

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:二〇一三年三月二十七日
§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事对本报告所载资料不承担虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对内容的真实性、准确性和完整性承担责任。本年度报告经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签章。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同约定,于2013年3月26日复核了本报表中的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等,内容报告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本基金,但不保证本基金一定盈利。

基金年度报告摘要自年度报告正文、投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 海富通稳健增利分级债券型证券投资基金

基金代码 162308

基金运作方式 约定型基金,本基金合同生效后,封闭期为三年(含一年),封闭期届满后转为开放式基金(LOF)。

基金合同生效日 2011年9月1日

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

报告期期初基金份额总额 220,512,365.45份

基金资产净值 不定期

基金上市交易场所 深圳证券交易所

上市日期 2011-1-18

下属分级基金的基金简称 海富通稳健增利分级债券A(场内简称:增利A)

下属分级基金的交易代码 150044

报告期期初下属分级基金的份额总额 176,410,051.34份

44,102,914.11份

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金在控制风险和保持资产适当流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争实现基金的长期稳定增值。

本基金为契约型基金,对债券类资产的投资比例不低于基金资产的80%。在任何情况下本基金通过宏观分析、利率资产配置和资产组合的预期收益进行动态跟踪,从而根据其配置比例,固定收益类资产中,本基金将采取久期管理、收率曲线策略、量化配置等积极投资策略,在不同债券品种之间进行资产配置。

业绩比较基准 中证国债指数*90%+沪深300指数*10%。

本基金为债券型基金,属于固定收益类资产的较低风险品种,其预期风险与预期收益水平均低于股票型基金,但高于货币型基金。

风险收益特征 增利A将表现出现低风险、收益性和份额类别之间较高的风险,风险相对稳定的特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

信息披露义务人 赵万荣

田青

客户服务电话 021-67595096

电子邮箱 wnx@hfifund.com

客户服务电话 40088-40099

电子邮箱 021-67595096

客户服务电话 021-33830166

电子邮箱 010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址 <http://www.hfifund.com>

基金年度报告备置地点 基金管理人及基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2012年 2011年9月1日(基金合同生效日)至2011年12月31日

本期实现收益 20,854,271.87 2,121,666.51

本期利润 25,414,572.48 4,382,265.25

加权平均基金份额本期利润 0.1153 0.0199

本期基金份额净值增长率为 11.27% 2.00%

3.1.2 期末数据和指标 2012年末 2011年末

期末可供分配基金份额利润 0.1042 0.0096

期末基金资产净值 250,309,403.18 224,894,830.70

期末基金份额净值 1.135 1.020

注:1.本期已实现收益指基金利润减去应付费用,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。

2.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润之和减去本期利润。

4.本基金于2011年1月1日生效,生效后当期间的数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长

份额净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长

业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准

①②③④⑤⑥

过去3个月 1.89% 1.63% 0.13% 0.26% -0.01%

过去6个月 1.43% 0.19% 0.13% 0.64% 0.06%

过去一年 11.27% 0.18% 4.20% 7.07% 0.04%

3.2.2 基金合同生效以来净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

阶段 业绩比较基准收益率与同期业绩比较基准收益率的差额

过去3个月 1.89%+0.09%+沪深300指数*10%+定期存款利率*10%+1.63%

过去6个月 1.43%+0.09%+沪深300指数*10%+定期存款利率*10%+1.63%

过去一年 11.27%+0.09%+沪深300指数*10%+定期存款利率*10%+1.63%

注:海富通稳健增利业绩比较基准=中证国债指数*90%+沪深300指数*10%+定期存款利率*10%+定期存款利率*10%+1.63%。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位:人民币元

3.3.1 期间数据和指标 2012年 2011年9月1日(基金合同生效日)至2011年12月31日

本期实现收益 20,854,271.87 2,121,666.51

本期利润 25,414,572.48 4,382,265.25

加权平均基金份额本期利润 0.1153 0.0199

本期基金份额净值增长率为 11.27% 2.00%

3.3.2 期末数据和指标 2012年末 2011年末

期末可供分配基金份额利润 0.1042 0.0096

期末基金资产净值 250,309,403.18 224,894,830.70

期末基金份额净值 1.135 1.020

注:1.本期已实现收益指基金利润减去应付费用,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。

2.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润之和减去本期利润。

4.本基金于2011年1月1日生效,生效后当期间的数据和指标按实际存续期计算。

3.4 本期主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.4.1 本期主要会计数据

项目 2012年 2011年9月1日(基金合同生效日)至2011年12月31日

本期实现收益 23,264,098.74 5,779,822.51

本期利润 15,635,459.37 3,855,050.93

加权平均基金份额本期利润 0.1153 0.0199

本期基金份额净值增长率为 11.27% 2.00%

3.4.2 本期主要财务指标

项目 2012年 2011年9月1日(基金合同生效日)至2011年12月31日

本期利润 23,264,098.74 5,779,822.51

加权平均基金份额本期利润 0.1153 0.0199

本期基金份额净值 1.135 1.020

注:1.本期已实现收益指基金利润减去应付费用,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。

2.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润之和减去本期利润。

4.本基金于2011年1月1日生效,生效后当期间的数据和指标按实际存续期计算。

3.5 会计数据和财务指标同行业可比数据

金额单位:人民币元

3.5.1 本期主要会计数据

项目 2012年 2011年9月1日(基金合同生效日)至2011年12月31日

本期实现收益 23,264,098.74 5,779,822.51

本期利润 15,635,459.37 3,855,050.93

加权平均基金份额本期利润 0.1153 0.0199

本期基金份额净值增长率为 11.27% 2.00%

3.5.2 本期主要财务指标

项目 2012年 2011年9月1日(基金合同生效日)至2011年12月31日

本期利润 23,264,098.74 5,779,822.51

加权平均基金份额本期利润 0.1153 0.0199

本期基金份额净值 1.135 1.020

注:1.本期已实现收益指基金利润减去应付费用,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。

2.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润之和减去本期利润。

4.本基金于2011年1月1日生效,生效后当期间的数据和指标按实际存续期计算。

3.6 管理人对报告期基金运作的总体评价

本基金管理人对报告期基金运作的总体评价

本基金管理人对报告期基金运作的总体评价