

海富通货币市场证券投资基金 2005 年半年度报告摘要

第一节 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。本半年度报告已经董事会全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

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 2005 年 8 月 10 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告期间:2005 年 1 月 4 日-2005 年 6 月 30 日,本报告财务资料未经审计。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,报告正文同时登载于基金管理人网站(<http://www.hftfund.com>)。投资者欲了解详细内容,应仔细阅读半年度报告正文。

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。

第二节 基金简介

一、 基金简称:海富通货币

交易代码:510005

运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2005 年 1 月 4 日

报告期末基金份额总额:2,726,749,669.28 份

二、 基金投资目标: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。

业绩比较基准:税后一年期银行定期存款利率。

风险收益特征:本货币市场基金是具有较低风险、流动性强的证券投资基金品种。

三、 基金管理人:海富通基金管理有限公司

信息披露负责人:奚万荣

联系电话:021-50471758-591

传真:021-50479057

电子邮箱:wrxi@hftfund.com

四、 基金托管人:中国银行股份有限公司

信息披露负责人:忻如国

联系电话:010-66594856

传真:010-66594853

电子邮箱:tgxxpl@bank-of-china.com

五、 登载本报告正文的基金管理人互联网网址:<http://www.hftfund.com>

本报告置备地点:基金管理人及基金托管人的住所

第三节 主要财务指标和基金净值表现

一、 主要财务指标

1. 基金本期净收益(人民币元) 30,301,366.71
2. 期末基金资产净值(人民币元) 2,726,749,669.28
3. 期末基金份额净值(人民币元) 1.0000
4. 本期净值收益率(按月结转) 1.4783%
5. 累计净值收益率(按月结转) 1.4783%

注：1、以上财务指标中"本期"指 2005 年 1 月 4 日(基金合同生效日)至 2005 年 6 月 30 日止期间。

2、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(例如,基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

二、 基金净值表现

1、历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较:

阶段	基金净值收益率	基金净值收益率标准差	基金净值收益率标准差	比较基准收益率	比较基准收益率标准差
过去 1 个月	0.1880%	0.0042%	0.1469%	0.0000%	0.0411%
过去 3 个月	0.6236%	0.0041%	0.4468%	0.0000%	0.1768%
自基金合同生效起至今	1.4783%	0.0084%	0.8778%	0.0000%	0.6005%

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：

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。

注(2)：本基金合同生效未满一年。

第四节 管理人报告

一、 基金管理人及基金经理情况

(一) 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于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。本海富通货币市场证券投资基金是基金管理人管理的第三只开放式基金；除本基金外,基金管理人目前还管理着另外二只开放式基金--海富通精选证券投资基金和海富通收益增长证券投资基金。

(二) 基金经理简介

邵佳民先生,基金经理,硕士学位,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,海富通基金管理有限公司固定收益分析师。2005 年 1 月至今担任海富通货币市场基金基金经理。

二、 报告期内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》及其配套规则、《海富通货币市场证券投资基金基金合同》、《海富通货币市场证券投资基金招募说明书》和其他相关法律法规的规定,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。

三、 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

2005 年上半年,债券市场经历总体上处于快速上涨过程。商业银行、保险公司、证券投资基金等机构投资者对债券的需求大幅度增加,而债券供给未能保持同步,债券市场整体上需求大于供给,其价格也不断上扬。中国人民银行降低超额存款准备金利率后,金融机构持有债券的机会成本降低,短期债券作为流动性管理工具的特点更加突出,收益率不断下降;宏观经济的变化,使投资者对中长期债券的需求增加,其价格也持续上涨。债券投资的回报基本与久期成正比,吸引大量场外资金进入债券市场。市场普遍认为,2005 年上半年债券市场的行情,是基本面改善与资金推动的共同结果。

本基金管理人高度重视投资组合的安全性及流动性,利用年初成立时债券收益率处于较高水平的机会,加快建仓速度,购买了一批收益率优良、流动性好的债券。基金管理人判断上半年市场的资金供应会相当充足,市场的整体流动性较好,因此适当地延长了组合久期,以提高收益。在超额存款准备金利率降低导致组合浮动盈利增加时,为维护基金持有人的利益,本基金及时兑现了一部分盈利。

