海富通双福分级债券型证券投资基金
2015 年半年度报告
2015 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年八月二十八日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 27 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 2015 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
§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 10
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 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
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 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的真实、准确和完整发表意见 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 18
§7 投资组合报告 35
7.1 期末基金资产组合情况 35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 36
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 36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 38
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 39
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 39
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 39
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 39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 40
7.12 投资组合报告附注 40

§8 基金份额持有人信息 41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 41
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 41
§9 开放式基金份额变动 42
§10 重大事件揭示 42
10.1 基金份额持有人大会决议 42
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 42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 43
10.4 基金投资策略的改变 43
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 43
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 43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 44
10.8 其他重大事件 45
§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	海富通双福分级债券型证券投资基金	
基金简称	海富通双福分级债券	
基金主代码	519059	
交易代码	519059	
基金运作方式	契约型，本基金以“运作周期滚动”的方式运作。双福 A 自每个运作周期起始日起每满 6 个月设一个开放期，双福 B 在任一运作周期内封闭运作，不上市交易。运作周期届满，在满足本基金合同约定的条件下，本基金将转换为“海富通双福债券型证券投资基金”；不满足条件时，本基金将进入过渡期，过渡期结束将进入下一运作周期。	
基金合同生效日	2014 年 5 月 6 日	
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	
报告期末基金份额总额	223,003,520.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	海富通双福分级债券 A	海富通双福分级债券 B
下属两级基金的交易代码	519057	519058
报告期末下属分级基金的份额总额	70,779,581.08 份	152,223,939.79 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳定增值的基础上，积极把握信用类债券的投资机会，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金为债券型基金，对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%。在此约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。
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，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和

	股票型基金。	
下属分级基金的风险收益特征	双福 A 将表现出低风险、收益相对稳定的特征。	双福 B 则表现出较高风险、收益相对较高的特征。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	王永民
	联系电话	021-38650891	010-66594896
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街1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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		张文伟	田国立

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（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	28,368,145.38
本期利润	28,552,895.50
加权平均基金份额本期利润	0.0686
本期加权平均净值利润率	6.08%
本期基金份额净值增长率	18.14%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2015 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	58,969,812.45
期末可供分配基金份额利润	0.2644
期末基金资产净值	281,371,219.21
期末基金份额净值	1.262
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2015 年 6 月 30 日)**
基金份额累计净值增长率	28.37%

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	0.88%	0.17%	0.43%	0.04%	0.45%	0.13%
过去三个月	14.72%	1.47%	2.21%	0.09%	12.51%	1.38%

