

2012年7月18日 星期三

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：二〇一二年七月十八日

§ 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。

基金托管人中银建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012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。

本基金在财务审阅时未经过审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 海富通稳健增利分级债券型证券投资基金

基金场内简称 海富增利

基金主代码 162308

基金运作方式 约定的封闭式基金，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。

本基金为债券型基金，对债券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、金融货币政策和市场走势的判断，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、类属资产等积极投资策略，在不同品种之间进行配置。

业绩比较基准 本基金业绩比较基准为中证国债指数×90%+沪深300指数×10%

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的最低风险品种，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 海富通稳健增利分级债券A类（场内简称：增利A）；海富通增利分级债券B类（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

增利A份额将表现出低风险、增利B份额则表现出较高风险、收益相对稳定的特征

下属两级基金的风险收益特征

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 4,782,153.35

2.本期利润 17,103,072.11

3.加权平均基金份额本期利润 0.0776

4.期末基金份额净值 246,670,126.35

5.期末基金份额净值 1.119

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将降低至所列数字。

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基金净值表现

④本基金合同生效以来基金份额净值增长率为2.25%，业绩比较基准收益率为1.119%，差额为0.119%。

⑤本基金合同生效以来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 增值净值 增值净值 增值净值 增值净值

率(%) 标准差(%) 收益率(%) 收益率(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 7.49% 0.19% 2.25% 0.11% 5.24% 0.08%

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

海富通稳健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2012年6月30日

海富通稳健增利分级债券型证券投资基金



注：1. 本基金合同于2011年9月1日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2. 按照本基金合同规定，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）。

报告期末基金份额总额

投资目标

本基金在控制风险和保持流动性的基础上，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。

本基金为债券型基金，对债券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、金融货币政策和市场走势的判断，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、类属资产等积极投资策略，在不同品种之间进行配置。

业绩比较基准

本基金业绩比较基准为中证国债指数×90%+沪深300指数×10%

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的最低风险品种，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 海富通稳健增利分级债券A类（场内简称：增利A）；海富通增利分级债券B类（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

增利A份额将表现出低风险、增利B份额则表现出较高风险、收益相对稳定的特征

§ 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 说明

杨铭 独立董事 2010-1-13 - 14年 中国籍，特许金融分析师（CFA），经济学学士，持有高级金融从业人员资格证书，先后任职于香港亚银国际有限公司、上海瀚蓝投资有限公司，2004年4月加入海富通基金管理有限公司，担任特许金融分析师，2008年1月起任海富通中国海外精选股票型证券投资基金基金经理，2010年1月起任海富通稳健增利分级债券型证券投资基金基金经理，2011年1月起任海富通大中华股票（QDII）基金经理。

注：1. 对基金管理人而言，其任本基金基金经理之日起，离任日期指公司做出决定之日；非前任基金经理，其任职期间不包含公司做出决定之日起至离任日期的期间。

2. 证券从业年限的计算标准为：当年开始从事证券工作的相关工作人员。

3. 除报告期内新任基金经理外，其余人员的证券从业年限从其开始从事证券工作之日起计算。

4. 证券从业年限的统计情况

4.2 管理人对报告期内基金运作的总体评价

报告期内，本基金在严格遵守法律法规及基金合同规定的前提下，实现了较高的投资回报，较好地完成了投资目标。

本基金在严格遵守法律法规及基金合同规定的前提下，实现了较高的投资回报，较好地完成了投资目标。

本基金在严格遵守法律法规及基金合同规定的前提下，实现了较高的投资回报，较好地完成了投资目标。