

海富通双利债券型证券投资基金
(原海富通双利分级债券型证券投资基金转型)
2015年年度报告摘要
2015年12月31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：二〇一六年三月二十八日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期内，原海富通双利分级债券型证券投资基金转换为海富通双利债券型证券投资基金。原海富通双利分级债券型证券投资基金本报告期自2015年1月1日至2015年12月6日止，海富通双利债券型证券投资基金本报告期自2015年12月7日至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	海富通双利分级债券	
基金主代码	519055	
交易代码	519055	
基金运作方式	<p>契约型，本基金以“运作周年滚动”的方式运作。双利 A 自基金合同生效日起每满 6 个月开放申购和赎回一次，双利 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申购和赎回一次。双利 A 和双利 B 每次开放均仅开放一个工作日。运作周年届满，在满足本基金合同约定的条件下，本基金将转换为“海富通双利债券型证券投资基金”。</p>	
基金合同生效日	2013 年 12 月 4 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	51,808,980.58 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通双利分级债券 A	海富通双利分级债券 B
下属分级基金的交易代码	519052	519053
报告期末下属分级基金的份额总额	23,864,170.21 份	27,944,810.37 份

2.2 基金基本情况（转型后）

基金简称	海富通双利债券
基金主代码	519055
交易代码	519055

基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月4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	165,523,673.84份
基金合同存续期	不定期

2.3 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳定增值的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金的投资策略包括资产配置策略、债券投资组合策略、信用类债券投资策略、中小企业私募债投资策略、杠杆策略、可转换债券投资策略、新股申购策略。	
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	双利 A 将表现出低风险、收益相对稳定的特征。	双利 B 则表现出较高风险、收益相对较高的特征。

2.4 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳定增值的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金的投资策略包括资产配置策略、债券投资组合策略、信用类债券投资策略、中小企业私募债投资策略、杠杆策略、可转换债券投资策略、新股申购策略。	
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。	

2.5 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

2.6 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 海富通双利分级债券型证券投资基金

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数 据和指标	2015年1月1日-2015年 12月6日	2014年1月1日-2014年 12月31日	2013年1月1日-2013年 12月31日
	海富通双利分级债券	海富通双利分级债券	海富通双利分级债券
本期已实现 收益	6,679,657.73	67,358,037.45	3,815,137.97
本期利润	6,033,987.56	70,111,059.12	1,700,887.66
加权平均基 金份额本期	0.0853	0.1079	0.0017

海富通双利债券型证券投资基金(原海富通双利分级债券型证券投资基金
转型)2015 年年度报告摘要

利润			
本期基金份额净值增长率	32.51%	17.37%	0.20%
3.1.1.2 期末数据	2015 年 12 月 6 日	2014 年末	2013 年末
据和指标	海富通双利分级债券	海富通双利分级债券	海富通双利分级债券
期末可供分配基金份额利润	0.2491	0.1027	0.0017
期末基金资产净值	59,201,538.36	96,101,072.95	1,027,087,260.37
期末基金份额净值	1.143	1.032	1.002

3.1.2 海富通双利债券型证券投资基金

金额单位：人民币元

3.1.2.1 期间数据和指标	报告期 2015 年 12 月 7 日至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	178,214.24
本期利润	170,890.71
加权平均基金份额本期利润	0.0033
本期基金份额净值增长率	0.61%
3.1.2.2 期末数据和指标	2015 年末

期末可供分配基金份额利润	0.2741
期末基金资产净值	190,563,247.81
期末基金份额净值	1.151

注：1、本基金合同生效日为2013年12月4日。合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

5、原海富通双利分级债券型证券投资基金之双利A、双利B以2015年12月4日各自的份额净值为基础，按照本基金的基金份额净值（NAV）转换为海富通双利债券型证券投资基金，双利A转换比例为1：0.89404383，双利B转换比例为1：1.09048392。