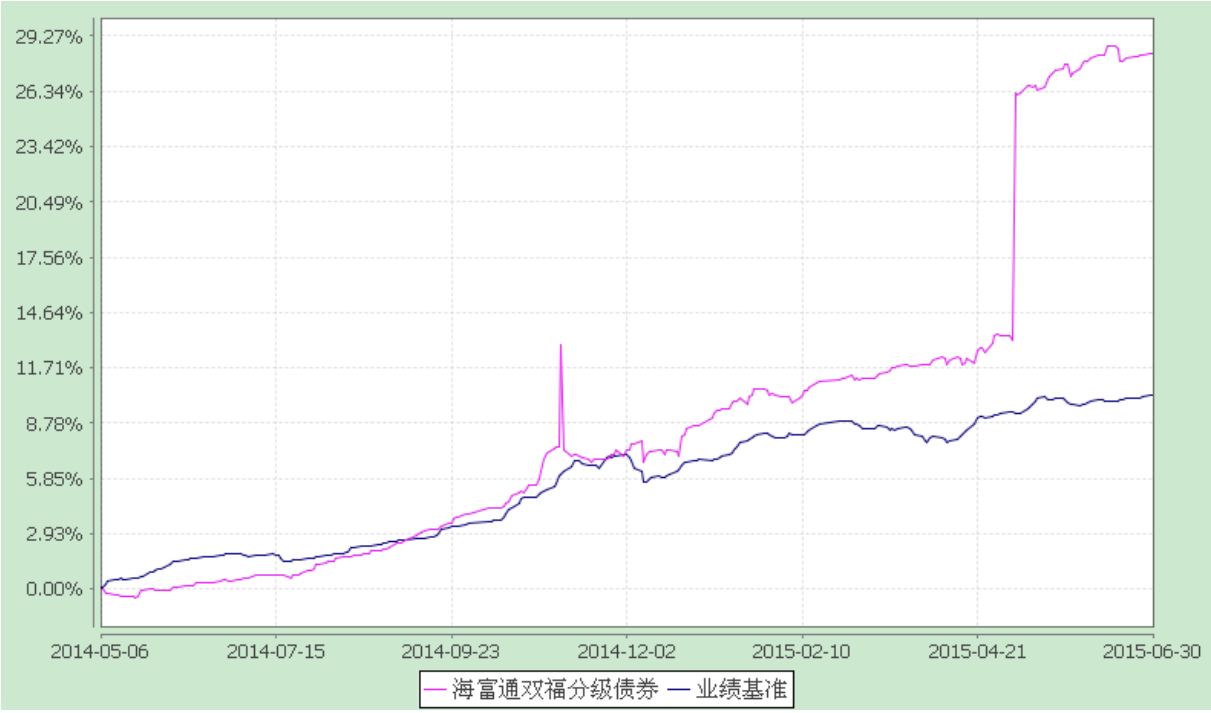
过去六个月	18.14%	1.06%	3.17%	0.09%	14.97%	0.97%
过去一年	27.73%	0.88%	8.19%	0.11%	19.54%	0.77%
自基金合同生效起至今	28.37%	0.81%	10.23%	0.10%	18.14%	0.71%

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

海富通双福分级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

(2014 年 5 月 6 日至 2015 年 6 月 30 日)



注：本基金合同于 2014 年 5 月 6 日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

3.3 其他指标

其他指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
双福 A 与双福 B 基金份额配比	1:2.1506759
期末双福 A 份额参考	1.007

净值	
期末双福 A 份额累计参考净值	1.056
期末双福 B 份额参考净值	1.380
期末双福 B 份额累计参考净值	1.380
双幅 A 的预计年收益率	4.35%

§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 2015 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 32 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。

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		
赵恒毅	本基金的基金经理；海富通养老收益混合基金经理；海富通双利分级债券基金经理	2014-05-06	-	9 年	金融学硕士。持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2008 年 3 月任通用技术集团投资管理有限公司研究员，2008 年 4 月至 2011 年 5 月任富国基金管理有限公司研究员，2011 年 5 月至 2013 年 7 月任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理，2012 年 5 月至 2013 年 7 月任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理，2012 年 6 月至 2013 年 7 月任富国可转换债券证券投资基金基金经理，2013 年 11 月加入海富通基金管理有限公司。2013 年 12 月起任海富通养老收益混合和海富通双利分级债券基金经理。2014 年 5 月起兼任海富通双福分级债券基金经理。

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

报告期内，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，公司在严格遵循独立投资决策流程和执行投资交易行为监控制度的基础上，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

上半年经济基本面总体疲弱，工业、投资等多项经济数据屡屡创下近年来的新低，一季度 GDP 增速 7%也已接近政府“底线”。在这种情况下政府显现出强烈的稳增长意愿，首先货币政策延续宽松，上半年央行接连实施了三次降准和三次降息，并持续通过 SLF、MLF 等定向手段向市场注入流动性；同时财政政策也积极发力，2015 年赤字率目标由去年的 2.1%提升至 2.3%，并推出万亿地方债置换，希望通过地方基建拉动投资。在此背景下，上半年债券市场却并没有走出去年下半年的大牛行情，一月到三月短端和长端利率都是先下后上，期限利差保持低位，四月降准之后短端利率开始大幅

