

## 海富通收益增长证券投资基金

## 2012 年度 报告 摘要

普华永道中天会计师事务所有限公司为基金出具了标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

基金主体:海富通收益增长证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资产

2012年12月31日

2011年12月31日

货币资金

131,977,496.29

134,713,270.50

结算备付金

4,620,150.53

2,046,875.29

存出保证金

2,187,107.97

1,888,549.25

交易性金融资产

2,578,952,582.45

2,508,184,003.45

其中:股票投资

2,043,471,189.45

1,754,578,823.85

基金投资

-

-

债券投资

535,481,393.00

753,605,179.60

资产支持证券投资

-

衍生金融资产

-

买入返售金融资产

-

499,860,949.79

应收证券清算款

18,920,077.01

-

应收利息

6,503,602.09

8,199,229.71

应收股利

-

-

应收申购款

15,857.29

11,630.89

递延所得税资产

-

-

其他资产

-

-

资产总计

2,743,176,873.63

3,154,904,508.75

负债和所有者权益

2012年12月31日

2011年12月31日

负债:

-

-

短期借款

-

-

交易性金融负债

-

-

衍生金融负债

-

-

卖出回购金融资产款

-

-

应付证券清算款

31,712,097.88

31,004,604.75

应付赎回款

1,586,640.19

1,277,474.03

应付管理人报酬

3,217,190.53

4,071,572.03

应付托管费

536,198.41

-

应付销售服务费

-

-

应付交易费用

3,581,720.40

1,531,623.59

应交税费

1,468,939.32

1,468,939.32

应付利息

-

-

应付利润

-

-

递延所得税负债

-

-

其他负债

1,408,071.27

1,468,404.23

负债合计

43,510,858.00

41,500,849.29

所有者权益:

实收基金

4,168,989,503.05

4,647,840,561.79

未分配利润

-1,469,323,487.42

-1,534,436,902.33

所有者权益合计

2,699,666,015.63

3,113,403,659.46

负债和所有者权益总计

2,743,176,873.63

3,154,904,508.75

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.648元,基金份额总额4,168,989,503.05份。

7.2 利润表

基金主体:海富通收益增长证券投资基金

报告截止日:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

一、收入

-3,507,934.43

-720,328,605.64

1.利息收入

25,405,328.47

29,596,720.64

债券利息收入

1,770,831.48

2,375,080.65

债券投资收益

22,966,964.88

25,426,083.46

资产支持证券利息收入

-

-

买入返售金融资产收入

667,532.11

1,795,556.53

其他利息收入

-

-

2.投资收益(损失以“-”填列)

-394,814,982.22

-303,757,543.35

其中:股票投资收益

-424,187,733.94

-323,073,149.50

基金投资收益

756,239.95

-1,281,899.26

债券投资收益

-

-

资产支持证券投资收益

-

-

衍生工具收益

-

-

股利收益

28,616,511.77

20,597,505.41

3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)

365,685,081.95

-446,204,613.65

4.汇兑收益(损失以“-”填列)

-

-

5.其他收入(损失以“-”填列)

216,637.37

36,830.72

减:一、费用

87,534,547.25

88,116,281.87

1.管理人报酬

42,662,413.96

54,771,977.89

2.托管费

7,110,402.28

9,128,662.88

3.销售服务费

-

-

4.交易费用

36,931,921.17

23,106,169.76

5.利息支出

475,778.31

586,815.78

其中:卖出回购金融资产支出

475,778.31

586,815.78

6.其他费用

454,031.53

522,655.56

二、利润总额(亏损总额以“-”号填列)

-91,142,481.68

-808,444,887.51

减:所得税费用

-

-

四、净利润(净亏损以“-”号填列)

-91,142,481.68

-808,444,887.51

7.3 所有者权益变动表

基金主体:海富通收益增长证券投资基金

报告截止日:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

一、本期期初所有者权益(基金净值)

4,647,840,561.79

-1,534,436,902.33

3,113,403,659.46

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)

-

-91,142,481.68

-91,142,481.68

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)

-478,851,058.74

156,255,896.59

-322,595,162.15

其中:1.基金申购款

17,528,823.48

-6,134,179.30

11,394,644.18

2.基金赎回款

-496,379,882.22

162,390,059.89

-333,989,806.33

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)

-

-

五、期末所有者权益(基金净值)

4,168,989,503.05

-1,469,323,487.42

2,699,666,015.63

7.4 现金流量表

基金主体:海富通收益增长证券投资基金

报告截止日:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

一、本期期初现金及现金等价物余额

4,820,825,872.26

-762,548,127.11

4,058,277,745.15

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)

-

-808,444,887.51

-808,444,887.51

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)

-172,985,310.47

36,556,112.29

-136,429,198.18

其中:1.基金申购款

271,125,264.30

-50,456,723.31

220,668,540.99

2.基金赎回款

-444,110,574.77

87,012,835.60

-357,097,739.17

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)

-

-

五、期末现金及现金等价物余额

4,647,840,561.79

-1,534,436,902.33

3,113,403,659.46

7.5 所有者权益变动表

基金主体:海富通收益增长证券投资基金

报告截止日:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

一、本期期初所有者权益(基金净值)

4,647,840,561.79

-1,534,436,902.33

3,113,403,659.46

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)

-

-91,142,481.68

-91,142,481.68

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)

-478,851,058.74

156,255,896.59

-322,595,162.15

其中:1.基金申购款

17,528,823.48

-6,134,179.30

11,394,644.18

2.基金赎回款