

# 海富通稳固收益债券型证券投资基金

## 2014 年半年度报告

### 2014 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：二〇一四年八月二十九日

## 1 重要提示及目录

### 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 2014 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示 .....	2
1.2	目录 .....	3
2	基金简介 .....	5
2.1	基金基本情况 .....	5
2.2	基金产品说明 .....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式 .....	6
2.5	其他相关资料 .....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现 .....	7
4	管理人报告 .....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
5	托管人报告 .....	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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 .....	13
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	14
6	半年度财务会计报告（未经审计） .....	14
6.1	资产负债表 .....	14
6.2	利润表 .....	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4	报表附注 .....	19
7	投资组合报告 .....	38
7.1	期末基金资产组合情况.....	38
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	38
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	40
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	40
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	40
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	40

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12	投资组合报告附注.....	41
8	基金份额持有人信息.....	43
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	43
9	开放式基金份额变动.....	43
10	重大事件揭示.....	44
10.1	基金份额持有人大会决议.....	44
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4	基金投资策略的改变.....	44
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8	其他重大事件.....	46
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	47
12	备查文件目录.....	48
12.1	备查文件目录.....	48
12.2	存放地点.....	48
12.3	查阅方式.....	48

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通稳固收益债券型证券投资基金
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	112,404,566.05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
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴花园 石桥路 66 号东亚银行金融大 厦 36-37 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴花园 石桥路 66 号东亚银行金融 大厦 36-37 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		张文伟	姜建清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### 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（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	3,117,197.28
本期利润	8,144,598.14
加权平均基金份额本期利润	0.0508
本期加权平均净值利润率	4.53%
本期基金份额净值增长率	4.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2014 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	17,172,092.83
期末可供分配基金份额利润	0.1528
期末基金资产净值	129,576,658.88
期末基金份额净值	1.153
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2014 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	15.30%

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	------------	-----	-----

		②		准差④		
过去一个月	1.23%	0.18%	0.35%	0.01%	0.88%	0.17%
过去三个月	3.32%	0.14%	1.04%	0.01%	2.28%	0.13%
过去六个月	4.91%	0.16%	2.09%	0.01%	2.82%	0.15%
过去一年	4.44%	0.16%	4.25%	0.01%	0.19%	0.15%
过去三年	14.16%	0.18%	14.11%	0.01%	0.05%	0.17%
自基金合同 生效起至今	15.30%	0.18%	17.13%	0.01%	-1.83%	0.17%

### 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2014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部分（二）投资范围、（五）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、海富通稳进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、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通现金管理货币市场基金、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、海富通双利分级债券型证券投资基金、海富通内需热点股票型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双福分级债券型证券投资基金二十七只公募基金。

#### 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；海富通稳健添利债券基金	2010-11-23	-	17 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业务助理、债券销售

	经理；海富通强化回报混合基金经理；海富通稳进增利分级债券基金经理；投资副总监			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 月起任投资副总监并兼任海富通稳进增利分级债券基金经理。
--	--	--	--	--

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：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合规守信情况的说明

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并不显著，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

2014 年上半年的债券市场走出了持续的上涨行情。随着经济增长速度下降，政府更多地要求“稳增长”，货币政策也转向宽松。首先，中央银行开始向市场投放资金；其次，开启定向降准，降低部分金融机构的法定存款准备金率。2013 年的持续调整，使得债券收益率达到相当高的水平。十年期政策性金融债达到 5.8%，主流城投债则普遍在 8%附近。资金面的宽松推动了债券市场的上涨。一季度的上涨相对温和，市场还处于“半信半疑”的状态，十年期政策性金融债的收益率从 5.8%附近的超调状态恢复到 5.5%左右的均衡水平，主流城

投债的收益率则下降到 8%以下。一季度末资金面的平稳和经济数据的下行，刺激了二季度的债券行情。四月份开始，债券收益率逐级下降，市场热情逐渐点燃，更多的资金入场。随着更多“微刺激”的政策出台，市场的做多情绪始终浓厚。到二季度末，政策性金融债收益率下降到 5%以内，主流城投债收益率则在 7%以内，投资者获利较多。虽然二季度信用事件也有所发生，交易所市场对信用债折算为回购标准券的要求越来越严格，但信用债总体呈现稳定上涨的局面，部分私有公司的债券发行则遇到困难，中小企业私募债的新发行陷入冰点。可转债方面，虽然存在一定的投资价值，但受制于股票市场的不景气，可转债的表现总体一般，个别品种有独立表现。