下降，7 天回购利率一度维持 2%以下，但是长端利率却始终处于区间震荡而无法突破下行。利率债收益率曲线从年初的“极度平坦”转变为目前的“极度陡峭”，宽货币释放的大量资金被淤积在银行间而未有效投向实体，降低实体经济融资成本的目标仍任重而道远。总体看上半年 1 年期国债收益率下行 152BP，10 年期国债收益率仅下行 2BP。信用债上半年表现相对出色，各评级、各期限品种都有 30BP 以上的下行幅度，尤其是中短久期、高评级信用债成为“息差”策略的主流品种而受到追捧，城投债也因为地方债置换安全度提高而投资情绪有所好转。转债方面，一至五月转债受股市推动大幅上涨，众多个券纷纷触发赎回退市，转债稀缺性进一步推升估值，然而六月股市剧烈震荡，转债在正股和估值双重压力下急剧下跌，归还了年初以来累积的回报，上半年中证转债指数跌 12%。

上半年，本基金主要的操作是减持城投债和增持公司债。城投债流动性的下降导致了本基金资产流动性的下降，所以基金管理人将配置方向转向流动性改善的公司债。本基金少量参与了利率债的交易，对业绩提供了一定正贡献。考虑到 5 月初本基金优先端将开放，本基金之前配置了部分届时到期的存款和短融。赎回后本基金继续优化持仓结构，提升组合整体信用资质，控制久期在较低的水平。期间，本基金较少参与可转债，但适量参与了股票投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 18.14%，同期业绩比较基准收益率为 3.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前债券市场正处于比较纠结的状态，一方面各项经济数据显示基本面仍未企稳，未来仍有下行压力；通胀维持低位，央行货币政策难以转向，而且从手段上看无论是定向工具的运用还是降准、降息都还有放松的空间；但另一方面，近期地产销售的边际改善、地方融资放松、基建托底等使得市场对下半年经济企稳和通胀反弹的预期在增强，加上地方债置换供给不断、利率市场化的推进、股市分流效应使得债券长端利率水平受到压制，而短端利率已无法更低。我们认为未来这种矛盾可能还将持续，而债市阶段性的走向仍取决于央行多目标管理下的操作。目前看货币宽松的大方向不会变，但经历了多次降息降准后未来货币政策的重点可能在于疏通传导，因此央行的操作会变得更为“平衡”，这种平衡包括短期和长期资金的平衡、利率和汇率的平衡。因此对于下半年的利率债来说可能仍会是一个区间波动的走势。信用债方面，今年信用风险持续发酵，下半年将进入评级下调高发期，重点关注煤炭、有色、机械设备等强周期行业。目前信用债收益率和利差均处于历史较低水平，未来收益率继续下行的弹性减弱，但信用债在强烈的套息需求下未来表现可能仍会好于利率债，信用利差或许难以大幅走扩。转债方面，股性主导下转债总体仍将跟随股市波动。目前看股市已进入震荡期，虽然宽货币和经济转型的牛市基础还未被证伪，但高估值下转债配置价值较低，且操作难度较大，下半年可积极关注新发行个券。

下半年，本基金会继续提高整个组合的流动性，并控制好久期。利率债方面，本基金会积极关注，适时参与。信用债方面，本基金会重点关注公司债，并保持较短的久期。股票方面，本基金拟适时适量参与。

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，每一运作周年内，本基金（包括双福 A　和双福 B）不进行收益分配。

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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人--中国银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《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,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：海富通双福分级债券型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	124,112.48	4,192,402.25
结算备付金		2,360,643.01	5,147,177.83
存出保证金		139,217.36	141,582.43
交易性金融资产	6.4.7.2	278,195,523.90	589,626,262.92
其中：股票投资		-	9,995,325.16
基金投资		-	-
债券投资		278,195,523.90	579,630,937.76
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		8,766,760.16	1,129,183.46
应收利息	6.4.7.5	8,576,031.48	11,533,535.60
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		298,162,288.39	611,770,144.49
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2015 年 6 月 30 日**	**上年度末 2014 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		16,200,000.00	65,000,000.00
应付证券清算款		-	32,100.22
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		161,685.06	321,362.82
应付托管费		46,195.72	91,817.92
应付销售服务费		20,457.09	106,141.15
应付交易费用	6.4.7.7	153,734.48	143,712.36
应交税费		-	-
应付利息		478.34	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	208,518.49	290,000.00
负债合计		16,791,069.18	65,985,134.47
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	219,736,385.23	498,716,859.42
未分配利润	6.4.7.10	61,634,833.98	47,068,150.60
所有者权益合计		281,371,219.21	545,785,010.02
负债和所有者权益总计		298,162,288.39	611,770,144.49

