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:二〇一三年三月二十七日

海富通稳固收益债券型证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31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 2013 年 3 月 26 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 2012 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	324,699,142.63 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	奚万荣	赵会军
	联系电话	021-38650891	010-66105799
	电子邮箱	wrxi@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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.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	2012年	2011年	2010年 11 月 23 日(基金合同生效日)至 2010 年 12 月 31 日
本期已实现收益	37,118,825.13	-21,807,876.66	14,452,822.76
本期利润	41,149,098.57	-17,381,097.99	12,653,779.01
加权平均基金份额本期利润	0.0897	-0.0163	0.0047
本期基金份额净值增长率	8.41%	-2.99%	0.50%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	0.0541	-0.0321	0.0047
期末基金资产净值	343,347,095.20	627,067,376.48	2,709,526,676.90
期末基金份额净值	1.057	0.975	1.005

注:1、本基金合同生效日为 2010 年 11 月 23 日。

2、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。

3、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。

4、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

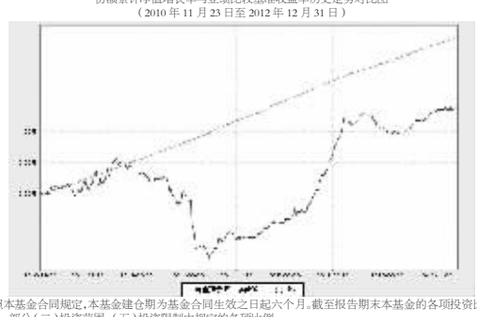
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.44%	0.07%	1.05%	0.01%	0.39%	0.06%
过去六个月	1.15%	0.09%	2.13%	0.01%	-0.98%	0.08%
过去一年	8.41%	0.11%	4.62%	0.01%	3.79%	0.10%
自基金合同生效起至今	5.70%	0.16%	10.06%	0.01%	-4.36%	0.15%

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历史走势对比图

(2010 年 11 月 23 日至 2012 年 12 月 31 日)

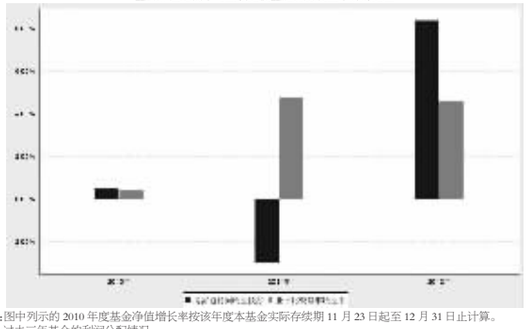


注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分(二)投资范围、(五)投资限制中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来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

基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



注:图中列示的 2010 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 11 月 23 日起至 12 月 31 日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位: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
2012	-	-	-	-	-
2011	-	-	-	-	-
2010	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注:本基金合同于 2010 年 11 月 23 日生效,未实施利润分配。

§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]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。本海富通稳固收益债券型证券投资基金是基金管理人管理的第十五只公募基金;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、海富通精选或弓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、海富通稳健添利债券型证券投资基金、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、海富通稳建增利分级债券型证券投资基金、海富通国策导向股票型证券投资基金和海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金二十只公募基金。

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(助理)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;海富通稳健添利债券基金经理;海富通强化回报混合基金经理;投资副总监	2010-11-23	-	15年	中国籍,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 月至 2013 年 1 月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,2013 年 1 月起任投资副总监。

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: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 公平交易制度和执行情况

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。同时,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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易,保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内,对公司旗下所有投资组合的整体收益率差异、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)公司管理的不同投资组合同向交易的样本,对其进行了 95%置信区间,假设溢价率为 0 的 T 分布检验,结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明,报告期内公司对旗下各投资组合公平对待,不存在利益输送的行为。

4.3.3 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,未发生投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年,经济增长速度有所降低,全年 GDP 增长 7.8%,而物价上涨减缓,CPI 上涨 2.6%。宏观经济为债券市场提供了良好的投资环境。中央银行放松了货币政策,全年下调存款准备金率和利率各两次。利率市场化也开始启动,商业银行的居民存款利率允许在一定范围内浮动,商业银行理财产品规模也呈现爆发式增长。

