

**海富通稳健添利债券型证券投资基金**  
**2016 年半年度报告摘要**  
**2016 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：二〇一六年八月二十六日

## 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 2016 年 8 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 2016 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	
交易代码	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	490,270,414.71 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	466,629,378.29 份	23,641,036.42 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、确认并利用细分市场失衡，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	洪渊
	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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hffund.com">http://www.hffund.com</a>
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（2016年1月1日至2016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	13,473,651.09	822,448.19
本期利润	11,208,837.34	468,127.75
加权平均基金份额本期利润	0.0248	0.0161
本期基金份额净值增长率	2.00%	1.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016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	0.2299	0.2066
期末基金资产净值	595,197,172.38	29,589,131.74
期末基金份额净值	1.276	1.252

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	0.79%	0.06%	0.72%	0.05%	0.07%	0.01%
过去三个月	1.19%	0.07%	0.36%	0.06%	0.83%	0.01%
过去六个月	2.00%	0.07%	1.62%	0.06%	0.38%	0.01%
过去一年	6.51%	0.07%	7.10%	0.07%	-0.59%	0.00%
过去三年	14.44%	0.13%	18.29%	0.09%	-3.85%	0.04%
自基金合同生效起至今	34.31%	0.18%	36.45%	0.10%	-2.14%	0.08%

##### 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	0.72%	0.05%	0.72%	0.05%	0.00%	0.00%
过去三个月	1.05%	0.07%	0.36%	0.06%	0.69%	0.01%
过去六个月	1.87%	0.08%	1.62%	0.06%	0.25%	0.02%
过去一年	6.19%	0.07%	7.10%	0.07%	-0.91%	0.00%
过去三年	13.30%	0.14%	18.29%	0.09%	-4.99%	0.05%
自基金合同生效起至今	36.14%	0.18%	40.72%	0.11%	-4.58%	0.07%

#### 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

1. 海富通稳健添利债券 A

(2009 年 3 月 18 日至 2016 年 6 月 30 日)



2. 海富通稳健添利债券 C

(2008 年 10 月 24 日至 2016 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。截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 33 只公募基金：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、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、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、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、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、海富通稳进增利债券型证券投资基金（LOF）、海富通国策导向混合型证券投资基金、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、海富通双福分级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、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动混合型证券投资基金。

#### 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		
谈云飞	本基金的基 金经理；海 富通季季增 利理财债券	2015-01- 23	-	11 年	硕士，持有基金从业人员 资格证书。2005 年 4 月至 2014 年 6 月就职于华宝兴 业基金管理有限公司，曾

	基金经理： 海富通新内需混合基金 经理；海富通货币基金 经理；海富通双福分级 债券基金经理；海富通 双利债券基金经理；海 富通养老收益混合基金 经理；海富通纯债债券 基金经理			任产品经理、研究员、专 户投资经理、基金经理助 理，2014 年 6 月加入海富 通基金管理有限公司。 2014 年 7 月至 2015 年 10 月任海富通现金管理货 币基金经理。2014 年 9 月 起兼任海富通季季增利理 财债券基金经理。2015 年 1 月起兼任海富通稳健添利 债券基金经理。2015 年 4 月起兼任海富通新内需混 合基金经理。2016 年 2 月 起兼任海富通货币基金经 理。2016 年 4 月起兼任海 富通纯债债券、海富通双 福分级债券、海富通双利 债券及海富通养老收益混 合基金经理。
--	---	--	--	---

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的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

从基本面看，上半年经济呈现短暂回升而后回落的走势。在去年末经济仍处于弱势徘徊局面下，年初以来需求侧刺激发力，1 月份信贷投放高达 2.5 万亿，远高于同期水平，信贷和社融的双高支撑经济短暂回暖。春节后，各个城市纷纷出台降低首付比例，行政刺激叠加金融支持下地产销售迎来爆发式增长，带动新开工和投资回升，而基建投资在扩大财政赤字的背景下也保持较快增长。短期投资回升带来需求回暖，叠加低库存水平，企业补库存意愿上升，大宗价格大幅上涨，PPI 与 CPI 的剪刀差收窄，经济出现小周期回升。然而 5 月份政策目标有所转向，在权威人士讲话后，有重回供给侧改革之势。信贷和社融开始下滑，地产销售和投资回落，二季度经济增长趋势放缓。但总体来看上半年经济基本实现稳增长目标，为“L”型筑底。上半年货币政策总体保持中性稳健，在 2 月末开年首次对冲性降准后，此后基本以逆回购、MLF、SLF、SLO 等货币工具进行量价调控，并未大幅放水，一方面是防止经济脱实向虚，另一方面也是防止人民币汇率大幅波动。