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.007 元，B 类基金份额净值 1.380 元，基金份额总额 223,003,520.87 份，其中 A 类基金份额 67,512,445.44 份，B 类基金份额 152,223,939.79 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通双福分级债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 5 月 6 日 （基金合同生效日） 至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		**32,801,446.69**	**3,820,495.67**
1.利息收入		14,588,626.00	4,933,875.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,444,942.85	47,221.93
债券利息收入		13,120,871.59	4,688,616.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		22,811.56	198,036.83
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		18,028,070.57	19,831.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,901,743.91	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	11,126,326.66	19,831.92
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	184,750.12	-1,133,222.33
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	-	10.53
减：二、费用		**4,248,551.19**	**1,408,605.94**
1．管理人报酬		1,644,435.06	535,404.83
2．托管费		469,838.58	152,972.80
3．销售服务费		473,312.51	188,044.65
4．交易费用	6.4.7.19	473,080.87	1,232.43
5．利息支出		985,575.68	454,523.90
其中：卖出回购金融资产支出		985,575.68	454,523.90

6．其他费用	6.4.7.20	202,308.49	76,427.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**28,552,895.50**	**2,411,889.73**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**28,552,895.50**	**2,411,889.73**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通双福分级债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	498,716,859.42	47,068,150.60	545,785,010.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	28,552,895.50	28,552,895.50
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）	-278,980,474.19	-13,986,212.12	-292,966,686.31
其中：1.基金申购款	3,670,195.28	178,104.72	3,848,300.00
2.基金赎回款	-282,650,669.47	-14,164,316.84	-296,814,986.31
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）	219,736,385.23	61,634,833.98	281,371,219.21
项目	上年度可比期间 2014 年 5 月 6 日（基金合同生效日）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	507,427,323.76	-	507,427,323.76

（基金净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,411,889.73	2,411,889.73
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	507,427,323.76	2,411,889.73	509,839,213.49

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

海富通双福分级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”)证监许可[2014]第 193 号《关于核准海富通双福分级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《海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 507,306,330.75 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 普华永道中天验字(2014)第 234 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 5 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 507,427,323.76 份，其中认购资金利息折合 120,993.01 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同》和《海富通双福分级债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金通过基金资产及收益的不同

分配安排，将基金份额分成预期收益与预期风险不同的两个类别，即双福 A 和双福 B。双福 A 根据基金合同的规定获取约定收益，双福 A 自基金合同生效日起每满 6 个月开放一次，在双福 A 的单独开放日，基金管理人将对双福 A 进行基金份额折算，双福 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额持有人持有的双福 A 份额数按折算比例相应增减；本基金在扣除双福 A 的本金及应计收益后的全部剩余资产归双福 B 享有，亏损以双福 B 的资产净值为限由双福 B 首先承担，双福 B 在任一运作周年内封闭运作，不上市交易，仅在每个运作周年到期日开放一次。本基金双福 A 与双福 B 的份额初始配比原则上为 7：3。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类资产及债券等固定收益类金融工具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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%，在每个双福 A 的赎回开放日前 20 个工作日和后 20 个工作日期间不受前述投资组合比例的限制。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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 2015 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》、《 海富通双福分级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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年上半年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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年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与最近一期年度报告相一致，本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告不一致。

6.4.4.1其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.2差错更正的说明

本基金报告期内不存在重大会计差错。

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[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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，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。自 2013 年 1 月 1 日起，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，暂减按 25%计入应纳税所得额。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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	124,112.48
定期存款	-
其他存款	-
合计	124,112.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 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	215,071,321.07	217,199,523.90	2,128,202.83
	银行间市场	60,035,647.68	60,996,000.00	960,352.32
	合计	275,106,968.75	278,195,523.90	3,088,555.15
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		275,106,968.75	278,195,523.90	3,088,555.15

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,235.37
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	956.07
应收债券利息	8,573,783.61
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	56.43
合计	8,576,031.48