从债券市场看,2012 年一级市场发行高速度增长,中低信用等级的债券增加更多。城投企业获得贷款的难度增加,他们更多地转向债券市场。2012 年新发行城投债数量相对于 2011 年,增长 200%以上。由于政府主管部门从防范风险的角度出发,加强了制度建设,城投债在信用方面带给投资者的压力减少。其他信用品种中,个别发行人出现了信用事件,但在市场各方的积极参与下,均平稳度过。

因此,2012 年债券市场整体上涨,低信用等级品种表现更好。以代表性的七年期 AA 级别城投债为例,发行利率从年初的 8%以上降低到年底的 7%以下。由于企业盈利数据不理想,投资者信心受到影响,股票市场全年表现不佳,并带动可转换债券持续调整。

2012 年管理人的总体投资策略是,对中等信用资质的中长期债券进行重点投资和集中投资,减少和低配权益类资产,以获得超额收益。基金部分采用了杠杆策略,加大投资力度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通稳固收益债券型证券投资基金净值增长率为 8.41%,同期业绩比较基准收益率为 4.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基金管理人认为,2013 年债券市场当以谨慎为主。目前货币政策已经实质性地转向宽松,加上全球普遍性的货币宽松行为,在给股票市场带来支持的同时,超给债券市场带来了通货膨胀的担忧。降低融资成本,增加直接融资等要求,客观上会推动更多的信用债发行。在股票市场有所表现时,场外资金是否继续支持需要研究。目前债券市场已经积累了一定涨幅,有一定的获利回吐压力。如果再看长远一些,债券市场的基本面并无大的问题。降低融资成本,需要在基准利率、市场利率上做文章,整体利率水平应该趋于下降;整个社会虽然可能短期加杠杆,但中期应该降杠杆,对债券市场也形成支撑。通货膨胀有可能形成短期上升趋势,看中期走势应该可控。从目前看,短期股票市场的表现可能优于债券。

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,并经本公司总裁办公会批准后实施。

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,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,本基金托管人在对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规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012 年,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,海富通稳固收益债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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固收益债券型证券投资基金 2012 年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 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 年度财务报表

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:2012 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年 12 月 31 日	上年度末 2011年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	9,516,511.58	16,707,216.12
结算备付金	1,312,984.13	5,008,517.72
存出保证金	352,109.66	390,070.89
交易性金融资产	306,590,165.80	597,793,487.30
其中:股票投资	5,673,461.04	478,150.00
基金投资	-	-
债券投资	300,916,704.76	597,315,337.30
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	24,000,000.00	8,000,000.00
应收证券清算款	-	1,981,411.22
应收利息	7,874,977.42	6,846,500.47
应收股利	-	-
应收申购款	25,659.37	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	349,672,407.96	636,727,203.72
负债和所有者权益	本期末 2012年 12 月 31 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	-	-
应付证券清算款	3,412,345.23	4,315,903.67
应付赎回款	1,133,131.65	3,079,957.72
应付管理人报酬	235,806.84	389,026.07
应付托管费	67,373.37	111,150.32
应付销售服务费	134,746.76	222,300.61
应付交易费用	43,978.82	363,288.32
应交税费	927,560.53	795,200.53
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	370,369.56	383,000.00
负债合计	6,325,312.76	9,659,827.24
所有者权益:		
实收基金	324,699,142.63	643,243,973.85
未分配利润	18,647,952.57	-16,176,597.37
所有者权益合计	343,347,095.20	627,067,376.48
负债和所有者权益总计	349,672,407.96	636,727,203.72

注:报告截止日 2012 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.057 元,基金份额总额 324,699,142.63 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