2005 年上半年,基金的净值收益率为 1.4783%,高于业绩比较基准 0.6005%。基金规模稳定增加,持有人结构亦不断改善。

四、 简要展望

基金管理人认为,2005 年下半年市场整体格局不会发生大的变化,债券市场的资金供给仍十分充沛,更多的投资者将被吸引到债券市场中。由于短期内资金进入较多,债券收益率下降速度较快,收益率也可能发生一定的波动。债券市场的不确定性之一可能来自对人民币汇率变革的预期。总体上我们仍谨慎看好下半年的债券市场。

同时下半年市场将推出更多的投资新品种和交易方式,货币市场基金的投资渠道增加。由于市场预期相对一致,基金获取超额收益的难度提高。基金管理人仍将继续高度重视组合的流动性和安全性,适当地降低组合的流动性风险,加大对信用产品的研究分析,力争为持有人带来良好的回报,提供优质的服务。

第五节 托管人报告

本托管人依据《海富通货币市场证券投资基金基金合同》与《海富通货币市场证券投资基金托管协议》,自 2005 年 1 月 4 日起托管海富通货币市场证券投资基金(以下称"海富通货币市场基金"或"本基金")的全部资产。现根据《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》、《货币市场基金管理暂行办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 3 号<半年度报告的内容与格式>》及其他相关规定,出具本托管人报告。

1、本托管人在托管海富通货币市场基金期间,严格遵守《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》和其他有关法规、基金合同以及托管协议的规定,诚信地履行了基金托管人的职责,不存在损害海富通货币市场基金持有人利益的行为。

(1)本托管人履行安全保管基金资产的全部资产的职责,保证基金资产与自有资产等非基金资

产严格分开,维护基金的独立账户,与本托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行了严格的分账管理。严格复核从基金资产中列支的各项费用和基金的应得利益,确保基金资产的完整。

(2)本托管人严格根据相关法律法规、基金合同的规定执行基金管理人的投资指令,及时、准确地完成了本基金的各项资金清算交割。本托管人对于本基金的任何资产的运用、处分和分配,均具备正当依据。

(3)本托管人对与基金资产相关的重大合同原件、因履行基金托管人职责而生成或收悉的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

2、本托管人在 2005 上半年度依照《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》和其他有关法规、《海富通货币市场证券投资基金基金合同》及《海富通货币市场证券投资基金托管协议》对海富通基金管理有限公司--海富通货币市场基金管理人的基金运作进行了必要的监督。

(1)其在基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面遵守了《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》、《证券投资基金会计核算办法》和其他有关法规、基金合同以及托管协议的规定;未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

(2)其对于基金份额的认购、申购、赎回等重要事项的安排符合基金合同等有关法律文件的规定。

(3)本托管人如实、及时、独立地向中国证监会提交了关于海富通货币市场基金投资运作方面的报告。

3、本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整。

中国银行股份有限公司

2005 年 8 月 10 日

第六节 财务会计报告

一、 半年度会计报表

(一) 资产负债表

2005 年 6 月 30 日资产负债表
(除特别注明外,金额单位为人民币元)

2005 年	
附注	6 月 30 日
资产	
银行存款	135,158,298.22
清算备付金	14,117,747.87
应收证券清算款	-
应收利息	1 1,266,004.88
应收申购款	15,964,174.20
其他应收款	-
债券投资市值	1,946,238,188.84
其中:债券投资成本	1,946,238,188.84

买入返售证券	633,000,000.00
待摊费用	-
资产总计	2,745,744,414.01

负债及持有人权益

负债

应付证券清算款	-
应付赎回款	14,867,563.05
应付赎回费	1,075.00
应付管理人报酬	734,114.42
应付托管费	222,458.93
应付销售费	692,881.58
应付佣金	2 -46,128.00
应付利息	-
应付收益	2,312,255.87
其他应付款	3 37,200.00
卖出回购证券款	-
预提费用	4 173,323.88
负债合计	18,994,744.73