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 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	152,834.48
银行间市场应付交易费用	900.00
合计	153,734.48

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 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	208,518.49
合计	208,518.49

6.4.7.9 实收基金

海富通双福分级债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	355,186,094.72	346,492,919.63
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-289,858,385.18	-282,650,669.47
-基金拆分/份额折算前	65,327,709.54	63,842,250.16

基金拆分/份额折算调整	1,603,571.54	—
本期申购	3,848,300.00	3,670,195.28
本期末	70,779,581.08	67,512,445.44

海富通双福分级债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	152,223,939.79	152,223,939.79
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	152,223,939.79	152,223,939.79

注：1. 根据《海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同》的相关规定，双福 A 自基金合同生效日起每满 6 个月开放申购和赎回一次，双福 B 在任一运作周年内封闭运作，仅在每个运作周年到期日开放申购和赎回一次。

2. 根据《海富通双福分级债券型证券投资基金招募说明书》和本基金的基金管理人 2015 年 5 月 12 日的《海富通双福分级债券型证券投资基金之 A 份额份额折算结果的公告》，本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司确定 2015 年 5 月 6 日为双福 A 基金份额折算基准日。2015 年 5 月 6 日折算前双福 A 基金份额总额为 65,327,709.54 份，折算前双福 A 基金份额净值为 1.025 元，根据双福 A 基金份额折算公式，双福 A 基金份额折算比例为 1.02454657，折算后双福 A 基金份额总额为 66,931,281.08 份，基金份额净值为 1.000 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算。

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	44,209,671.98	2,858,478.62	47,068,150.60
本期利润	28,368,145.38	184,750.12	28,552,895.50
本期基金份额交易产生的变动数	-13,608,004.91	-378,207.21	-13,986,212.12

其中：基金申购款	173,724.40	4,380.32	178,104.72
基金赎回款	-13,781,729.31	-382,587.53	-14,164,316.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	58,969,812.45	2,665,021.53	61,634,833.98

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	49,275.13
定期存款利息收入	1,338,750.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	55,769.19
其他	1,148.53
合计	1,444,942.85

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	186,762,291.15
减：卖出股票成本总额	179,860,547.24
买卖股票差价收入	6,901,743.91

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	674,606,319.41
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	646,089,710.30
减：应收利息总额	17,390,282.45
买卖债券差价收入	11,126,326.66

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

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 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	184,750.12
——股票投资	362,908.72
——债券投资	-178,158.60
——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	184,750.12

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	471,005.87
银行间市场交易费用	2,075.00

合计	473,080.87

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
债券托管账户维护费	15,000.00
其他	200.00
银行划款手续费	8,590.00
合计	202,308.49

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
中国银行股份有限公司 (“中国银行”)	基金托管人、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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.2 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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014 年 5 月 6 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,644,435.06	535,404.83
其中：支付销售机构的客户维护费	454,437.49	180,489.41

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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年5月6日（基金合同生效日）至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	469,838.58	152,972.80

注：支付基金托管人中国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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期

各关联方名称	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		
	海富通双福分级债券 A	海富通双福分级债券 B	合计
中国银行	473,174.91	-	473,174.91
海富通	76.77	-	76.77
合计	473,251.68	-	473,251.68
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014 年 5 月 6 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通双福分级债券A	海富通双福分级债券 B	合计
中国银行	187,923.97	-	187,923.97
海富通	116.80	-	116.80
合计	188,040.77	-	188,040.77

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类份额对应的基金资产净值的年费率 0.35%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 A 类份额对应的基金资产净值 X 0.35 % / 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与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

本报告期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

本报告期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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年5月6日（基金合同生效日）至2014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
中国银行股份有限公司	124,112.48	49,275.13	600.42	34,369.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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/增发证券而流通受限证券。

6.4.11.2 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。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 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。

6.4.11.3.2 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。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

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。

6.4.12.2 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约责任，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招商银行，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。

6.4.12.2.1 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 2015年6月30日	上年末 2014年12月31日
A-1	40,034,000.00	79,999,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	60,216,000.00