基金在第一季度对信用债以持有为主，对转债进行了波段操作。二季度加仓了部分政策性金融和信用债。

#### 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基金净值增长率为 4.91%，同期业绩比较基准收益率为 2.09%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基金管理人认为，2014 年下半年，债券市场需要保持一定的谨慎，尤其是第三季度。主要原因是：货币政策不会有大力度的放松，除银行间市场外，实体经济的资金面仍然偏紧，贷款利率居高不下，对发债有较强需求。主流机构的配置需求得到一定的满足，在收益率下降的条件下，没有大规模增加配置的动力。基本面可能有所好转，投资者的风险偏好可能上升。低等级信用债和可转债的机会在临近。随着整体信用风险的上升，投资者需要对信用债精挑细选。我们将以中高等级信用债为基础，谨慎配置权益类资产，严格控制信用风险和流动性风险，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**

2014 年上半年,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**

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固收益债券型证券投资基金 2014 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：海富通稳固收益债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,371,539.42	4,394,315.64
结算备付金		887,119.99	1,357,179.94
存出保证金		20,961.22	34,353.49
交易性金融资产	6.4.7.2	118,511,750.00	189,187,200.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		118,511,750.00	189,187,200.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	8,000,000.00	20,000,000.00
应收证券清算款		1,004,175.00	-
应收利息	6.4.7.5	2,336,380.85	5,154,180.01
应收股利		-	-

应收申购款		14,121.10	200.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		132,146,047.58	220,127,429.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2014年6月30日</b>	<b>2013年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,089,258.05	981,211.36
应付赎回款		123,882.66	276,859.86
应付管理人报酬		90,229.46	132,578.57
应付托管费		25,779.84	37,879.58
应付销售服务费		51,559.67	75,759.19
应付交易费用	6.4.7.7	600.00	5,664.23
应交税费		1,009,560.53	1,009,560.53
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	178,518.49	360,000.00
负债合计		2,569,388.70	2,879,513.32
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	112,404,566.05	197,684,175.89
未分配利润	6.4.7.10	17,172,092.83	19,563,739.87
所有者权益合计		129,576,658.88	217,247,915.76
负债和所有者权益总计		132,146,047.58	220,127,429.08

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.153 元，基金份额总额 112,404,566.05 份。

## 6.2 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>9,690,130.09</b>	<b>17,002,579.48</b>
1.利息收入		4,830,254.93	4,746,306.22
其中：存款利息收入	6.4.7.11	27,211.92	62,735.99
债券利息收入		4,683,921.40	4,613,184.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		119,121.61	70,385.35
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-175,329.51	17,571,985.19
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-604,740.04	-753,621.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	429,410.53	18,325,607.10
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.17	5,027,400.86	-5,330,479.08

“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	7,803.81	14,767.15
<b>减: 二、费用</b>		<b>1,545,531.95</b>	<b>2,615,098.82</b>
1. 管理人报酬		624,572.20	969,483.19
2. 托管费		178,449.20	276,995.22
3. 销售服务费		356,898.41	553,990.35
4. 交易费用	6.4.7.19	10,254.46	205,484.05
5. 利息支出		177,807.19	405,768.12
其中: 卖出回购金融资产支出		177,807.19	405,768.12
6. 其他费用	6.4.7.20	197,550.49	203,377.89
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>8,144,598.14</b>	<b>14,387,480.66</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>8,144,598.14</b>	<b>14,387,480.66</b>

### 6.3 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: 2014年1月1日至2014年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期		
	2014年1月1日至2014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)	197,684,175.89	19,563,739.87	217,247,915.76

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,144,598.14	8,144,598.14
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）	-85,279,609.84	-10,536,245.18	-95,815,855.02
其中：1. 基金申购款	2,656,675.04	348,473.64	3,005,148.68
2. 基金赎回款	-87,936,284.88	-10,884,718.82	-98,821,003.70
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）	112,404,566.05	17,172,092.83	129,576,658.88
项目	上年度可比期间		
	2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	324,699,142.63	18,647,952.57	343,347,095.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,387,480.66	14,387,480.66
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）	-112,214,107.31	-11,029,148.19	-123,243,255.50
其中：1. 基金申购款	52,324,425.21	5,016,599.21	57,341,024.42
2. 基金赎回款	-164,538,532.52	-16,045,747.40	-180,584,279.92
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）	212,485,035.32	22,006,285.04	234,491,320.36