持有人权益

实收基金	5 2,726,749,669.28
未实现利得	-
未分配基金净收益/(累计基金净损失)	-
持有人权益合计	2,726,749,669.28

(2005年6月30日每单位基金资产净值：1.0000元)

负债及持有人权益总计 2,745,744,414.01

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(二) 经营业绩表、收益分配表

2005年半年度经营业绩、收益分配表 (除特别注明外,金额单位为人民币元)

附注	2005.1.4(基金合同生效日)-2005.6.30
收入	
债券差价收入/(损失)	6 12,908,844.25
债券利息收入	21,195,136.15
存款利息收入	1,790,568.45
买入返售证券收入	2,274,271.20
其他收入	7 6.93

收入合计	38,168,826.98	
费用		
基金管理人报酬	3,416,290.01	
基金托管费	1,035,239.47	
基金销售费	2,588,098.50	
卖出回购证券支出	507,615.57	
利息支出		-
其他费用	8 320,216.72	
其中:信息披露费	131,121.92	
审计费用	37,701.96	
费用合计	7,867,460.27	
基金净收益	30,301,366.71	
加:未实现估值增值/(减值)变动数		-
基金经营业绩	30,301,366.71	
基金净收益	30,301,366.71	
加:年/(期)初基金净收益		-
本年/(期)申购基金份额的损益平准金		-
本年/(期)赎回基金份额的损益平准金		-
可供分配基金净收益	30,301,366.71	
减:本年/(期)已分配基金净收益	9 30,301,366.71	
期末基金未分配净收益		-

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(三) 基金净值变动表

2005 年半年度基金净值变动表
(除特别注明外,金额单位为人民币元)

2005.1.4(基金合同生效日)-2005.6.30

年/(期)初基金净值	964,512,079.20
本年/(期)经营活动	
基金净收益	30,301,366.71

未实现估值增值/(减值)变动数		-
经营活动产生的基金净值变动数	30,301,366.71	
本年/(期)基金份额交易		
基金申购款	5,112,154,014.70	
基金赎回款	3,349,916,424.62	
基金份额交易产生的基金净值变动数	1,762,237,590.08	
本年/(期)向基金份额持有人分配收益		
向基金份额持有人分配收益产生的基金	净值变动数	30,301,366.71
年/(期)末基金净值	2,726,749,669.28	

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

二、 半年度会计报表附注

(一) 基金基本情况

海富通货币市场证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监基金部【2005】1号《关于同意海富通货币市场证券投资基金设立的批复》核准募集设立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司;有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案;基金合同于2005年1月4日生效,该日的基金份额总额为964,512,079.20份基金单位。

(二) 会计政策、会计估计

主要会计政策、会计估计及其变更

1. 编制基金会计报表所遵循的主要会计制度及其他有关规定

本基金的会计报表按《证券投资基金会计核算办法》编制,会计报表披露的方式则是根据中国证券监督管理委员会颁布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金信息披露管理办法》、证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号《半年度报告的内容与格式》、证券投资基金信息披露编报规则第3号《会计报表附注的编制及披露》、证券投资基金信息披露编报规则第4号《基金投资组合报告的编制及披露》及中国证券监督管理委员会颁布并于2005年4月1日起实施的证券投资基金信息披露编报规则第5号《货币市场基金信息披露特别规定》进行编制及披露。

2. 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本半年度会计报表的实际编制期间为2005年1月4日(基金合同生效日)至2005年6月30日。

3. 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

4. 记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。债券投资采用摊余成本法计价,同时按公允价值进行估值监控。除此之外,所有报表项目均以历史成本计价。

5. 基金资产的估值原则

本基金的债券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金资产持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行重新评估,即"影子定价"当"影子定价"确定的基金资产净值与"摊余成本法"计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过 0.25%时,基金管理人将根据风险控制的需要调整组合。