基于此，上半年货币市场利率继续保持低位，资金面仅在春节前、三月末和四月中下旬出现波动但总体保持平稳。利率债上半年为区间震荡行情，10 年期国债低点在一月中旬达到 2.72%，高点在 6 月初突破 3%，在基本面和资金面没有趋势性变化的情况下，利率债总体处于胶着状态，且交易空间越来越窄。信用债方面，一季度信用债表现出色，而 4 月中旬受违约风险扩散影响，信用债迎来大幅调整，中低评级影响最甚，评级间利差大幅走扩，直至 5 月初违约风险趋于稳定，信用债开始反弹。总体看上半年信用债也是震荡行情，在信用风险加大的情况下高评级、城投债更受市场青睐。转债方面，上半年转债表现较差，股市下跌是主因，而股市情绪持续走弱和转债供给增加也使得转债估值大幅压缩，上半年中证转债指数大跌 11.9%。

本管理人在上半年主动控制信用风险，积极进行利率债的交易。在一季度大幅降低利率债的配置，在二季度初降低信用债配置，卖出组合中信用资质排序最靠后的债券，降低组合杠杆。在 5、6 月份小幅提高高评级信用债配置，显著提高长端利率债配置，加大了杠杆和久期。目前本基金组合以中短期信用债为基本配置，杠杆部分主要配置利率债，谨慎参与转债。

#### 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 1.87%，同期业绩比较基准收益率为 1.62%；海富通稳健添利债券 A 类基金净值增长率为 2.00%，同期业绩比较基准收益率为 1.62%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度政策重心重回供给侧改革后，经济基本面有回归疲弱之势。地产销量已有明显下滑，三季度地产投资增速或将有较明显回落。民间投资意愿不足，叠加去产能影响，制造业投资回落可能性大。消费平稳中或有下滑，出口依然弱势，而基建仍是主要支撑，继续托底经济。下半年通胀在季节性因素消除后，重回下滑区间，三季度受高基数影响，通胀水平或是年内低点。汇率方面，美联储加息进程放缓，在年内不加息或仅加息一次的可能性较大，而央行 5 月以来主动引导人民币贬值，已提前释放人民币贬值压力，因此下半年汇率风险总体较小，人民币仍是稳中趋贬。目前国内货币政策处于松紧两难，下半年可能继续维持中性，降准的可能性仍有，而降息的概率则较小。总体看三季度或许是货币政策放松的窗口期，但在当前货币政策仍受多重制约的情况下放松主要以对冲为主，是否会出现主动放松可能仍要视经济下行的幅度而定。

在这种状态下，下半年资金面总体可能继续维持宽裕，不过在金融去杠杆的背景下仍需警惕阶段性的流动性风险。利率债下半年不乏机会，但在短端利率受限的情况下上涨空间也较为有限，收益率想要突破一月份的低点可能需要基本面下行倒逼货币政策有超预期放松的情况发生。信用债方面，下半年信用债到期量较大，违约事件恐难以避免，过剩产能行业利差有进一步走扩可能，而高等级信用配置需求依然旺盛，未来评级利差将进一步分化。转债方面，转债指数已接近历史底部，未来向下空间有限，但在股市没有趋势性行情、转债下半年供给增加的情况下转债市场仍要经历一个缓慢磨底的过程，可继续等待机会、适当逢低布局。

本组合将继续以中高等级的中短期信用债为基本配置，严格控制信用风险，谨慎择券，积极跟踪；利率债方面，把握交易机会，积极操作；对于权益可能会有机会，我们会比上半年更积极一点，但控制成本和仓位，以绝对收益为考量。