3.2 基金净值表现（转型前）

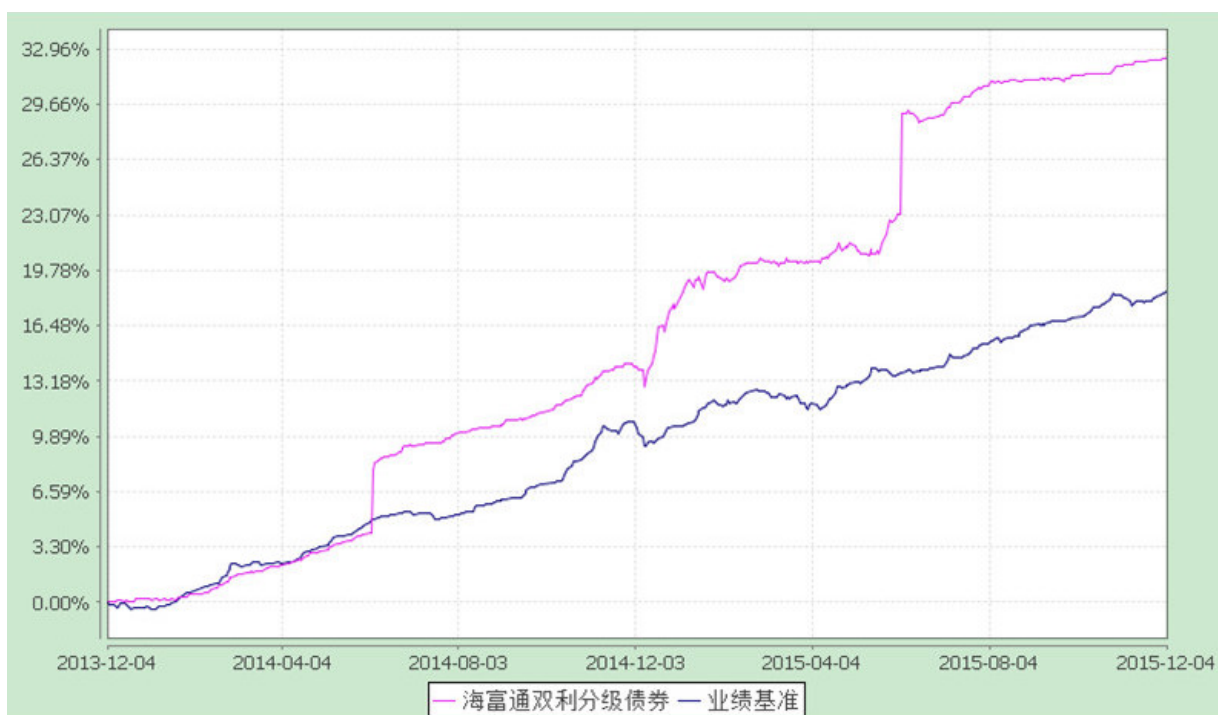
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率①	基金份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.88%	0.04%	1.40%	0.08%	-0.52%	-0.04%
过去六个月	2.79%	0.06%	4.01%	0.07%	-1.22%	-0.01%
过去一年	12.67%	0.35%	7.31%	0.08%	5.36%	0.27%
自基金合同生效起至今	32.51%	0.30%	18.59%	0.09%	13.92%	0.21%

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

海富通双利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的历史走势对比图
(2013年12月4日至2015年12月6日)