合计	40,034,000.00	140,215,000.00

注：未评级部分为超短期融资券。

6.4.12.2.2 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 2015年6月30日	上年末 2014年12月31日
AAA	8,550,179.70	-
AAA 以下	229,611,344.20	439,415,937.76
未评级	-	-
合计	238,161,523.90	439,415,937.76

6.4.12.3 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发行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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	124,112.48	-	-	-	124,112.48
结算备付金	2,360,643.01	-	-	-	2,360,643.01
存出保证金	139,217.36	-	-	-	139,217.36
交易性金融资产	56,713,758.20	200,519,765.70	20,962,000.00	0.00	278,195,523.90
应收证券清算款	-	-	-	8,766,760.16	8,766,760.16
应收利息	-	-	-	8,576,031.48	8,576,031.48
资产总计	59,337,731.05	200,519,765.70	20,962,000.00	17,342,791.64	298,162,288.39
负债					
卖出回购金融资产款	16,200,000.00	--		-	16,200,000.00
应付管理人报酬	-	--		161,685.06	161,685.06
应付托管费	-	--		46,195.72	46,195.72
应付交易费用	-	--		153,734.48	153,734.48
应付销售服务费	-	--		20,457.09	20,457.09
应付利息	-	--		478.34	478.34
其他负债	-	--		208,518.49	208,518.49
负债总计	16,200,000.00	0.00	0.00	591,069.18	16,791,069.18

利率敏感度缺口	43,137,731.05	200,519,765.70	20,962,000.00	16,751,722.46	281,371,219.21
上年度末 2014 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1 至 5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
银行存款	4,192,402.25	-	-	-	4,192,402.25
结算备付金	5,147,177.83	-	-	-	5,147,177.83
存出保证金	141,582.43	-	-	-	141,582.43
交易性金融资产	176,932,885.80	347,169,199.56	55,528,852.40	9,995,325.16	589,626,262.92
应收证券清算款	-	-	-	1,129,183.46	1,129,183.46
应收利息	-	-	-	11,533,535.60	11,533,535.60
资产总计	186,414,048.31	347,169,199.56	55,528,852.40	22,658,044.22	611,770,144.49
负债					
应付证券清算款	-	-	-	32,100.22	32,100.22
应付管理人报酬	-	-	-	321,362.82	321,362.82
应付托管费	-	-	-	91,817.92	91,817.92
应付交易费用	-	-	-	143,712.36	143,712.36
其他负债	-	-	-	290,000.00	290,000.00
应付销售服务费	-	-	-	106,141.15	106,141.15
卖出回购金融资产款	65,000,000.00	-	-	-	65,000,000.00
负债总计	65,000,000.00	0.00	0.00	985,134.47	65,985,134.47
利率敏感度缺口	121,414,048.31	347,169,199.56	55,528,852.40	21,672,909.75	545,785,010.02

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。

6.4.12.4.1.2 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：人民币万元）	
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 140	减少约 399
	市场利率下降 25 个基点	增加约 140	增加约 404

注：影响金额为约数,精确到万元。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 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。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产的比例合计不超过基金资产的 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

交易性金融资产－股票投资	-	-	9,995,325.16	1.83
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	-	-	9,995,325.16	1.83

注：本报告期末未持有股票。

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，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。

6.4.13 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	278,195,523.90	93.30
	其中：债券	278,195,523.90	93.30
	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	2,484,755.49	0.83
7	其他各项资产	17,482,009.00	5.86
8	合计	298,162,288.39	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	601288	农业银行	20,342,000.00	3.73
2	600048	保利地产	16,138,201.07	2.96
3	000651	格力电器	11,826,213.57	2.17
4	600958	东方证券	11,809,339.00	2.16
5	601818	光大银行	11,566,876.00	2.12
6	601929	吉视传媒	10,505,240.00	1.92
7	000709	河北钢铁	9,950,000.00	1.82
8	601857	中国石油	6,583,720.84	1.21
9	601009	南京银行	5,929,504.00	1.09
10	000089	深圳机场	5,897,000.00	1.08
11	601088	中国神华	5,805,553.93	1.06
12	002241	歌尔声学	5,767,955.14	1.06
13	000157	中联重科	5,656,917.72	1.04
14	603993	洛阳钼业	5,576,738.23	1.02

