# 海富通稳固收益债券型证券投资基金

## [2015] 年度报告摘要

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:二〇一六年三月二十八日

## §1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月25日复核了本报告中的财务指标、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,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及其更新。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 海富通稳固收益债券 |
| 基金主代码 | 519030 |
| 交易代码 | 519030 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年11月23日 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 295,213,030,239份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 通过合理运用投资组合优化策略,力争实现基金收益随着时间增长的逐步提升。 |
| 投资策略 | 本基金的整体投资策略分为三个层次:第一层次,即资产配置策略,将以优化投资组合保险策略为核心,实现基金投资目标;第二层次,即债券投资策略,将采用自上而下的策略,以久期管理为核心;第三层次,即股票投资策略,包括新股申购策略和积极的精选个股策略。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,属于中低风险品种。其预期收益和风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 海富通基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 吴万荣 | 洪源 |
| | 联系电话 | 021-38650891 | 010-66106799 |
| | 电子邮箱 | wwx@hfthfund.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400811-40099 | 95588 |
| 传真 | | 021-33830166 | 010-66106799 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.hfthfund.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 | 2015年 | 2014年 | 2013年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 53,998,911.86 | 19,251,525.41 | 23,676,839.27 |
| 本期利润 | 34,948,624.49 | 36,632,658.74 | 13,070,598.62 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2085 | 0.2475 | 0.0646 |
| 本期基金份额净值增长率 | 19.18% | 24.75% | 3.97% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015年末 | 2014年末 | 2013年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.6344 | 0.2923 | 0.0990 |
| 期末基金资产净值 | 482,500,595.62 | 163,777,991.03 | 217,247,915.76 |
| 期末基金份额净值 | 1.634 | 1.371 | 1.099 |

注:1.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。
2.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要低于所列数字。
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中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

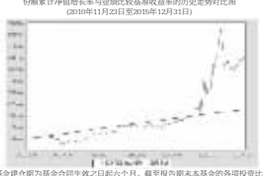
3.2 基金净值表现

3.2.1 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

| 3.1.1 期间数据和指标 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 4.91% | 0.56% | 0.70% | 0.01% | 4.21% | 0.55% |
| 过去六个月 | -0.18% | 0.61% | 1.40% | 0.01% | -1.57% | 0.60% |
| 过去一年 | 19.18% | 1.28% | 3.27% | 0.01% | 15.91% | 1.27% |
| 过去三年 | 54.59% | 0.88% | 12.31% | 0.01% | 42.28% | 0.87% |
| 过去五年 | 62.59% | 0.69% | 23.10% | 0.01% | 39.49% | 0.68% |
| 自基金合同生效起至今 | 63.40% | 0.68% | 23.60% | 0.01% | 39.80% | 0.67% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

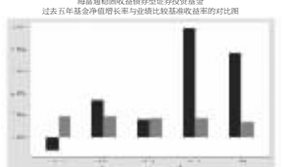
海富通稳固收益债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2010年11月23日至2015年12月31日)



注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分(二)投资范围、(五)投资限制中规定的各项比例。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通稳固收益债券型证券投资基金
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2015年 | - | - | - | - | - |
| 2014年 | - | - | - | - | - |
| 2013年 | - | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | - | - | - |

注:本基金过去三年未发生利润分配。

## §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]90号文批准,由香港证券投资有限公司和富通基金管理公司(现更名为"法国巴黎投资管理BE投资公司")于2003年4月1日共同发起设立,截至2015年12月31日,本基金管理人共管理31只公募基金:海富通精选证券投资基金、海富通收益债长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选成长混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证100指数证券投资基金(LOF)、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳进增利债券型证券投资基金(LOF)、海富通深证红利交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通养老收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通双债力提债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双债力保债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、海富通内需灵活配置混合型证券投资基金。

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 顾欣民 | 本基金的基金经理,海富通一年定开债券基金的基金经理,海富通稳定增利债券(LOF)基金的基金经理,海富通现金管理货币基金的基金经理 | 2010-11-23 | 2015-01-23 | 18年 | 硕士,持有基金从业人员资格证书,历任海通证券公司固定收益部债券分析员,债券研究员,投资经理,债券分析师,债券投资部经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司,历任固定收益分析师,基金经理,固定收益组合管理部总监,投资总监助理兼副总监,2008年5月至2008年12月任海富通稳健添利债券型证券投资基金(LOF)基金经理,2008年5月至2015年1月任海富通稳健添利债券型证券投资基金基金经理,2009年11月至2015年1月任海富通收益债券型证券投资基金(LOF)基金经理,2010年9月至2012年2月任长大集锦证券投资基金基金经理,2012年3月至2012年8月任海富通货币市场基金基金经理,2013年3月至2015年10月任海富通现金管理货币市场基金基金经理,2013年12月至2015年1月任海富通稳健添利债券型证券投资基金基金经理,2014年4月至2015年1月任海富通稳固收益债券型证券投资基金基金经理,2014年12月至2015年1月任海富通稳健回报混合型证券投资基金基金经理,2014年12月至2015年1月任海富通稳健添利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 凌超 | 本基金的基金经理,海富通一年定开债券基金的基金经理,海富通稳定增利债券(LOF)基金的基金经理,海富通现金管理货币基金的基金经理 | 2014-12-01 | - | 9年 | 硕士,持有基金从业人员资格证书,先后任职于长江证券股份有限公司、光大保德信资产管理有限公司,2009年7月至2009年8月任长江证券股份有限公司先锐经理备选组合管理人,投资经理。2009年7月至2010年2月任光大保德信资产管理有限公司固定收益研究员,2010年2月至2010年7月任光大保德信增利收益债券基金经理助理,2010年9月至2012年2月任光大保德信增利基金经理助理,2012年3月加入海富通基金管理有限公司,2013年3月至2014年10月任海富通现金管理货币基金经理,2013年12月至2016年1月兼任海富通一年定开债券基金经理,2014年4月至2016年1月兼任海富通纯债债券基金经理,2014年12月至2016年1月兼任海富通稳固收益债券和海富通稳进增利债券(LOF)基金经理。 |
| 陈炜平 | 本基金的基金经理,海富通货币基金经理,海富通货币增利基金经理,海富通债券基金经理助理,海富通上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金(LOF)基金经理 | 2015-12-18 | - | 6年 | 博士,持有基金从业人员资格证书,曾任Moody's Investment Group LLC分析师,2009年10月至2015年9月任海通证券研究所(上海)有限公司固收团队资深研究员,2015年9月加入海富通基金管理有限公司,任债券投资经理。2015年10月起担任海富通货币基金基金经理,2016年1月起兼任海富通债券型基金基金经理助理,2016年1月兼任海富通上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金(LOF)基金经理助理。2015年12月兼任海富通稳固收益债券基金经理。 |

注:1.对基金的首任基金经理,其任职日期指基金合同生效日,离任日期指公司做出决定之日;非首任基金经理,其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。非首任基金经理,其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日;非首任基金经理,其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日;非首任基金经理,其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日;