海富通稳健添利债券型证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30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
报告送出日期:二〇一二年八月二十七日

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。本半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2012年8月24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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通稳健添利债券	
基金主代码	519023	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年10月24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	735,303,674.51份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通稳健添利债券A	海富通稳健添利债券C
下属分级基金的交易代码	519024	519023
报告期末下属分级基金的份额总额	454,793,734.49份	280,509,940.02份

2.2 基金产品说明

投资目标	在强调本金安全的基础上,积极追求资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金通过价值分析,采用自上而下确定投资策略,采取久期管理、类属配置和现金管理策略等积极投资策略,发现、确认并利用部分市场失衡,实现组合增值。
业绩比较基准	中证全债指数
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	奚万荣	赵会军
	联系电话	021-38650891	010-66105799
	电子邮箱	wrx@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-33830166	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2012年1月1日至2012年6月30日)	
	海富通稳健添利债券A	海富通稳健添利债券C
本期已实现收益	7,327,601.32	3,173,602.76
本期利润	23,997,795.78	10,309,311.66
加权平均基金份额本期利润	0.0842	0.0794
本期基金份额净值增长率	7.65%	7.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)	
	海富通稳健添利债券A	海富通稳健添利债券C
期末可供分配基金份额利润	0.0257	0.0195
期末基金资产净值	486,347,878.48	298,138,755.89
期末基金份额净值	1.069	1.063

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

海富通稳健添利债券A

阶段	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
过去一个月	1.04%	0.12%	0.45%	0.08%	0.59%	0.04%
过去三个月	6.05%	0.13%	2.42%	0.10%	3.63%	0.03%
过去六个月	7.65%	0.11%	3.09%	0.09%	4.56%	0.02%
过去一年	3.59%	0.18%	7.73%	0.11%	-4.14%	0.07%
过去三年	13.62%	0.24%	12.26%	0.12%	1.36%	0.12%
自基金合同生效起至今	12.52%	0.23%	12.18%	0.12%	0.34%	0.11%

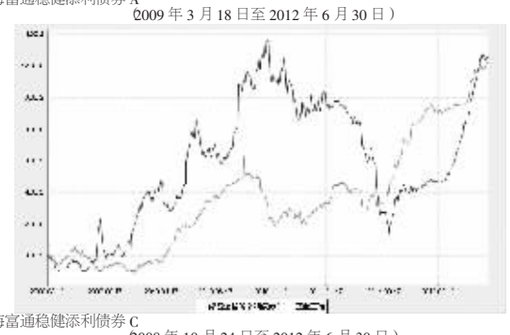
海富通稳健添利债券C

阶段	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
过去一个月	1.05%	0.15%	0.45%	0.08%	0.60%	0.07%
过去三个月	6.09%	0.14%	2.42%	0.10%	3.67%	0.04%
过去六个月	7.59%	0.12%	3.09%	0.09%	4.50%	0.03%
过去一年	3.20%	0.18%	7.73%	0.11%	-4.53%	0.07%
过去三年	12.66%	0.24%	12.26%	0.12%	0.40%	0.12%
自基金合同生效起至今	15.59%	0.23%	15.69%	0.14%	-0.10%	0.09%

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

海富通稳健添利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历史走势对比图

海富通稳健添利债券A
(2009年3月18日至2012年6月30日)



海富通稳健添利债券C
(2008年10月24日至2012年6月30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章(二)投资范围、(六)投资限制中规定的各项比例。

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]48号文批准,由海通证券股份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控股公司")于2003年4月1日共同发起设立。本海富通稳健添利债券型证券投资基金是基金管理人管理的第九只公募基金;除本基金外,基金管理人目前还管理着海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势股票型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选股票型证券投资基金、海富通领先成长股票型证券投资基金、海富通中证100指数证券投资基金(LOF)、海富通中小盘股票型证券投资基金、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、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选股票型证券投资基金、上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳进增利分级债券型证券投资基金和海富通国策导向股票型证券投资基金十九只公募基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邵佳民	本基金的基金经理;海富通强化回报混合基金经理;海富通稳固收益债券基金经理;固定收益组合管理部总监	2008-10-24	-	15年	中国国籍,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业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资部经理。2003年4月任海富通基金管理有限公司固定收益分析师,2005年1月至2008年1月担任海富通货币基金经理。2006年5月起任海富通强化回报混合基金经理。2007年10月起任固定收益组合管理部总监,2008年10月起兼任海富通稳健添利债券基金经理,2010年11月起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。