15	002245	澳洋顺昌	5,542,458.80	1.02
16	600005	武钢股份	5,313,000.00	0.97
17	601939	建设银行	5,040,243.00	0.92
18	601727	上海电气	4,953,034.00	0.91
19	600115	东方航空	4,191,391.02	0.77
20	000002	万 科A	2,789,188.00	0.51

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	601288	农业银行	20,956,000.00	3.84
2	600048	保利地产	15,775,926.34	2.89
3	000651	格力电器	13,342,931.00	2.44
4	002521	齐峰新材	12,263,026.45	2.25
5	600958	东方证券	11,702,488.00	2.14
6	000709	河北钢铁	11,434,000.00	2.09
7	601818	光大银行	11,387,873.40	2.09
8	601929	吉视传媒	10,730,293.45	1.97
9	002241	歌尔声学	8,559,522.49	1.57
10	601857	中国石油	7,285,694.18	1.33
11	000089	深圳机场	6,266,349.08	1.15
12	601088	中国神华	5,844,330.00	1.07
13	601009	南京银行	5,703,159.44	1.04
14	600005	武钢股份	5,577,000.00	1.02

15	000157	中联重科	5,361,072.09	0.98
16	601939	建设银行	5,286,232.97	0.97
17	002245	澳洋顺昌	5,276,340.47	0.97
18	603993	洛阳钼业	5,258,658.00	0.96
19	601727	上海电气	4,971,084.00	0.91
20	600115	东方航空	4,590,267.23	0.84

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	169,502,313.36
卖出股票的收入（成交）总额	186,762,291.15

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	238,161,523.90	84.64
5	企业短期融资券	40,034,000.00	14.23
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	278,195,523.90	98.87

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	112235	15 福星 01	211,260	22,283,704.80	7.92
2	1480418	14 邯郸中小债	200,000	20,962,000.00	7.45
3	124980	14 抚微 01	200,000	20,728,000.00	7.37
4	071503005	15 中信 CP005	200,000	20,034,000.00	7.12
5	071502006	15 国泰君安 CP006	200,000	20,000,000.00	7.11

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 15 中信 CP005（71503005）其发行人中信证券股份有限公司于 2015 年 1 月 19 日公告称，因存在为到期融资融券合约展期的问题（根据相关规定，融资融券合约期限最长为 6 个月），公司被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

对该债券的投资决策程序的说明：该债券发行人中信证券股份有限公司是是国内规模最大的证券公司，证监会 AA 级，资本实力雄厚。公司各项主营业务排名均位居同行业前列，市场竞争力很强。该债券信用基本面较为稳定，主体 AAA 评级，债项 A-1 级，且期限较短，违约风险很低。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	139,217.36
2	应收证券清算款	8,766,760.16
3	应收股利	-
4	应收利息	8,576,031.48
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,482,009.00

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换债券。

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
海富通双福分级债券 A	468	151,238.42	6,147,279.46	8.69%	64,632,301.62	91.31%
海富通双福分级债券 B	13	11,709,533.83	152,025,071.68	99.87%	198,867.91	0.13%
合计	481	463,624.78	158,172,351.14	70.93%	64,831,169.53	29.07%

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、B 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

本基金本报告期末,基金管理人的从业人员未持有本基金。

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	海富通双福分级债券 A	0
	海富通双福分级债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通双福分级债券	0

	A	
	海富通双福分级债券 B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通双福分级债券 A	海富通双福分级债券 B
基金合同生效日（2014 年 5 月 6 日）基金份额总额	355,203,383.97	152,223,939.79
本报告期期初基金份额总额	355,186,094.72	152,223,939.79
本报告期基金总申购份额	3,848,300.00	-
减：本报告期基金总赎回份额	289,858,385.18	-
本报告期基金拆分变动份额	1,603,571.54	-
本报告期期末基金份额总额	70,779,581.08	152,223,939.79

§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

2015 年 1 月 17 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司股东会审议通过，聘请俞涛先生担任本公司职工监事，高勇前先生不再担任本公司职工监事。