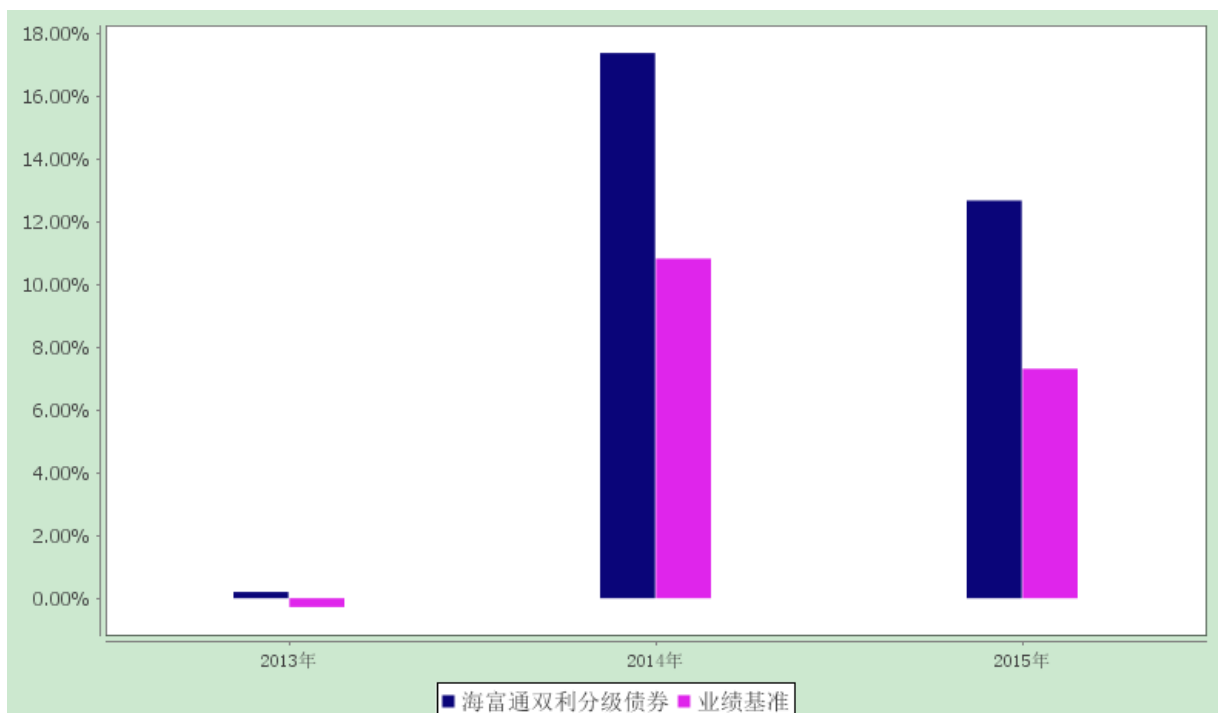


注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分（二）投资范围、（六）投资限制中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通双利分级债券型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为2013年12月4日。图中列示的2013年度基金净值增长率期间为2013年12月4日至2013年12月31日。本基金转型日为2015年12月7日，图中列示的2015年度基金净值增长率期间为2015年1月1日至2015年12月6日。

3.3 基金净值表现（转型后）

3.3.1 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

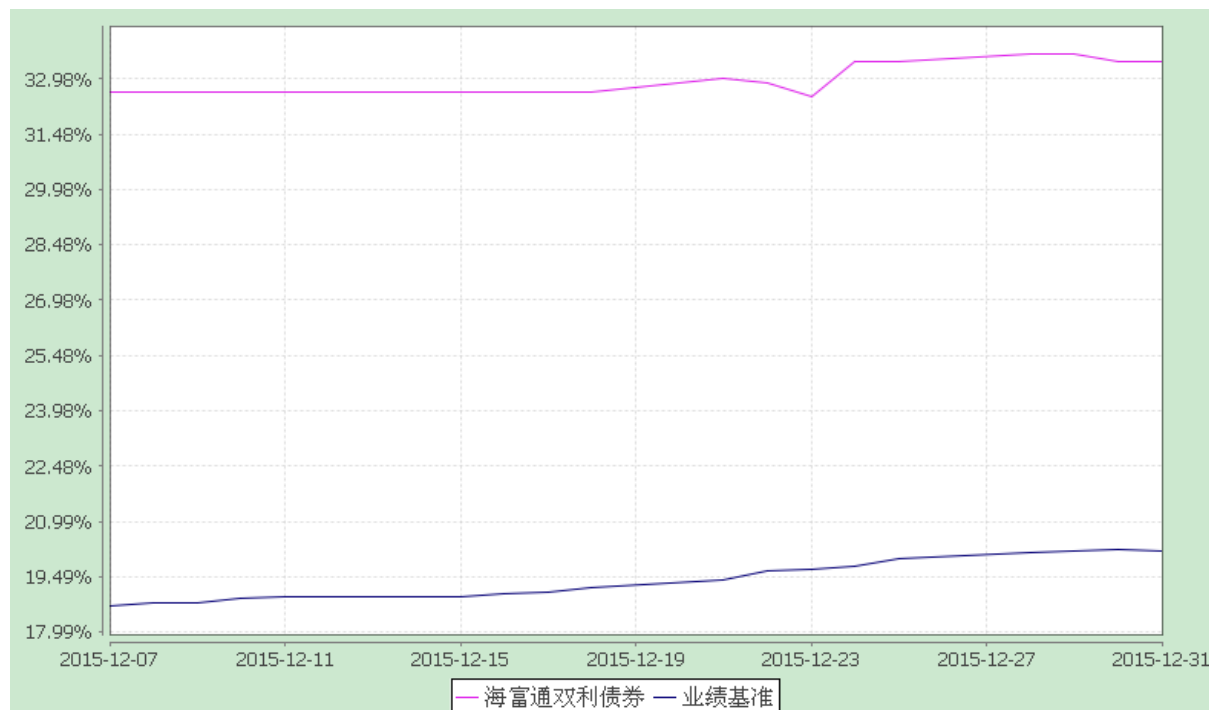
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金转型起至今	0.61%	0.20%	1.25%	0.07%	-0.64%	0.13%