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：

基金管理人负责人：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

海富通稳固收益债券型证券投资基金（以下简称为“本基金”或“基金”）经 2010 年 7 月 23 日中国证券监督管理委员会证监许可【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。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 2014 年 8 月 28 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》、《海富通稳固收益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 2014 年上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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上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》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税,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 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末
	2014 年 6 月 30 日
活期存款	1,371,539.42
定期存款	-
存款期限 1 月以内	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	1,371,539.42

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末			
	2014年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	75,934,226.09	77,573,750.00	1,639,523.91
	银行间市场	41,498,355.34	40,938,000.00	-560,355.34
	合计	117,432,581.43	118,511,750.00	1,079,168.57
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	117,432,581.43	118,511,750.00	1,079,168.57	

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	8,000,000.00	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	8,000,000.00	-

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	2,182.15
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	359.28
应收债券利息	2,333,830.96
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	8.46
合计	2,336,380.85

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	600.00
合计	600.00

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	178,518.49
合计	178,518.49

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	197,684,175.89	197,684,175.89
本期申购	2,656,675.04	2,656,675.04
本期赎回（以“-”号填列）	-87,936,284.88	-87,936,284.88
本期末	112,404,566.05	112,404,566.05

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,304,096.11	-9,740,356.24	19,563,739.87
本期利润	3,117,197.28	5,027,400.86	8,144,598.14
本期基金份额交易产生的变动数	-13,704,743.10	3,168,497.92	-10,536,245.18
其中：基金申购款	429,271.30	-80,797.66	348,473.64
基金赎回款	-14,134,014.40	3,249,295.58	-10,884,718.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,716,550.29	-1,544,457.46	17,172,092.83

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	20,875.12
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,104.25
其他	232.55
合计	27,211.92

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	3,223,699.86
减：卖出股票成本总额	3,828,439.90
买卖股票差价收入	-604,740.04

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	193,415,929.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	190,274,428.86
减：应收利息总额	2,712,090.01
债券投资收益	429,410.53

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	5,027,400.86
——股票投资	-
——债券投资	5,027,400.86
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	5,027,400.86

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	7,746.74
基金转换费收入	57.07
合计	7,803.81

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中赎回费全额归入转出基金的基金资产。

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	9,304.46
银行间市场交易费用	950.00
合计	10,254.46

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	632.00
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	400.00
合计	197,550.49

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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（“海富通”）	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	基金托管人、基金销售机构

行”)	
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

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末及上年度可比期间通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 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。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	624,572.20	969,483.19
其中：支付销售机构的客户维护费	196,036.97	360,539.01

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。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	178,449.20	276,995.22

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.3 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
	2014年1月1日至2014年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国工商银行	208,066.97
海通证券	667.26
海富通	109,422.56
合计	318,156.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国工商银行	393,057.21
海通证券	869.83
海富通	97,994.54
合计	491,921.58

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日该类基金资产净值 0.40%的年费率计提。

其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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可比期间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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	1,371,539.42	20,875.12	7,461,152.76	44,878.28

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。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌流通受限证券。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.3.2 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型证券投资基金，属于中低风险品种。本基金投资的金融工具主要为股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险管理委员会，实施董事会风险委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的四层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行

存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
A-1	-	9,939,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	19,856,000.00
合计	-	29,795,000.00

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
AAA	11,687,400.00	13,064,500.00
AAA 以下	74,747,350.00	146,327,700.00
未评级	32,077,000.00	-
合计	118,511,750.00	159,392,200.00