#### 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。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

## 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

2016 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

2016 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 2016 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,107,441.38	10,128,605.69
结算备付金		5,879,881.07	8,596,620.41
存出保证金		19,288.47	22,415.43
交易性金融资产	6.4.7.2	809,694,975.70	830,451,604.44
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		809,694,975.70	830,451,604.44
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	-	-
应收证券清算款		20,150,680.55	-
应收利息	6.4.7.5	13,653,228.28	17,542,278.83
应收股利		-	-
应收申购款		47,539.19	11,220.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>856,553,034.64</b>	<b>866,752,745.19</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
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		225,000,000.00	233,000,000.00
应付证券清算款		5,828,307.11	8,077,536.34
应付赎回款		4,599.72	42,421.58
应付管理人报酬		330,047.36	344,818.84
应付托管费		101,553.04	106,098.12
应付销售服务费		7,249.20	16,633.54
应付交易费用	6.4.7.7	2,000.00	1,450.00
应交税费		216,000.00	216,000.00
应付利息		37,957.41	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	239,016.68	360,000.01
负债合计		231,766,730.52	242,164,958.43
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	490,270,414.71	500,169,927.42
未分配利润	6.4.7.10	134,515,889.41	124,417,859.34
所有者权益合计		624,786,304.12	624,587,786.76
负债和所有者权益总计		856,553,034.64	866,752,745.19

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.276 元，C 类基金份额净值 1.252 元，基金份额总额 490,270,414.71 份，其中 A 类基金份额 466,629,378.29 份，C 类基金份额 23,641,036.42 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

## 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		<b>16,189,079.66</b>	<b>38,797,351.33</b>
1.利息收入		17,573,612.71	24,639,109.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	123,662.88	163,951.14

债券利息收入		17,449,949.83	24,463,792.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	11,365.62
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,232,998.92	-593,927.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,232,998.92	-593,927.73
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“-”号填列）	6.4.7.17	-2,619,134.19	14,748,005.60
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	1,602.22	4,164.04
<b>减：二、费用</b>		<b>4,512,114.57</b>	<b>8,178,840.69</b>
1. 管理人报酬		1,954,076.72	1,719,410.00
2. 托管费		601,254.39	529,049.21
3. 销售服务费		53,328.71	27,064.56
4. 交易费用	6.4.7.19	5,429.44	5,842.14
5. 利息支出		1,696,457.93	5,697,033.98
其中：卖出回购金融资产支出		1,696,457.93	5,697,033.98
6. 其他费用	6.4.7.20	201,567.38	200,440.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>11,676,965.09</b>	<b>30,618,510.64</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>11,676,965.09</b>	<b>30,618,510.64</b>

### 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	500,169,927.42	124,417,859.34	624,587,786.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	11,676,965.09	11,676,965.09
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)	-9,899,512.71	-1,578,935.02	-11,478,447.73
其中：1.基金申购款	32,131,330.89	8,144,837.10	40,276,167.99
2.基金赎回款	-42,030,843.60	-9,723,772.12	-51,754,615.72
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)	490,270,414.71	134,515,889.41	624,786,304.12
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	459,158,639.48	59,732,567.65	518,891,207.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	30,618,510.64	30,618,510.64
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)	-2,679,690.39	-299,487.35	-2,979,177.74
其中：1.基金申购款	35,626,941.69	5,737,466.61	41,364,408.30

2.基金赎回款	-38,306,632.08	-6,036,953.96	-44,343,586.04
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）	456,478,949.09	90,051,590.94	546,530,540.03

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：刘颂，主管会计工作负责人：陶网雄，会计机构负责人：胡正万

## 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 2016 年 8 月 25 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通稳健添利债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协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 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于

进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，应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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

(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(“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

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 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,954,076.72	1,719,410.00
其中：支付销售机构的客户维护 费	25,689.66	19,741.74

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 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	601,254.39	529,049.21

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 2016年1月1日至2016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	-	11,996.80	11,996.80
海通证券	-	118.94	118.94
海富通	-	80.45	80.45
合计	-	-	-
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	-	14,088.05	14,088.05
海通证券	-	94.75	94.75
海富通	-	36.61	36.61
合计	-	14,219.41	14,219.41

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

单位：人民币元

上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日						
银行间市 场交易的 各关联方 名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商 银行	-	-	-	-	29,700,00 0.00	2,704.77

注：本基金本报告期内未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 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**

海富通稳健添利债券 A

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。

海富通稳健添利债券 C

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。

**6.4.8.5 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 2016年1月1日至2016年6月 30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	7,107,441.38	37,295.10	6,129,286.96	38,916.39

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（2016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**

本基金本报告期末未持有股票。

**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 2016 年 6 月 30 日止，本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 225,000,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 日、2016 年 7 月 3 日、