2015 年 2 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第三十六次临时会议审议通过，同意田仁灿先生辞去公司总经理职务，并决定由公司董事长张文伟先生代为履行总经理职务。

2015 年 4 月 8 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司 2015 年第四次临时股东会审议通过，同意田仁灿先生辞去本公司董事职务，由简伟信（Vincent Camerlynck）先生继任本公司董事。

2015 年 5 月 4 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第三十六次临时会议审议通过，并向中国证券监督管理委员会报告，经中国证券监督管理

委员会证监许可【2015】753 号文核准批复。公司聘请刘颂先生任总经理，同时公司董事长张文伟先生不再代行总经理职务。

2015 年 7 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第四十二次临时会议审议通过，聘任奚万荣先生担任公司督察长，原公司督察长章明女士转任公司副总经理。

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

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等情况

海富通基金管理有限公司（以下简称“公司”）于 2015 年 2 月 10 日收到上海证监局《关于对海富通基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，责令公司进行为期 6 个月的整改, 上海证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此公司高度重视，对公司内部控制和风险管理工作进行了全面梳理，彻底排查业务中存在的风险隐患，针对性的制定、实施整改措施，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力。目前，公司已经完成相关整改工作并通过了监管部门的检查验收。除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
中信建投	2	196,846,491.28	55.25%	118,123.77	49.60%	-

中信证券	2	111,615,343.36	31.33%	101,614.78	42.67%	-
华创证券	1	47,802,769.87	13.42%	18,399.16	7.73%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内无新增交易席位。

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,并报公司业务管理委员 会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后,由基金管理人的业务管理委员会核准。

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
中信建投	288,855,016.99	52.88%	3,337,800,000.00	56.23%	-	-
中信证券	250,113,184.13	45.79%	2,598,200,000.00	43.77%	-	-
华创证券	7,307,750.57	1.34%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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 2014 年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》	2015-01-01
2	海富通基金管理有限公司关于监事会成员变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-01-17
3	海富通基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-01-17
4	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-01-31
5	海富通基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通基金网上直销业务并实行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-02-07
6	海富通基金管理有限公司关于总经理变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-02-14
7	海富通基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-02-17
8	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券方案的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-05
9	海富通基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-05
10	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-21
11	海富通基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-25
12	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在本公司网上直销平台对支付宝用户实行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-30
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金网上直销暂停通过支付宝渠道申购以及定期定额申购的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-31

14	海富通基金管理有限公司关于变更公司董事的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-08
15	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-11
16	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-18
17	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-27
18	海富通双福分级债券型证券投资基金之 A 份额份额折算的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-28
19	海富通双福分级债券型证券投资基金之 A 份额开放申购、赎回业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-28
20	海富通双福分级债券型证券投资基金之 A 份额开放申购、赎回业务的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-30
21	海富通双福分级债券型证券投资基金之 A 份额份额折算方案的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-04
22	海富通基金管理有限公司关于新任公司总经理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-04
23	海富通双福分级债券型证券投资基金之 A 份额第一个运作周期内第二个折算基准日次日起年约定收益率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-05
24	海富通双福分级债券型证券投资基金之 A 份额份额折算结果的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-08
25	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-09
26	海富通双福分级债券型证券投资基金之 A 份额申购与赎回结果的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-12
27	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台暂停通过银联支付渠道下的富滇银行、长沙银行办理基金开户及基金申购	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-14

	等业务的公告		
28	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-16
29	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-23
30	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-30
31	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-06
32	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增财达证券有限责任公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-12
33	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国国际金融有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-12
34	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增太平洋证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-12
35	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-13
36	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-23
37	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-27

§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 32 只公募基金。截至 2015 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 451 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 2015 年 6 月 30 日，海富通为 80 多家企业超过 391 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 2015 年 6 月 30 日，海富通旗下

专户理财管理资产规模超过 124 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 2015 年 6 月 30 日，投资咨询及海外业务规模超过 144 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。

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双福分级债券型证券投资基金的文件

（二）海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同

（三）海富通双福分级债券型证券投资基金招募说明书

（四）海富通双福分级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）报告期内海富通双福分级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

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇一五年八月二十八日