如有确凿证据表明按上述方法进行计价不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法计价。

6. 证券投资的成本计价方法-债券投资

买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按交易日应支付的全部价款入账,其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本。买入贴现央行票据和零息债券无需单独核算应收利息。

卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

7. 待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用核算已经发生的、大于基金资产净值十万分之一,应分摊计入本期和以后各期的费用,如信息披露费、审计师费、律师费用等,待摊费用在实际发生时入账,在受益期内平均摊销。

预提费用核算预计将发生的、大于基金净值十万分之一,应预提计入本期的费用,如信息披露费、审计费用和律师费用等,预提费用在预计发生时入账。

8. 收入的确认和计量

、银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

、债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额,并根据买入债券时溢价与折价的摊销数调整后的金额确认,在债券实际持有期内逐日计提。

、存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

、买入返售证券收入按融出资金额及约定利率,在证券持有期内采用直线法逐日计提。

9. 费用的确认和计量

基金管理人报酬

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率逐日计提。

基金托管费

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率逐日计提。

基金销售费

本基金的基金销售费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率,在回购期限内采用直线法逐日计提。

10. 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

11. 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金以单位面值 1.00 元固定单位净值交易方式,每日进行收益分配,并计入投资者帐户的当前累计收益中,按月将投资人账户的当前累计收益结转为基金份额。

12. 重大会计差错的内容和更正金额：无。

13. 税项

营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围,不征收营业税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》,自 2004 年 1 月 1 日起,对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税。

个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,对基金取得的债券利息收入,由债券发行企业在向基金派发债券的利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税

印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,基金管理人运用基金买卖股票按照 2‰的税率征收印花税。

根据财税[2005]11 号文《财政部、国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》,从 2005 年 1 月 24 日起证券(股票)交易印花税税率由现行的 2‰调整为 1‰。

(三) 本报告期无重大会计差错。

(四) 关联方关系及关联方交易

1. 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 基金管理人、基金销售机构

中国银行股份有限公司("中国银行")(1) 基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司("海通证券") 基金管理人的股东、基金代销机构
富通基金管理公司

(Fortis Investment Management S.A.) 基金管理人的股东

(1) 中国银行股份有限公司由中国银行整体改建而成,于 2004 年 8 月 26 日依法成立,并自成立之日起完整承继中国银行的资产、负债和所有业务。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 关联方交易

通过关联方席位进行的交易：

2005 年 1 月 4 日(基金合同生效日)至 2005 年 6 月 30 日

回购成交量 交易佣金

成交量 占本期总成交 佣金 占本期佣金

人民币元 量的比例 人民币元 总数的比例

海通证券	5,139,000,000.00	100.00%	-51,390.00
	100.00%		

注：交易佣金均为本基金为券商代垫的结算风险金。

3. 基金管理人报酬

支付基金管理人海富通基金管理有限公司的基金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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

本基金在 2005 年 1 月 4 日(基金合同生效日)至 2005 年 6 月 30 日止期间需支付基金管理人报酬 3,416,290.01 元。

4. 基金托管人报酬

支付基金托管人中国银行股份有限公司的基金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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

本基金在 2005 年 1 月 4 日(基金合同生效日)至 2005 年 6 月 30 日止期间需支付基金托管费 1,035,239.47 元。

5. 基金销售服务费

支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提, 逐日累计, 按约定支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日基金销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数

本基金在 2005 年 1 月 4 日(基金合同生效日)至 2005 年 6 月 30 日止期间需支付基金销售服务费 2,588,098.50 元。

6. 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管,并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2005 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 135,158,298.22 元。2005 年 1 月 4 日(基金合同生效日)至 2005 年 6 月 30 日止期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 1,744,866.16 元。

本基金用于证券交易结算的资金通过"中国银行股份有限公司基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,相关余额 14,117,747.87 元,计入清算备付金科目。

7. 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本基金在本报告期内与基金托管人中国银行股份有限公司通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