2、证券从业年限的计算标准为:自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司根据证监会2011年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求,持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时,公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度,公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部、监察稽核部和风险管理部组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控,保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内,公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析,并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的样本,对其进行了95%置信区间,假设溢价率为0的T分布检验,检验结果表明,在T日、T+3日和T+5日不同循环期内,不管是买入或是卖出,公司各组合间买卖价差不显著,表明报告期内公司对旗下各基金进行了公平对待,不存在各投资组合之间进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年上半年,消费物价指数(CPI)连续下降,从一月份的4.5%下降到五月份的3%;而下半年预计进一步走低。经济活动也呈现收缩趋势,虽然3月和4月有所反弹,但年初和5、6月的PMI指数均稍微高于50。大宗商品的价格下跌,NYMEX原油价格从年初的100美元/桶以上,6月份一度跌到80美元以下。为了应对经济增长下行的态势,中央银行在2月和5月份降低存款准备金率的基础上,6月8日启动了2012年的第一次降息,同时放松对存款利率的控制。

债券市场上半年平稳上涨,5月份受到降低存款准备金率的影响,上涨最为显著,上证企债指数(000013)罕见地连续20根阳线。前两个月上涨的主流品种是中期票据,而3月到5月的主战场转移到以城投债为代表的中低等级信用债券,利率债的上涨则主要在5月份以后。综合来看,中低等级信用债上涨幅度最大。从指数看,上半年上证国债指数(000012.SH)上涨1.76%,上证企债指数(000013.SH)上涨4.73%。

基金在上半年保持较高的投资比例,对高票面利率和期限长的债券进行重点投资。基金经理加大研究力度,认真分析投资品种的信用风险;根据流动性管理的需要,合理配置各大类债券资产。根据对权益类市场的判断及降低组合波动度的需要,对权益市场谨慎投资,没有新增对权益类资产的投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通稳健添利债券C类基金净值增长率为7.59%,同期业绩比较基准收益率为3.09%;海富通稳健添利债券A类基金净值增长率为7.65%,同期业绩比较基准收益率为3.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为,下半年尤其是第三季度的市场环境仍有利于债券市场。由于世界经济前景不明以及大宗商品尤其是石油价格的下跌,未来两个季度的CPI可能较低、平均值可能低于5月份的3%,三季度可能出现低于2%的月份,基准利率仍有下调的压力。国内的经济增长速度仍不乐观,虽然政府会加大经济刺激的力度,但边际效应无疑将递减;房地产调控有放松的可能,但预计带给市场的并不是惊喜,而是对长期经济前景的担心。股票市场目前的估值水平和国际市场比较并没有太大的优势,行情仍然是结构性的。人民币汇率问题将对宏观经济的放松有一定制约。我们认为,三季度的债券市场仍值得一定期待,但随着收益率的下降,需要逐渐增加资产的防御性;尤其是信用风险,年底有重新抬头的可能。

我们将继续保持较高的信用债券投资比例,严格控制信用风险和流动性风险,并适当调整持仓结构,努力控制组合的回下波动,力争为持有人带来稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值委员会,委员会成员具有3年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能,并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。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评估报告,以便估值委员会决策。估值政策经估值委员会审阅同意,并经本公司业务管理委员会批准后实施。

基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

除了投资总监外,其他基金经理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。但是对于非活跃投资品种,基金经理可以向估值工作小组提供估值建议。

上述参与估值流程各方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,每次分配比例不得低于可供分配收益的20%。

本基金本报告期内未进行利润分配,但符合基金合同规定。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012年上半年,本基金托管人在对海富通稳健添利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规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年上半年,海富通稳健添利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健添利债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,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规定进行。本报告期内,海富通稳健添利债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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健添利债券型证券投资基金2012年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:海富通稳健添利债券型证券投资基金

报告截止日:2012年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资产:		
银行存款	11,238,358.12	4,698,482.60
结算备付金	6,166,047.25	1,407,214.88
存出保证金	166,666.68	250,000.02
交易性金融资产	889,489,880.11	290,120,545.10
其中:股票投资	-	30,000.00
基金投资	-	-
债券投资	889,489,880.11	290,090,545.10
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	5,012,809.71
应收利息	11,318,513.32	3,813,821.65
应收股利	-	-
应收申购款	3,071,222.17	28,830.53
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	921,450,687.65	305,331,704.49
负债和所有者权益	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	130,000,000.00	15,000,000.00
应付证券清算款	40,558.58	4,184,829.82
应付赎回款	3,905,500.38	261,388.31
应付管理人报酬	410,253.85	56,733.73
应付托管费	126,231.95	17,456.50
应付销售服务费	73,260.12	19,703.41
应付交易费用	1,880.28	984.66
应交税费	1,209,621.72	1,070,740.12
应付利息	16,725.53	623.54
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,180,020.87	1,360,000.00
负债合计	136,964,053.28	21,972,460.09
所有者权益:		
实收基金	735,303,674.51	285,879,822.49
未分配利润	49,182,959.86	-2,520,578.09
所有者权益合计	784,486,634.37	283,359,244.40
负债和所有者权益总计	921,450,687.65	305,331,704.49

注:报告截止日2012年6月30日,A类基金份额净值1.069元,C类基金份额净值1.063元,基金份额总额735,303,674.51份,其中A类基金份额454,793,734.49份,C类基金份额280,509,940.02份。