注：未评级债券为政策性金融债和国债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市

场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种,因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2014年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,371,539.42	-	-	-	1,371,539.42
结算备付 金	887,119.99	-	-	-	887,119.99
存出保证 金	20,961.22	-	-	-	20,961.22
交易性金 融资产	27,037,000.00	70,934,350.00	20,540,400.00	-	118,511,750.00
买入返售 金融资产	8,000,000.00	-	-	-	8,000,000.00
应收证券 清算款	-	-	-	1,004,175.00	1,004,175.00
应收利息	2,336,380.85	-	-	-	2,336,380.85
应收申购 款	3,100.00	-	-	11,021.10	14,121.10
资产总计	39,656,101.48	70,934,350.00	20,540,400.00	1,015,196.10	132,146,047.58
负债					
应付证券 清算款	-	-	-	1,089,258.05	1,089,258.05
应付赎回 款	-	-	-	123,882.66	123,882.66
应付管理 人报酬	-	-	-	90,229.46	90,229.46
应付托管	-	-	-	25,779.84	25,779.84

费					
应付销售 服务费	-	-	-	51,559.67	51,559.67
应付交易 费用	-	-	-	600.00	600.00
应交税费	-	-	-	1,009,560.53	1,009,560.53
其他负债	-	-	-	178,518.49	178,518.49
负债总计	-	-	-	2,569,388.70	2,569,388.70
利率敏感 度缺口	39,656,101.48	70,934,350.00	20,540,400.00	-1,554,192.60	129,576,658.88
上年度末 2013年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,394,315.64	-	-	-	4,394,315.64
结算备付 金	1,357,179.94	-	-	-	1,357,179.94
存出保证 金	34,353.49	-	-	-	34,353.49
交易性金 融资产	29,795,000.00	60,838,220.00	98,553,980.00	-	189,187,200.00
买入返售 金融资产	20,000,000.00	-	-	-	20,000,000.00
应收利息	-	-	-	5,154,180.01	5,154,180.01
应收申购 款	200.00	-	-	-	200.00
资产总计	55,581,049.07	60,838,220.00	98,553,980.00	5,154,180.01	220,127,429.08

负债					
应付证券 清算款	-	-	-	981,211.36	981,211.36
应付赎回 款	-	-	-	276,859.86	276,859.86
应付管理 人报酬	-	-	-	132,578.57	132,578.57
应付托管 费	-	-	-	37,879.58	37,879.58
应付销售 服务费	-	-	-	75,759.19	75,759.19
应付交易 费用	-	-	-	5,664.23	5,664.23
应交税费	-	-	-	1,009,560.53	1,009,560.53
其他负债	-	-	-	360,000.00	360,000.00
负债总计	-	-	-	2,879,513.32	2,879,513.32
利率敏感 度缺口	55,581,049.07	60,838,220.00	98,553,980.00	2,274,666.69	217,247,915.76

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。其中，本基金本报告期末持有的还本付息债券以最终到期日予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
	市场利率上升25个基点	减少约85.00万元	减少约167.00万元

市场利率下降25个基点	增加约86.00万元	增加约169.00万元
-------------	------------	-------------

注：影响金额为约数，精确到万元。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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、类属配置和现金流管理策略等积极投资策略，发现、确认并利用细分市场失衡，实现组合增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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%。

于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资(2013 年 12 月 31 日：同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2013 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14 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	118,511,750.00	89.68
	其中：债券	118,511,750.00	89.68
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	8,000,000.00	6.05
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,258,659.41	1.71
7	其他各项资产	3,375,638.17	2.55
8	合计	132,146,047.58	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所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600187	国中水务	3,828,439.90	1.76

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	600187	国中水务	3,223,699.86	1.48

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	3,828,439.90
卖出股票的收入(成交)总额	3,223,699.86

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 (%)
1	国家债券	12,061,000.00	9.31
2	央行票据	-	-

3	金融债券	20,016,000.00	15.45
	其中：政策性金融债	20,016,000.00	15.45
4	企业债券	59,360,500.00	45.81
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	27,074,250.00	20.89
8	其他	-	-
9	合计	118,511,750.00	91.46

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1280030	12 丹投债	200,000	20,922,000.00	16.15
2	130331	13 进出 31	200,000	20,016,000.00	15.45
3	111051	09 怀化债	100,000	10,640,000.00	8.21
4	122840	11 临汾债	100,000	10,350,000.00	7.99
5	019322	13 国债 22	70,000	7,021,000.00	5.42

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不参与股指期货交易。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 7.11.3 本基金投资国债期货的投资评价

