史浩民

电话:0532-85023905

联系人:李锦

(27)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

电话:021-68816000

联系人:刘晨

(28)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:平岳

电话:021-68604866

联系人:张静

(29)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:段强

电话:0755-83199511

联系人:刘军辉、王飞

(30)财通证券经纪有限责任公司

地址:杭州市解放路111号财通证券

法定代表人:陈海晓

电话:(0571)87925137

联系人:张帆

(31)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

电话:010-84533151-822

联系人:陈少震

(32)中信金通证券有限责任公司

地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

法定代表人:刘军

电话:0571-85783750

联系人:王勤

(33)国海证券有限责任公司

地址:广西南宁市滨湖路46号

法定代表人:张雅峰

电话:0771-5539262

联系人:覃清芳

(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:李树

电话:0431-5096710

联系人:潘锴

(35)恒泰证券有限责任公司

地址:内蒙古呼和浩特市新城区东风路111号

法定代表人:李庆阳

电话:021-68405273

联系人:张同亮

(36)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

电话:010-5922-6788

联系人:谢亚凡、韩晓光

(37)江南证券有限责任公司

地址:江西省南昌市抚河北路291号

法定代表人:姚江涛

电话:0791-6768763

联系人:余雅娜

(38)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

电话:0551-96888

联系人:朱广军

(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:北京西城区金融大街27号投资广场22层

法定代表人:陈耀先

电话:010-58598835

传真:010-58598907

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39号建外SOHO A座31层

负责人:王玲

电话:010-58785588

传真:010-58785599

联系人:宋萍萍

联系电话:0755-82125533

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:上海市浦东新区东昌路568号

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法人代表:杨绍信

电话:021-61238888

传真:021-61238800

联系人:陈兆欣

经办注册会计师:肖峰 陈玲

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2008年7月28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2008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

资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
债券投资	5,267,628,466.80	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
银行存款和清算备付金合计	77,906,873.55	1.16
其中:定期存款	0.00	0.00
其他资产	184,824,634.56	2.77
合计:	6,681,642,141.83	100.00

2.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余额	3,328,143,056.52	0.81
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00
2	报告期末债券回购融资余额	0.00	0.00
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00

注:上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,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日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。本报告期内无货币市场基金正回购的资金余额超过资产净值的20%的情况。

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	168
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	176
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	112

(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	33.44	0.00
2	30天(含)—60天	2.70	0.00
3	60天(含)—90天	0.00	0.00
4	90天(含)—180天	7.59	0.00
5	180天(含)—397天(含)	54.21	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.83	0.00
合　计		97.94	0.00

4.报告期末债券投资组合

(1)按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	0.00	0.00
2	金融债券	1,086,914,974.92	16.38
	其中:政策性金融债	898,971,067.34	13.55
3	央行票据	1,211,652,778.79	18.27
4	企业债券	2,969,060,713.09	44.76
5	其他	0.00	0.00
合计		5,267,628,466.80	79.41
剩余存续期超过397天的浮动利率债券		187,943,907.58	2.83

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

(2)基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张)		成本(元)	占基金资产净值比例(%)
		自有投资	买断式回购		
1	08电网CP01	5,000,000	0.00	501,995,007.80	7.57
2	08央行票据42	5,000,000	0.00	499,584,517.87	7.53
3	07进出12	4,500,000	0.00	449,248,383.73	6.77
4	08铁道CP01	3,000,000	0.00	300,197,920.53	4.53
5	08云铜CP01	2,700,000	0.00	270,857,770.68	4.08
6	07央票139	2,500,000	0.00	245,534,881.76	3.7
7	08酒钢CP01	2,000,000	0.00	201,191,513.25	3.03
8	08进出02	2,000,000	0.00	199,964,078.48	3.01
9	08央行票据31	2,000,000	0.00	194,421,902.72	2.93
10	04建行03浮	1,900,000	0.00	187,943,907.58	2.83

上表中,“债券数量”中的“自有投资”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卖出后的余额。

5.“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
报告期内偏离度的最高值	0.2497%
报告期内偏离度的最低值	0.1084%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1858%

注:以上数据按工作日统计

6. 报告期末资产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

无。

7.投资组合报告附注

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。

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)本报告期内需说明的证券投资决策程序。

报告期内,基金管理人的投资决策严格按照招募说明书和基金合同进行,所有投资品种均没有超出债券池的范围,没有需要特别说明和补充的部分。

4)其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	35,249,081.59
4	应收申购款	149,575,552.97
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。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2008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%
2008.1.1-2008.6.30	1.6404%	0.0050%	1.9421%	0.0000%	-0.3017%	0.0050%

海富通货币基金B

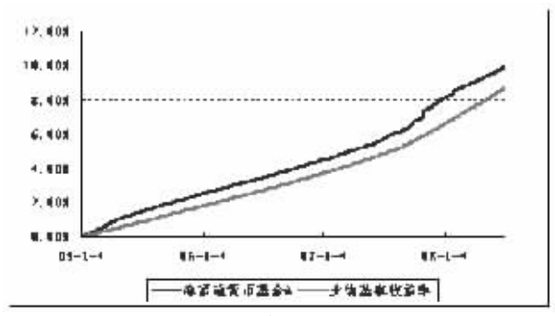
阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2006.8.1-2006.12.31	0.9344%	0.0036%	0.8296%	0.0002%	0.1048%	0.0034%
2007.1.1-2007.12.31	3.7454%	0.0090%	2.7827%	0.0018%	0.9627%	0.0072%
2008.1.1-2008.6.30	1.7608%	0.0050%	1.9421%	0.0000%	-0.1813%	0.0050%

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:

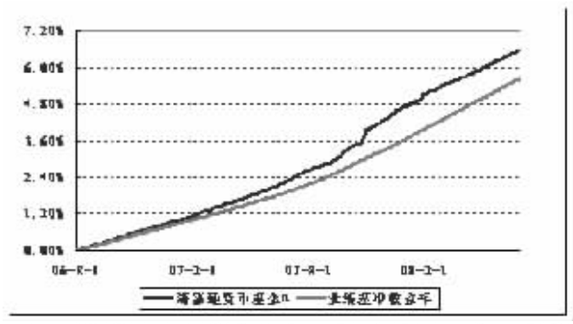
海富通货币基金A

(2005年1月4日至2008年6月30日)



海富通货币基金B

(2006年8月1日至2008年6月30日)



注(1):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×0.33%÷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×0.1%÷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×R÷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)“第三节、基金管理人”部分

1.增加了基金经理张丽洁女士的简历,并删除了原基金经理邵佳民先生的简历。

2.对郑国汉先生、巴约特(Marc Bayot)先生、李础前先生、奚万荣先生和陈洪先生的简历进行了更新。

3.对投资决策委员会的组成名单进行了更新。

(二)“第四节、基金托管人”部分,对其所有内容进行了更新。

(三)“第五节、相关服务机构”部分:

代销机构:新增中国建设银行、中国民生银行、瑞银证券、江南证券、国元证券及相关信息。并分别对兴业银行、中信证券、申银万国证券、华泰证券、长江证券、银河证券、光大证券、中信金通证券和东北证券的相关信息予以更新。

(四)“第十一节、基金的投资”和“第十二节、基金的业绩”部分:

根据2008年第二季度季报,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2008年6月30日。

特此说明。

海富通基金管理有限公司

二〇〇八年八月十五日

融通易支付货币市场证券投资基金收益支付公告

融通易支付货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)基金合同于2006年1月19日生效,根据《融通易支付货币市场证券投资基金基金合同》和《融通易支付货币市场证券投资基金招募说明书》等的约定,本基金管理人定于2008年8月15日对本基金自2008年7月15日至2008年8月14日的收益进行集中支付并结转为基金份额,现将有关具体事宜公告如下:

一、收益支付说明

本基金管理人定于2008年8月15日对本基金自2008年7月15日至2008年8月14日的累计收益进行集中支付,并按1元面值直接结转为基金份额,不进行现金支付。

投资者的累计收益具体计算公式如下:

投资者累计收益=∑投资者日收益(即投资者日收益逐日累加)

投资者日收益=投资者当日持有的基金份额/基金份额总额*(当日基金净收益+上一工作日未分配收益)(保留到分,即保留两位小数后去尾,去尾形成的余额进行再次分配。)

二、收益支付时间

1、收益支付日:2008年8月15日;

2、收益结转基金份额日:2008年8月15日;

3、收益结转的基金份额可赎回起始日:2008年8月18日。

三、收益支付对象

收益支付日本基金份额全体持有人。

四、收益支付办法

本基金收益支付方式默认为收益再投资方式, 投资者收益结转的基金份额将于2008年8月15日直接计入其基金账户,2008年8月18日起可查询及赎回。

五、有关税收和费用的说明

1、根据财政部、国家税务总局《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税字[2002]128号),对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税;

2、本基金本次收益分配免收分红手续费和再投资手续费。

六、提示

1、投资者于2008年8月15日申购的基金份额不享有当日收益,赎回的基金份额享有当日收益;

2、本基金投资者的累计收益定于每月15日集中支付并按1元面值自动转为基金份额。若该日为非工作日,则顺延到下一工作日。

七、咨询办法

1、融通基金管理有限公司网站:www.rtfund.com;

2、融通基金管理有限公司客户服务电话:0755-26948088、4008838088;

3、直销机构:

深圳投资理财中心:0755-26948040、26948044

北京分公司:010-66190999转0975

上海分公司:021-38424888转4882

4、代销机构:

各代销机构及其联系方式可登陆融通基金管理有限公司网站进行查询。

特此公告。

融通基金管理有限公司

2008年8月15日

申万巴黎基金管理有限公司
关于申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付的公告

(2008年第8号)

申万巴黎收益宝货币市场基金(以下简称“本基金”)基金合同于2006年7月7日生效。根据《申万巴黎收益宝货币市场基金合同》的规定,经本基金管理人申万巴黎基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)计算,本基金管理人定于2008年8月18日对本基金自2008年7月18日起的收益进行集中支付并自动结转为基金份额,不进行现金支付。现将有关具体事宜公告如下:

一、收益支付说明

本基金管理人定于2008年8月18日将基金份额持有人所拥有的自2008年7月18日起至2008年8月17日止的累计收益进行集中支付,并按1.00元的份额面值自动结转为基金份额,不进行现金支付。

投资者的累计收益具体计算公式如下:

份额持有人的累计收益=∑Ri(i为日期,即份额持有人的日收益逐日累加)

份额持有人的日收益Ri=[份额持有人(i-1)日的持有份额余额+份额持有人(i-1)日的累计未支付收益]×基金i日的每万份净收益/10000(计算精度为0.01元,小数点后第3位采取去尾原则,因去尾形成的余额进行再次分配,直到分完为止。)

二、收益支付时间

1、收益支付日:2008年8月18日;

2、收益结转基金份额日:2008年8月18日;

3、收益结转的基金份额,份额持有人可赎回起始日:2008年8月19日。

三、收益支付对象

收益支付日的前一个工作日在本基金管理人登记注册的本基金份额持有人。

四、收益支付办法

本基金收益支付方式为收益再投资