3.3.2 自基金转型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的历史走势对比图

(2015年12月7日至2015年12月31日)



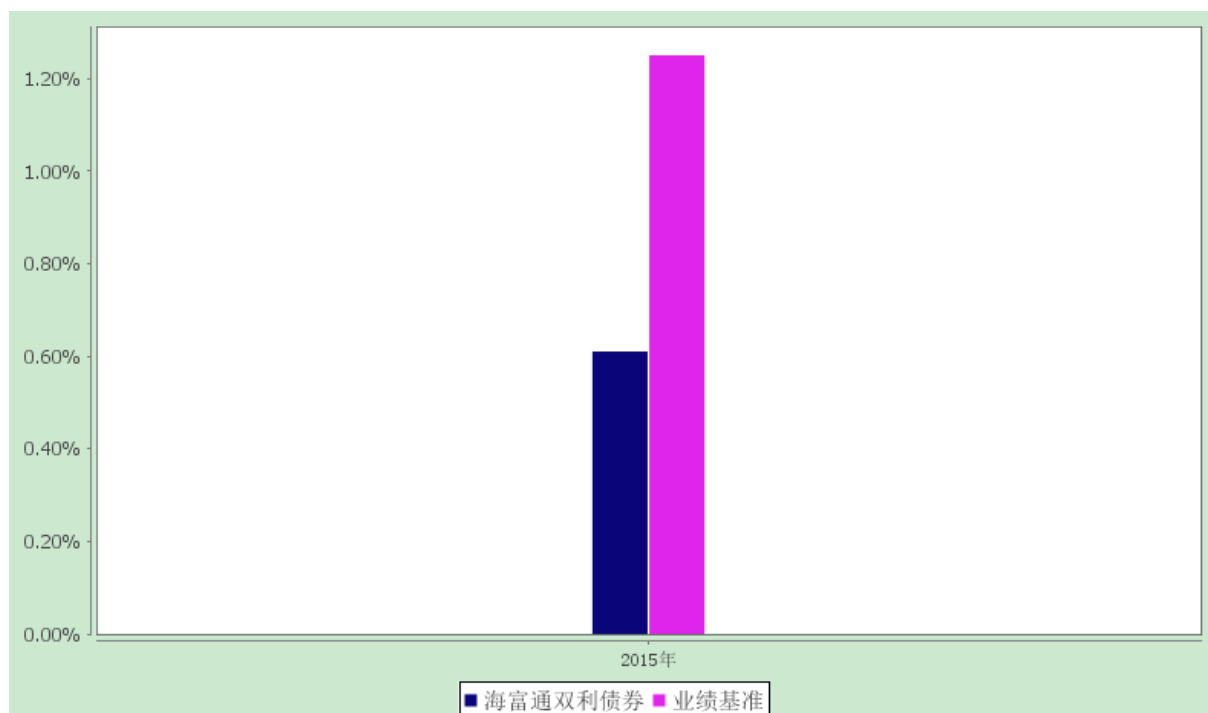
注：1、本基金转型日期为2015年12月7日，截止报告期末，本基金转型未满一年。

2、按照本基金合同规定，本基金建仓期为自基金合同生效起六个月。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、（五）投资限制中规定的各项比例。

3.3.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通双利债券型证券投资基金

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金转型日为2015年12月7日，图中列示的2015年度基金净值增长率期间为2015年12月7日至2015年12月31日。

3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	-	-	-	-	-
2014年	-	-	-	-	-
2013年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金合同于2013年12月4日生效，未实施过利润分配。