6.2 利润表

会计主体:海富通稳健添利债券型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
一、收入	38,352,854.91	-5,351,711.37
1.利息收入	10,250,996.84	1,857,933.31
其中:存款利息收入	109,498.74	55,713.09
债券利息收入	10,079,597.36	1,786,953.45
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	61,900.74	15,266.77
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	4,265,076.03	37,529.52
其中:股票投资收益	-7,490.00	2,725,549.36
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,272,566.03	-2,688,019.84
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	23,805,903.36	-7,273,119.83
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	30,878.68	25,945.63
减:二、费用	4,045,747.47	1,563,991.32
1.管理人报酬	1,354,871.09	653,115.10
2.托管费	416,883.55	200,958.47
3.销售服务费	195,074.99	225,166.50
4.交易费用	12,028.13	123,454.83
5.利息支出	1,871,671.33	167,599.03
其中:卖出回购金融资产支出	1,871,671.33	167,599.03
6.其他费用	195,218.38	193,697.39
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	34,307,107.44	-6,915,702.69
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	34,307,107.44	-6,915,702.69

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通稳健添利债券型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	285,879,822.49	-2,520,578.09	283,359,244.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	34,307,107.44	34,307,107.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	449,423,852.02	17,396,430.51	466,820,282.53
其中:1.基金申购款	570,050,929.08	24,305,221.31	594,356,150.39
2.基金赎回款	-120,627,077.06	-6,908,790.80	-127,535,867.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	735,303,674.51	49,182,959.86	784,486,634.37
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	392,904,562.16	33,606,453.09	426,511,015.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,915,702.69	-6,915,702.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-293,986,718.45	-17,940,529.25	-311,927,247.70
其中:1.基金申购款	8,928,221.22	485,334.88	9,413,556.10
2.基金赎回款	-302,914,939.67	-18,425,864.13	-321,340,803.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-5,801,427.71	-5,801,427.71
五、期末所有者权益(基金净值)	98,917,843.71	2,948,793.44	101,866,637.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:田仁灿,主管会计工作负责人:阎小庆,会计机构负责人:高勇前

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通稳健添利债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2008]第985号《关于核准海富通稳健添利债券型证券投资基金募集的批复》核准,由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通稳健添利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,179,417,841.93元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第157号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通稳健添利债券型证券投资基金基金合同》于2008年10月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,180,077,343.35份基金份额,其中认购资金利息折合659,501.42份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《海富通稳健添利债券型证券投资基金基金合同》和《海富通稳健添利债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,自2009年3月18日起,本基金根据申购费用、赎回费用及销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用,不收取销售服务费的,称为A类基金份额;不收取前端申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通稳健添利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为依法公开发行、上市的债券,包括国债、金融债、公司债券,可转换债券,资产支持证券,中央银行票据,债券回购,银行定期存款,大额存单以及中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金投资于债券类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%。为了提高收益水平,本基金还可以投资于新股申购、持有可转债转股所得股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但上述非固定收益类金融工具的投资比例不超过基金资产的20%,本基金不直接从二级市场买入股票。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为中证全债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于2012年8月27日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通稳健添利债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金20112年6月30日的财务状况以及2012年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金报告期内无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,354,871.09	653,115.10
其中:支付销售机构的客户维护费	82,946.10	107,908.08

注:支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.65%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值X 0.65%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	416,883.55	200,958.47

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值X 0.20%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通稳健添利债券A	海富通稳健添利债券C	合计
中国工商银行	-	66,517.96	66,517.96
海通证券	-	223.07	223.07
海富通	-	61,087.50	61,087.50
合计	-	127,828.53	127,828.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通稳健添利债券A	海富通稳健添利债券C	合计
中国工商银行	-	79,837.38	79,837.38
海通证券	-	665.39	665.39
海富通	-	53,076.70	53,076.70
合计	-	133,579.47	133,579.47

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类份额对应的基金资产净值的年费率0.30%计提,逐日累计至每月月底,按月支付给海富通基金管理有限公司,再由海富通基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为:日销售服务费=前一日C类份额对应的基金资产净值X 0.30%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	11,238,358.12	63,319.41	4,355,809.83	48,571.67

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2012年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股/张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
122148	11吉高速	2012-06-26	2012-07-11	新债流通受限	99.93	99.93	400,000	39,971,068.49	39,971,068.49	-
1280185	12普洱债	2012-06-21	2012-07-04	新债流通受限	99.98	99.98	100,000	9,998,382.47	9,998,382.47	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2012年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额130,000,000.00元,于2012年7月6日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	889,489,880.11	96.53
	其中:债券	889,489,880.11	96.53
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	17,404,405.37	1.89
6	其他各项资产	14,556,402.17	1.58
7	合计	921,450,687.65	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

本基金本报告期内无买入股票。

7.4.2 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002650	加加食品	22,510.00	0.01

注:“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	-
卖出股票的收入(成交)总额	22,510.00

注:“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)