根据本基金基金合同，本基金不参与国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的平安转债（113005）于 2013 年 10 月 15 日发布《中国平安保险(集团)股份有限公司关于平安证券收到中国证监会处罚事先告知书的公告》，因其控股子公司平安证券有限责任公司在万福生科（湖南）农业开发股份有限公司发行上市项目中没有遵循“合规经营、公开透明”的原则，中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科（湖南）农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币 2,555 万元，并处以人民币 5,110 万元的罚款，暂停其保荐机构资格 3 个月。

对该债券的投资决策程序的说明：该转债发行人是集保险、银行、投资等金融业务为一体的综合金融服务集团，主体和债项均为 AAA 评级，整体偿债能力较强，违约风险较低，是目前转债市场上唯一的保险公司转债，具有一定的投资价值。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该债券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的

股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	20,961.22
2	应收证券清算款	1,004,175.00
3	应收股利	-
4	应收利息	2,336,380.85
5	应收申购款	14,121.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,375,638.17

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110012	海运转债	6,147,000.00	4.74
2	113005	平安转债	5,341,000.00	4.12
3	127001	海直转债	4,923,850.00	3.80
4	110015	石化转债	4,318,800.00	3.33
5	110024	隧道转债	4,316,000.00	3.33
6	110011	歌华转债	2,027,600.00	1.56

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,516	44,675.90	14,233,858.25	12.66%	98,170,707.80	87.34%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	454.55	0.0004%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年11月23日)基金份额总额	2,696,872,897.89
本报告期期初基金份额总额	197,684,175.89
本报告期基金总申购份额	2,656,675.04
减：本报告期基金总赎回份额	87,936,284.88

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	112,404,566.05

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2014 年 6 月 14 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第四届董事会审议通过，同意陈洪先生辞去公司副总经理职务。

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
齐鲁证券	2	3,828,439.90	54.29%	2,719.71	67.27%	-
宏源证券	2	3,223,699.86	45.71%	1,322.99	32.73%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内退租日信证券交易单元 1 个。

#### 2、(1) 交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见。

#### (2) 交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成重点评估的证券公司备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见，并报公司总裁办公会议核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总裁办公会议核准。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
齐鲁证券	42,480,170.74	20.85%	223,000,000.00	20.43%	-	-
宏源证券	148,290,285.79	72.79%	868,400,000.00	79.57%	-	-
国金证券	12,954,971.71	6.36%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	海富通基金管理有限公司旗下基金2013年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2014-01-01
---	---	------------------------	------------

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 28 只公募基金。截至 2014 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模为 237 亿元人民币。

作为国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，截至 2014 年 6 月 30 日，海富通为 80 多家企业超过 311 亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司，截至 2014 年 6 月 30 日，海富通旗下专户理财管理资产规模近 54 亿元。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。

2004 年末开始，海富通为 QFII（合格境外机构投资者）及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问，截至 2014 年 6 月 30 日，投资咨询及海外业务规模超过 215 亿元人民币。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 2 月，海富通资产管理（香港）有限公司已募集发行了首只 RQFII 产品。

2012 年 3 月，国内权威财经媒体《中国证券报》等授予海富通基金管理有限公司“中国基金业金牛基金管理公司”大奖，《证券时报》授予海富通精选混合基金“2011 年中国基金业明星奖—五年持续回报平衡混合型明星基金”荣誉。2013 年 4 月，《上海证券报》授予海富通精选混合基金 2012 年“金基金”奖——分红基金奖。

海富通同时还在不断践行其社会责任。公司自 2008 年启动“绿色与希望—橄榄枝公益环保计划”，针对汶川震区受灾学校、上海民工小学、安徽老区小学进行了物资捐赠，向内蒙古库伦旗捐建了环保公益林。几年来，海富通的公益行动进一步升级，持续为上海民工小学学生捐献生活物资，并向安徽农村小学捐献图书室。此外，海富通还积极推进投资者教育工作，推出了以“幸福投资”为主题和特色的投资者教育活动，向投资者传播长期投资、理性

投资的理念。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准设立海富通稳固收益债券型证券投资基金的文件
- (二) 海富通稳固收益债券型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通稳固收益债券型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通稳固收益债券型证券投资基金托管协议
- (五) 中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六) 报告期内海富通稳固收益债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层本基金管理人办公地址。

### 12.3 查阅方式

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层本基金管理人办公地址。

海富通基金管理有限公司

二〇一四年八月二十九日