2005 年 1 月 4 日(基金合同生效日)至 2005 年 6 月 30 日

买入债券结算金额 1,248,175,660.28

卖出债券结算金额 4,881,554,861.11

卖出回购证券协议金额 -

买入返售证券协议金额 -

本基金在本报告期内与其他关联方之间没有通过银行间同业市场进行的债券交易。

(五) 报告期末流通转让受到限制的基金资产

本基金截至 2005 年 6 月 30 日无流通受限制基金资产。

第七节 投资组合报告

一、 报告期末基金资产组合情况

资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
债券投资	1,946,238,188.84	70.88
买入返售证券其中：买断式回购的买入返售证券	633,000,000.00	23.05
-	-	-
银行存款和清算备付金合计	149,276,046.09	5.44
其他资产	17,230,179.08	0.63
合 计	2,745,744,414.01	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余额 11,964,770,000.00 2005.1.4----2005.3.31
2005.4.1----2005.6.30
5.75% 2.49%

其中：买断式回购融入的资金 - - -

2 报告期末债券回购融资余额 - -

其中：买断式回购融入的资金 - -

注：1、2005年1月4日(基金合同生效日)至2005年3月31日间,本基金在全国银行间市场债券正回购的资金余额均不超过基金资产净值的40%。

2、2005年4月1日至2005年6月30日间,本基金在全国银行间市场债券正回购的资金余额均不超过基金资产净值的20%。

三、 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 137

分段列示报告期内投资组合平均剩余期限 2005.1.4----2005.3.31 2005.4.1----2005.6.30

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 176 175

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 100 54

注：本报报告期内,本基金投资组合的平均剩余期限在每工作日均未超过180天。

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 28.69 -

2 30天(含)-60天 - -

3 60天(含)-90天 10.97 -

其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 7.31 -

4 90天(含)-180天 20.39 -

5 180天(含)-397天(含) 40.02 -

合 计 100.07 -

四、 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	-	-
2	金融债券	517,531,976.40	18.98
	其中：政策性金融债	517,531,976.40	18.98
3	央行票据	1,409,253,569.54	51.68
4	企业债券	19,452,642.90	0.71
5	其他	-	-
合计		1,946,238,188.84	71.37

剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 199,210,120.92 7.31

上表中,付息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

2. 基金投资按成本占期末基金资产净值比例大小排序的前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张)	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
	自有投资	买断式回购		
1	04 央行票据 81	3,400,000	-	337,517,755.37 12.38
2	05 央行票据 33	3,000,000	-	295,272,252.54 10.83
3	05 央行票据 39	3,000,000	-	294,516,263.81 10.80
4	05 央行票据 42	3,000,000	-	294,289,662.20 10.79
5	05 国开 07	2,000,000	-	199,210,120.92 7.31
6	05 央行票据 01	1,900,000	-	187,657,635.62 6.88
7	04 国开 23	1,100,000	-	109,271,764.66 4.01
8	02 国开 16	1,100,000	-	109,108,999.96 4.00
9	05 农发 01	1,000,000	-	99,941,090.86 3.67
10	05 中铝 CP01	200,000	-	19,452,642.90 0.71

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。

五、 "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

2005.4.1---2005.6.30

报告期内偏离度的绝对值在 0.25%(含)-0.5%间的次数 26

报告期内偏离度的最高值 0.4083%

报告期内偏离度的最低值 0.0829%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.2425%

注：以上数据按工作日统计

六、 投资组合报告附注

(一) 基金计价方法说明。

本基金的债券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

(二) 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。

(三) 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。

(四) 其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,266,004.88
4	应收申购款	15,964,174.20
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
合 计		17,230,179.08

第八节 基金份额持有人情况

本基金份额持有人情况如下：

总份额/比例	持有人户数	户均持有份额(份)
个人(份) 比例	机构(份) 比例	合计(份)
1,326,883,307.39 48.66%	1,399,866,361.89 51.34%	2,726,749,669.28 15,788 172,710.27

