

海富通收益增长证券投资报告摘要

2008年年度报告摘要

基金管理人: 海富通基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司
基金合同生效日期: 2008年3月26日

1.1 重要提示
基金管理人承诺: 基金管理人承诺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。

2.1 基金基本情况
基金简称: 海富通收益
基金代码: 519003
基金运作方式: 契约型开放式
基金合同生效日: 2008年3月26日

投资目标
本基金为证券投资基金中追求非负增长的收益增长型基金, 运用优化组合保险机制实现风险预算管理, 力争基金净值增长率高于收益增长基准水平。

投资策略
本基金的投资策略分为三个层次: 第一层次, 以优化投资组合保险策略为核心, 并结合把握市场时机, 确定和调整基金资产在债券和股票间的配置比例。

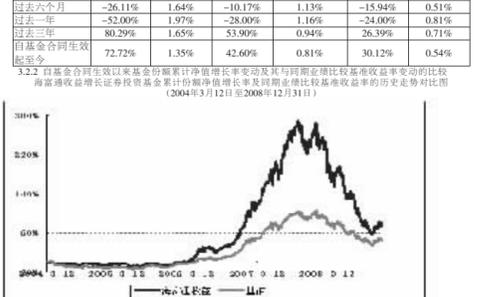
Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金管理人/基金托管人 (Fund Manager/Trustee). Lists contact information for the fund manager and trustee.

2.4 信息披露方式
本基金年度报告/半年度报告正文的管理人互联网网址: http://www.hftfund.com

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
2008年 2007年 2006年
本期已实现收益 -2,791,260.0752 2,236,723.25305 1,831,240.22808

3.1.2 期末数据和指标
2008年 2007年 2006年
期末可供分配基金份额利润 -0.4853 0.0679 0.5131
期末基金资产净值 3,319,273,808.87 2,246,951,163.74 2,956,891,599.60

3.2 基金业绩比较基准
业绩比较基准: 40%MSCI China A+60%上证国债
业绩比较基准收益率: 1.88%



3.2.2 本基金合同生效以来基金业绩比较基准增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较
本基金合同生效以来基金业绩比较基准增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

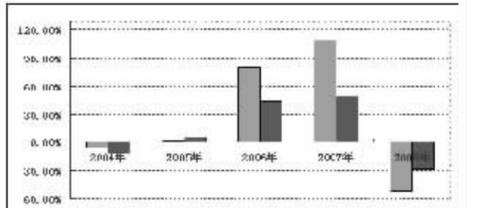


Table showing the fund's performance relative to the benchmark across different periods from 2004 to 2008. Columns include: 阶段 (Period), 份额净值增长率 (Share Net Value Growth Rate), 业绩比较基准收益率 (Benchmark Yield), etc.

4.1 基金管理人及基金经营情况
4.1.1 基金管理人基本情况
基金管理人: 海富通基金管理有限公司
基金管理人主要人员情况: 董事长: 陈智勇, 总经理: 陈智勇, 副总经理: 陈智勇, 督察长: 陈智勇

Table showing the fund's performance relative to the benchmark across different periods from 2004 to 2008. Columns include: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (End Date), 年限 (Tenure), 说明 (Remarks).

4.2 基金管理人内部控制制度
4.2.1 内部控制制度概述
基金管理人内部控制制度包括: 投资管理业务内部控制制度, 基金销售业务内部控制制度, 基金后台业务内部控制制度, 基金信息披露业务内部控制制度, 基金会计核算业务内部控制制度, 基金风险管理业务内部控制制度, 基金合规管理业务内部控制制度, 基金信息技术业务内部控制制度, 基金行政管理业务内部控制制度, 基金其他业务内部控制制度

4.3 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.3.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
基金管理人内部控制制度的执行情况良好, 能够有效防范和控制风险, 保障基金财产的安全, 维护基金份额持有人的合法权益。

4.3.2 基金管理人内部控制制度的执行情况
基金管理人内部控制制度的执行情况良好, 能够有效防范和控制风险, 保障基金财产的安全, 维护基金份额持有人的合法权益。

4.3.3 基金管理人内部控制制度的执行情况
基金管理人内部控制制度的执行情况良好, 能够有效防范和控制风险, 保障基金财产的安全, 维护基金份额持有人的合法权益。