本报告期:2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
一、收入	50,951,538.38	2,763,761.10
1.利息收入	20,657,423.45	20,269,375.03
其中:存款利息收入	207,528.16	976,819.10
债券利息收入	20,286,015.20	15,352,573.05
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	163,880.09	3,939,982.88
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	26,121,892.34	-22,023,423.05
其中:股票投资收益	1,733,489.22	875,066.16
基金投资收益	-	-
债券投资收益	24,388,403.12	-23,130,684.71
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	232,195.50
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	4,030,273.44	4,426,778.67
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	141,949.15	91,030.45
减:二、费用	9,802,439.81	20,144,859.09
1.管理人报酬	3,297,192.21	7,706,259.79
2.托管费	942,054.87	2,201,788.54
3.销售服务费	1,884,109.84	4,403,577.04
4.交易费用	783,608.20	5,026,468.73
5.利息支出	2,482,743.05	401,360.76
其中:卖出回购金融资产支出	2,482,743.05	401,360.76
6.其他费用	412,731.64	405,404.23
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	41,149,098.57	-17,381,097.99
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	41,149,098.57	-17,381,097.99

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通稳固收益债券型证券投资基金

本报告期:2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2012年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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)	643,243,973.85	-16,176,597.37	627,067,376.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	41,149,098.57	41,149,098.57
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)	-318,544,831.22	-6,324,548.63	-324,869,379.85
其中:1.基金申购款	187,377,608.76	8,411,526.22	195,789,134.98
2.基金赎回款	-505,922,439.98	-14,736,074.85	-520,658,514.83
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)	324,699,142.63	18,647,952.57	343,347,095.20
项目	上年度可比期间 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 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)	2,696,872,897.89	12,653,779.01	2,709,526,676.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-17,381,097.99	-17,381,097.99
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)	-2,053,628,924.04	-11,449,278.39	-2,065,078,202.43
其中:1.基金申购款	92,712,022.45	857,202.46	93,569,224.91
2.基金赎回款	-2,146,340,946.49	-12,306,480.85	-2,158,647,427.34
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)	643,243,973.85	-16,176,597.37	627,067,376.48

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4,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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海富通稳固收益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[2010]983 号文核准募集。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 2,695,857,578.55 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(2010)第 314 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通稳固收益债券型证券投资基金基金合同》于 2010 年 11 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,696,872,897.89 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,015,319.34 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《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通稳固收益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具有良好流动性的金融工具,主要投资于国内依法发行上市的固定收益类品种,包括公司债券、企业债券、可转换债券、短期融资券、金融债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购等,同时投资于股票、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资于债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%,本基金可以参与一级市场新股申购以及在二级市场上投资股票、权证等权益类证券,投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%,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:三年期银行定期存款利率(税后)。

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 2013 年 3 月 22 日批准报出。

7.4.2 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")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通稳固收益债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的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。

7.4.3 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[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) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(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支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。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。

(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。

7.4.7 关联方关系

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、基金销售机构
海通证券股份有限公司("海通证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
法国巴黎投资管理 BE 控股公司 (BNP Paribas Investment Partners BE Holding)	基金管理人的股东

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,297,192.21	7,706,259.79
其中:支付销售机构的客户维护费	1,380,319.45	3,296,949.05

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 0.70%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 0.70% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	942,054.87	2,201,788.54

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。

7.4.8.2.3 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 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国工商银行	1,553,993.19
海通证券	1,512.45
海富通基金管理有限公司	141,687.07
合计	1,697,192.71
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 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国工商银行	3,632,899.68
海通证券	1,510.15
海富通基金管理有限公司	255,886.20
合计	3,890,296.03

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.4%的年费率计提,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=前一日基金资产净值 X 0.4%/ 当年天数。

7.4.8.3 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通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金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。

7.4.8.4.2 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

本基金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。

7.4.8.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 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	9,516,511.58	155,570.50	16,707,216.12	842,159.18

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2012年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
海通证券	113003	重工转债	首次公开发行	20,670	2,067,000.00
上年度可比期间 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末(2012 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2012 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 182,155,165.80 元,属于第二层级的余额为 124,435,000.00 元,无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日:第一层级 433,901,487.30 元,第二层级 163,892,000.00 元,无属于第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	5,673,461.04	1.62
	其中:股 票	5,673,461.04	1.62
2	固定收益投资	300,916,704.76	86.06
	其中:债 券	300,916,704.76	86.06
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	24,000,000.00	6.86
	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	10,829,495.71	3.10
6	其他各项资产	8,252,746.45	2.36
7	合计	349,672,407.96	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A