第九节 基金份额变动情况

本基金份额变动情况如下：

基金合同生效日基金份额总额	本期期初基金份额	本期期间总申购份额	本期期间总赎回份额	本期期末基金份额
964,512,079.20	964,512,079.20	5,112,154,014.70	3,349,916,424.62	2,726,749,669.28

第十节 重大事件揭示

- 一、 本基金的基金管理人于 2005 年 1 月 5 日刊登了海富通货币市场证券投资基金基金合同生效及开放日常申购、赎回业务的公告。本基金的基金合同自 2005 年 1 月 4 日起生效。
- 二、 本基金的基金管理人于 2005 年 1 月 14 日刊登了海富通货币市场证券投资基金招募说明书调整公告,对第九节"基金的转换"第五部分"基金转换费用"以及第十五节"基金的费用和税收"中有关基金销售服务费的计提和支付相关内容进行了调整和明确。
- 三、 本基金的基金管理人于 2005 年 1 月 22 日开通海富通货币市场证券投资基金与本基金管理人管理的其他证券投资基金间基金转换业务,并刊登了公告。

四、 本基金的基金管理人于2005年1月26日刊登了增加海富通货币市场证券投资基金与本基金管理人管理的其他证券投资基金间基金转换业务的代销机构的公告。

五、 2005年1月28日、4月26日,本基金的基金管理人分别就春节长假和五一长假前两个工作日暂停申购和转换转入业务刊登了公告。

六、 本基金的基金管理人于2005年3月18日刊登了《关于增加中国银行股份有限公司为办理海富通货币市场证券投资基金与海富通收益增长证券投资基金间基金转换业务的代销机构的公告》。

七、 本基金的基金管理人于2005年3月18日刊登了《关于海富通货币市场证券投资基金收益率情况的说明》,就2005年3月17日海富通货币市场证券投资基金七日年化收益率超过了8%,远远高出了市场的平均水平,进行了说明。

八、 本基金的基金管理人于2005年3月22日刊登了《关于开办海富通货币市场证券投资基金"定期定额投资计划"的公告》。

九、 本基金的基金管理人于2005年4月15日刊登了《关于海富通货币市场证券投资基金增加"定期定额投资计划"代销机构的公告》,增加兴业银行股份有限公司、海通证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、华夏证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、联合证券有限责任公司、长江证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、交通银行作为本基金"定期定额投资计划"代销机构。

十、 2005年1月26日、3月18日、4月15日、6月29日,本基金的基金管理人刊登公告,增加平安证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、兴业银行股份有限公司、世纪证券有限责任公司为本基金代销机构。

十一、 本基金的管理人、基金财产、基金托管业务报告期内无诉讼事项。

十二、 报告期内本基金投资策略未发生改变。

十三、 本报告期根据基金合同规定每日进行收益分配,并计入投资者帐户的当前累计收益中,每月15日(遇节假日顺延)将投资人帐户的当前累计收益结转为基金份额。

十四、 本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

十五、 本报告期内,本基金托管人的托管业务部门原总经理唐棣华女士已于2005年4月21日调任其他岗位,目前由秦立儒先生任托管部门负责人。

十六、 报告期内本基金租用证券公司专用交易席位一个,交易情况如下:

名称	席位数量	回购成交量(人民币元)	占回购总成交量比例	实付佣金	佣金比率
----	------	-------------	-----------	------	------

海通证券	1	5,139,000,000.00	100.00%	-51,390.00	100.00
------	---	------------------	---------	------------	--------

注:实付佣金均为本基金为券商代垫的结算风险金。

第十一节 备查文件

一、 备查文件目录

- (一) 中国证券监督管理委员会批准设立海富通货币市场证券投资基金的文件
- (二) 海富通货币市场证券投资基金基金合同
- (三) 海富通货币市场证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通货币市场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) 报告期内海富通货币市场证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

- 二、 存放地点：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼基金管理人办公地址。
- 三、 查阅方式：投资者可于营业时间预约查阅,或登录基金管理人网站查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人海富通基金管理有限公司。

客户服务中心电话：021-38784858

网址：www.hftfund.com

海富通基金管理有限公司

2005 年 8 月 26 日