2016 年 7 月 4 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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	809,694,975.70	94.53
	其中：债券	809,694,975.70	94.53
	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	-	-
	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	12,987,322.45	1.52
7	其他各项资产	33,870,736.49	3.95
8	合计	856,553,034.64	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有沪港通股票。

**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**

本基金本报告期内未买入股票。

**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**

本基金本报告期内未卖出股票。

**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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	151,227,000.00	24.20
	其中：政策性金融债	151,227,000.00	24.20
4	企业债券	553,874,622.90	88.65
5	企业短期融资券	69,934,000.00	11.19
6	中期票据	30,834,000.00	4.94
7	可转债（可交换债）	3,825,352.80	0.61
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	809,694,975.70	129.60

**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	160210	16 国开 10	600,000	59,970,000.00	9.60
2	011699316	16 广新 SCP003	400,000	40,048,000.00	6.41
3	122295	13 川投 01	300,000	32,523,000.00	5.21
4	122299	13 中原债	300,000	31,860,000.00	5.10
5	150314	15 进出 14	300,000	31,179,000.00	4.99

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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合约。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

根据本基金合同，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 本期国债期货投资政策**

根据本基金合同，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。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

根据本基金合同，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,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名证券中,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	19,288.47
2	应收证券清算款	20,150,680.55
3	应收股利	-



4	应收利息	13,653,228.28
5	应收申购款	47,539.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,870,736.49

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

份额级别	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
海富通稳健添利债券 A	932	500,675.30	462,702,154.35	99.16%	3,927,223.94	0.84%
海富通稳健添利债券 C	515	45,904.93	4,208,754.21	17.80%	19,432,282.21	82.20%
合计	1,447	338,818.53	466,910,908.56	95.24%	23,359,506.15	4.76%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C 级比例分母为各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通稳健添利债券 A	-	-

	海富通稳健添利债券 C	47,087.07	0.1992%
	合计	47,087.07	0.0096%

### 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的情况

项目	份额级别	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	海富通稳健添利债券 A	0
	海富通稳健添利债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通稳健添利债券 A	0
	海富通稳健添利债券 C	0
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通稳健添利债券 A	海富通稳健添利债券 C
基金合同生效日（2008 年 10 月 24 日）基金份额总额	-	3,180,077,343.35
本报告期期初基金份额总额	449,425,546.56	50,744,380.86
本报告期基金总申购份额	18,855,629.64	13,275,701.25
减：本报告期基金总赎回份额	1,651,797.91	40,379,045.69
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	466,629,378.29	23,641,036.42

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

本报告期，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第四届董事会第四十八次会议审议通过，同意戴德舜先生辞去公司副总经理职务。

本报告期，经海富通基金管理有限公司 2016 年第一次临时股东大会审议通过，选举张文伟、刘颂(Patrick LIU)、黄正红、陶乐斯(Ligia Torres)、黄金源(Alex NG Kim Guan)、郑国汉(Leonard K.Cheng)、巴约特(Marc Bayot)、杨国平、张馨担任公司第五届董事会董事，其中郑国汉(Leonard K.Cheng)、巴约特(Marc Bayot)、杨国平、张馨为独立董事。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金本报告期内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等情况

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	

东方证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中泰证券(原齐鲁)	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金新增租用东北证券交易单元。

## 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
东方证券	12,135,026.30	5.69%	481,000,000.00	3.89%	-	-
申万宏源	4,356,64	2.04%	187,600,	1.52%	-	-

	8.83		000.00			
兴业证券	64,498,339.23	30.24%	5,935,900,000.00	48.04%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中泰证券(原齐鲁)	41,863,975.24	19.63%	2,137,800,000.00	17.30%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1,725,000.00	0.81%	200,400,000.00	1.62%	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	42,978,266.86	20.15%	-	-	-	-
方正证券	30,907,139.73	14.49%	-	-	-	-
东兴证券	14,821,564.08	6.95%	3,413,600,000.00	27.63%	-	-

## 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 34 只公募基金。截至 2016 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 407 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 2016 年 6 月 30 日，海富通为近 80 家企业超过 360 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 2016 年 6 月 30 日，海富通旗下专户理财管理资产规模超过 110 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。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。

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 2016 年 6 月 30 日，投资咨询及海外业务规模超过 95 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。

2016 年 3 月，国内权威财经媒体《中国证券报》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。

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。

海富通基金管理有限公司  
二〇一六年八月二十六日