

海富通稳固收益债券型证券投资基金

2013 年度 报告 摘要

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金的估值由基金管理人估值委员会负责，估值委员会成员具有 5 年以上的基金及相关行业工作经验、专业胜任能力，并具备估值系统开发和相关工作中保持独立、估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组。估值工作小组充分听取相关部门的建议，并和相关托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序支持报告，以便估值委员会决策。

估值政策经估值委员会审阅同意，并经本公司总办公会批准后方可实施。

基金估值按照批准后的估值政策进行估值。

除了投资总意外，其他基金管理人不是估值委员会和估值工作小组的成员，不参与估值政策的决策。但是对于估值政策和程序，基金经理可以和其他估值工作小组提供建议。

上述参与和估值委员会之间无任何重大利益冲突。

对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用证券投资基金估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%。

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同约定。

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规情况

报告期内，本基金托管人对于海富通稳固收益债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守程序、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，海富通稳固收益债券型证券投资基金的管理人——海富通基金管理有限公司在海富通稳固收益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额净值核算和估值、基金费用开支等方面，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的有关规定进行。

5.3 托管人对本年度报告期内基金净值信息的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的海富通稳固收益债券型证券投资基金 2013 年年度报告中财务数据、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进行了核查，以上内容真实、准确、完整。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)出具了标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

7.1 资产负债表

会计主体:海富通稳固收益债券型证券投资基金

报告截止日:2013 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产 2013 年 12 月 31 日 2012 年 12 月 31 日

货币资金 4,394,315.64 9,516,511.58

结算备付金 1,357,179.94 1,312,943.61

存出保证金 34,353.49 352,109.66

应收利息 189,187,260.00 306,590,165.80

其中:应收债券利息 5,673,461.04

基金投资 300,916,704.76

其中:资产支持证券 1,099,212.21

需重估资产 200,000,000.00 24,000,000.00

应收证券清算款 1,133,131.65

应收股利 5,154,180.01 7,874,972.42

应收利息 200.00 25,659.37

递延所得税资产 220,127,429.08 349,672,407.96

资产总计 220,127,429.08 349,672,407.96

负债和所有者权益 2013 年 12 月 31 日 2012 年 12 月 31 日

负债:

短期借款 981,211.36 3,412,343.23

应付短期融资券 276,859.86 1,133,131.65

应付管理人报酬 37,879.58 67,573.37

应付托管费 75,759.19 134,746.76

应付交易费用 5,664.23 43,978.82

应付利息 1,069,563.53 927,560.53

应付股利 360,000.00 370,360.90

其他应付款 2,879,513.32 6,325,312.76

所有者权益:

实收基金 197,684,175.89 324,699,142.63

未分配利润 19,363,789.67 18,647,952.57

所有者权益合计 217,047,915.76 343,347,095.20

负债和所有者权益合计 220,127,429.08 349,672,407.96

注:报告截止日 2013 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.099 元,基金份额总额 197,684,175.89 份。

7.2 利润表

会计主体:海富通稳固收益债券型证券投资基金

报告期间:2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

一、收入 17,677,476.71 50,951,538.48

1.利息收入 9,984,519.42 20,657,423.48

其中:存款利息收入 115,683.51 207,328.16

债券利息收入 9,206,131.78 20,286,015.20

资产支持证券利息收入 -- --

2.投资收益(损失以“-”填列) 16,655,713.10 26,121,892.34

其中:交易性金融资产 1,193,465.16 1,735,489.22

基金投资收益 15,849,178.26 24,388,403.12

其中:资产支持证券投资收益 -- --

公允价值变动收益 -- --

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) -- --

4.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

5.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

6.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

7.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

8.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

9.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

10.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

11.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

12.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

13.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

14.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

15.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

16.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

17.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

18.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

19.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

20.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

21.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

22.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

23.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

24.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

25.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

26.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

27.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

28.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

29.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

30.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

31.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

32.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

33.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

34.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

35.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

36.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

37.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

38.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

39.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

40.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

41.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

42.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

43.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

44.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

45.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

46.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

47.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

48.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

49.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

50.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

51.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

52.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

53.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

54.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

55.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

56.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

57.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

58.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

59.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

60.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

61.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

62.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

63.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

64.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

65.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

66.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

67.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

68.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

69.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

70.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

71.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

72.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

73.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

74.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

75.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

76.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

77.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

78.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

79.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

80.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

81.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

82.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

83.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

84.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

85.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

86.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

87.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

88.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

89.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

90.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

91.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

92.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

93.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

94.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

95.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

96.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

97.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

98.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

99.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

100.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

101.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

102.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

103.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

104.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

105.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

106.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

107.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

108.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

109.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

110.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

111.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

112.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

113.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

114.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

115.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

116.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

117.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

118.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

119.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

120.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

121.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

122.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

123.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

124.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

125.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

126.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

127.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

128.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

129.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

130.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

131.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

132.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

133.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

134.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

135.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

136.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

137.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

138.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

139.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

140.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

141.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

142.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

143.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

144.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

145.其他收入(损失以“-”号填列) -- --

146.其他收入(损失以“-”号填列) -- --