上述参与估值流程各方之间无任何利益冲突。
对于交易所上市证券, 采用交易所发布的行情信息估值; 对于固定收益品种, 采用证券估值委员会估值; 对于非上市证券, 采用估值委员会估值。

5 受托人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵守信托信守情况
报告期内, 中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在海富通收益增长证券投资(以下称“本基金”)的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定, 不存在损害基金资产的行为, 不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

6 审计报告
普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。
报告截止日: 2008年12月31日

7.1 资产负债表
会计主体: 海富通收益增长证券投资
报告截止日: 2008年12月31日

Table showing the fund's balance sheet as of December 31, 2008. Columns include: 资产 (Assets), 负债 (Liabilities), 所有者权益 (Equity).

7.2 利润表
会计主体: 海富通收益增长证券投资
报告截止日: 2008年12月31日

Table showing the fund's profit and loss statement as of December 31, 2008. Columns include: 项目 (Item), 本期 (Current Period), 上期 (Previous Period).

7.3 所有者权益变动表
会计主体: 海富通收益增长证券投资
报告截止日: 2008年12月31日

Table showing the fund's equity changes as of December 31, 2008. Columns include: 项目 (Item), 本期 (Current Period), 上期 (Previous Period).

7.4 报表附注
7.4.1 报表编制所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致的说明
本报告期内采用的会计政策与最近一期年度报告保持一致。

7.4.2 会计估计变更的说明
7.4.2.1 会计估计变更的说明
本报告期内不存在会计估计变更。

7.4.3 关联方关系
7.4.3.1 关联方关系
关联方名称: 海富通基金管理有限公司, 基金管理人, 基金销售机构; 中国银行股份有限公司, 基金托管人, 基金代埋机构; 海富通基金管理有限公司, 基金管理人, 基金代埋机构

7.4.3.2 关联交易
本期 2008年1月1日至2008年12月31日
关联交易: 基金管理人, 基金销售机构, 基金托管人, 基金代埋机构

7.4.3.3 关联方关系
本期 2008年1月1日至2008年12月31日
关联交易: 基金管理人, 基金销售机构, 基金托管人, 基金代埋机构

7.4.3.4 关联方关系
本期 2008年1月1日至2008年12月31日
关联交易: 基金管理人, 基金销售机构, 基金托管人, 基金代埋机构

7.4.3.5 关联方关系
本期 2008年1月1日至2008年12月31日
关联交易: 基金管理人, 基金销售机构, 基金托管人, 基金代埋机构

7.4.3.6 关联方关系
本期 2008年1月1日至2008年12月31日
关联交易: 基金管理人, 基金销售机构, 基金托管人, 基金代埋机构

7.4.3.7 关联方关系
本期 2008年1月1日至2008年12月31日
关联交易: 基金管理人, 基金销售机构, 基金托管人, 基金代埋机构

金额单位: 人民币元
关联方名称: 海通证券
本期 2008年1月1日至2008年12月31日
交易金额: 4,804,642.45

关联方名称: 海通证券
本期 2008年1月1日至2008年12月31日
交易金额: 4,804,642.45

6 审计报告
普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。
报告截止日: 2008年12月31日

7.1 资产负债表
会计主体: 海富通收益增长证券投资
报告截止日: 2008年12月31日

Table showing the fund's balance sheet as of December 31, 2008. Columns include: 资产 (Assets), 负债 (Liabilities), 所有者权益 (Equity).

7.2 利润表
会计主体: 海富通收益增长证券投资
报告截止日: 2008年12月31日

Table showing the fund's profit and loss statement as of December 31, 2008. Columns include: 项目 (Item), 本期 (Current Period), 上期 (Previous Period).

7.3 所有者权益变动表
会计主体: 海富通收益增长证券投资
报告截止日: 2008年12月31日

Table showing the fund's equity changes as of December 31, 2008. Columns include: 项目 (Item), 本期 (Current Period), 上期 (Previous Period).

