

海富通收益增长证券投资基金

[2012] 第一季度报告

基金管理人:海富通基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一二年四月二十三日

基金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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同,于2012年4月20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、误导性陈述和重大遗漏。

基金的过往表现并不代表其未来表现。投资有风险,投资者作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称:海富通收益增长混合

基金代码:519003

交易代码:519003

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2004年1月12日

报告期末基金份额总额:4,354,554,010.69份

投资目标:建立随时调整并灵活运用的收益增长线,运用优化组合保险机制实现风险

投资管理:力争基金单位资产净值高于收益增长线水平。在此基础上,通过精选券种并适当增加固定收益类资产比例,将中国经济的高速增长转化为

投资策略:整体投资策略分为三个层次,第一层次,以整体投资组合保险策略为核

心,并结合市场判断,确定和调整基金资产在债券和股票的配置比例,实现风险预算管理,追求投资目标的实现;第二

层次,采用自下而上的策略,以风险管理为核心,从整体资产配置、类属资产

配置和券种选择三个层面进行风险管理,保证基金单位资产净值的持续增长;第三层次,根据对宏观经济、政策和流动性指标的分析,并结合主动管理的风格和构建分散化的股票组合,控制

系统性风险,充分获取基金单位资产收益。

业绩比较基准:40%MSCI China A+60%上证国债

风险收益特征:属于证券投资基金中风险较低的产品,追求在风险预算目标下基金资产

增值的最大化。

基金管理人:海富通基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -217,002,189.65

2.本期利润 -5,961,752.97

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0013

4.期末基金份额净值 2,905,846,179.39

5.期末基金份额净值 0.967

注:本基金定期报告中各项指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

①本期已实现收益指基金利息收入、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,本期期初至本报告期已实现收益变动金额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本期报告期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 率① 净值增长 率② 业绩比较 基准收益率 ③ 业绩比较 基准收益率 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.45% 1.05% -2.42% 0.62% -2.87% 0.43%

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

海富通收益增长混合基金

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

(2004年3月1日至2012年3月31日)

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起六个月内为封闭期。本基金自2007年8月7日至2007年11月1日为持续

申购赎回期,之后本基金的各笔申购及赎回均在持有基金后方可享受规定的赎回,即股票资产0-80%、债券资产

20%-100%,同时满足18%的持有期限制组合的某项比例要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理管理基金的基本情况

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明