7.4 报表附注
7.4.1 报表编制所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致的说明
本报告期内采用的会计政策与最近一期年度报告保持一致。

7.4.2 会计估计变更的说明
7.4.2.1 会计估计变更的说明
本报告期内不存在会计估计变更。

7.4.3 关联方关系
7.4.3.1 关联方关系
关联方名称: 海富通基金管理有限公司, 基金管理人, 基金销售机构; 中国银行股份有限公司, 基金托管人, 基金代埋机构; 海富通基金管理有限公司, 基金管理人, 基金代埋机构

7.4.3.2 关联交易
本期 2008年1月1日至2008年12月31日
关联交易: 基金管理人, 基金销售机构, 基金托管人, 基金代埋机构

7.4.3.3 关联方关系
本期 2008年1月1日至2008年12月31日
关联交易: 基金管理人, 基金销售机构, 基金托管人, 基金代埋机构

7.4.3.4 关联方关系
本期 2008年1月1日至2008年12月31日
关联交易: 基金管理人, 基金销售机构, 基金托管人, 基金代埋机构

7.4.3.5 关联方关系
本期 2008年1月1日至2008年12月31日
关联交易: 基金管理人, 基金销售机构, 基金托管人, 基金代埋机构

7.4.3.6 关联方关系
本期 2008年1月1日至2008年12月31日
关联交易: 基金管理人, 基金销售机构, 基金托管人, 基金代埋机构

7.4.3.7 关联方关系
本期 2008年1月1日至2008年12月31日
关联交易: 基金管理人, 基金销售机构, 基金托管人, 基金代埋机构

7.4.3.8 关联方关系
本期 2008年1月1日至2008年12月31日
关联交易: 基金管理人, 基金销售机构, 基金托管人, 基金代埋机构

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动
8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table showing the top 20 stocks bought during the reporting period. Columns include: 序号 (No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计买入金额 (Total Buy Amount), 占期初基金资产净值比例(%) (Ratio to Net Value).

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table showing the top 20 stocks sold during the reporting period. Columns include: 序号 (No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计卖出金额 (Total Sell Amount), 占期初基金资产净值比例(%) (Ratio to Net Value).

8.4.3 买入股票的成本(成交)总额
8.4.3.1 买入股票的成本(成交)总额

Table showing the total cost of stocks bought. Columns include: 买入股票成本(成交)总额 (Total Buy Cost), 卖出股票收入(成交)总额 (Total Sell Income).

8.5 期末按市值分类的股票投资组合
8.5.1 期末按市值分类的股票投资组合

Table showing the stock portfolio by market value at the end of the reporting period. Columns include: 序号 (No.), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Ratio to Net Value).

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名债券投资组合
8.6.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名债券投资组合

Table showing the top 5 bonds by fair value at the end of the reporting period. Columns include: 序号 (No.), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量(张) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Ratio to Net Value).

8.7 期末公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名股票投资组合
8.7.1 期末公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名股票投资组合

Table showing the top 5 stocks by fair value at the end of the reporting period. Columns include: 序号 (No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Ratio to Net Value).

8.8 期末公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名权证投资组合
8.8.1 期末公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名权证投资组合

Table showing the top 5 warrants by fair value at the end of the reporting period. Columns include: 序号 (No.), 权证代码 (Warrant Code), 权证名称 (Warrant Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Ratio to Net Value).

8.9 投资组合报告附注
8.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的公允价值、投资占基金资产净值的比例与报告期内投资组合报告附注内容一致, 且与基金定期报告内容不存在重大差异。

Table showing the top 10 securities by fair value at the end of the reporting period. Columns include: 序号 (No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Ratio to Net Value).

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table showing the number of shareholders and their structure at the end of the reporting period. Columns include: 持有人户数 (Number of Shareholders), 户均持有的基金份额 (Average Shares per Household), 机构投资者 (Institutional Investors), 个人投资者 (Individual Investors).

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
9.2.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table showing the situation of fund managers holding the fund. Columns include: 项目 (Item), 持有基金份额(份) (Shares Held), 占基金总份额比例 (Ratio to Total Shares).

9.3 期末基金资产净值及基金份额
9.3.1 期末基金资产净值及基金份额

Table showing the net asset value and shares at the end of the reporting period. Columns include: 基金资产净值 (Net Asset Value), 基金份额 (Shares).

9.4 基金管理人及基金经营情况
9.4.1 基金管理人基本情况
基金管理人: 海富通基金管理有限公司
基金管理人主要人员情况: 董事长: 陈智勇, 总经理: 陈智勇, 副总经理: 陈智勇, 督察长: 陈智勇