3.5 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

单位：人民币元

年度	每10份基金 份额分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合 计	备注
2015年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金于2015年12月7日转型，未实施过利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎投资管理 BE 控股公司”）于2003年4月1日共同发起设立。截至2015年12月31日，本基金管理人共管理31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。

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；海富通双福分级债券基金经理；海富通一年定开债券基金经理；海富通纯债债券基金经理	2013-12-30	-	10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。2015年12月起兼任海富通一年定开债券基金经理和海富通纯债债券基金经理。

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。

3、本公司于2016年1月4日发布公告，自2016年1月4日起，聘任夏妍妍女士担任本基金基金经理助理。

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 公平交易制度和控制方法

公司根据证监会 2011 年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，公司建立了严格的投资交易行为监控制度，公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部、监察稽核部和风险管理部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

报告期内，对公司旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95%置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易，未发生投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年经济基本面总体疲弱，在三期叠加的大背景下经济增速出现放缓，工业、投资等多项经济数据屡屡创下近年来的新低。而随着全球通缩风险蔓延、大宗商品下跌，2015 全年的通胀率一直处于较低的水平。在这种情况下，政府一方面促转型调结构，提出了供给侧改革的思路；另一方面也依旧显现出较强的稳增长意愿。首先，货币政策持续宽松，全年央行共实施了五次降准和五

次降息,并持续通过 SLF、MLF 等定向手段向市场注入流动性。其次,财政政策也积极发力,并推出万亿地方债置换以及千亿专项金融债。宽货币和宽财政起到了一定的托底效果,但也受到一定制约,比如资金向实体传导不畅、地方财政和杠杆约束等问题。

在此背景下,债券市场延续了牛市行情,一方面资金利率总体保持低位平稳,另一方面 6 月份以后股市断崖式下跌,市场风险偏好急剧下降,大量资金涌入债市,带动利率债、信用债收益率大幅下行,期限利差和信用利差均迅速收窄。信用债在钱多缺资产的格局下表现更为出色,尤其是在经济下行信用风险加大的情况下中短久期、中高评级信用债成为市场追捧对象,信用利差被压缩至历史低位,城投债也因为地方债置换安全度提高而投资情绪回暖。转债方面,1 至 5 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。虽然四季度股市有所反弹,但转债受制于高估值弹性严重不足。

2015 年,本基金总体上保持着低杠杆、短久期运作。信用债方面,本基金不断降低城投债的仓位,同时提高了中高等级公司债的配置力度。转债方面,在一季度逐步减持之后就较少参与。利率债方面,前期主要是少量短期参与,转型为开放式债基后参与力度显著提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,原海富通双利分级债券型证券投资基金(2015.1.1-2015.12.6)基金份额净值增长率为 12.67%,同期业绩比较基准收益率为 7.31%,海富通双利债券型证券投资基金(2015.12.7-2015.12.31)基金份额净值增长率为 0.61%,同期业绩比较基准收益率为 1.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济基本面看,当前经济仍未出现明显的见底信号。2016 年上半年可能出现工业增长和固定资产投资的进一步下行。但是,2016 年传统的稳增长政策尤其是积极财政政策可能会加码,下半年经济或许能逐步企稳,尚待观察。货币政策方面,目前利率市场化几近收官,降息政策边际效应递减,央行开始逐步构建一个适应新经济和金融环境的货币政策框架:从数量型调控转为价格型调控、从存贷款基准利率调控转变为利率走廊调控,在利率、汇率、金融稳定等多目标管理下明年货币政策难以出现大幅放水但也难以转向,总体仍会维持平稳和适度宽松,降准的空间会大于降息。

在这种环境下,我们对 2016 年债市保持谨慎乐观,基本面和资金面因素对债市仍相对有利,限制收益率出现大幅上行的可能,但财政发力带来的挤出效应、宽货币转向宽信用可能性加大,也

会制约收益率下行的速度和空间，因此债市可能呈现区间波动的特性。此外，股市和汇市的变化仍是最大的不确定因素，两者影响了国内和国际的资金流向，对债市形成阶段性扰动。

展望 2016 年，本基金将根据规模变动情况来优化组合结构。根据当前宏观经济和债券市场的现状，未来本基金将以利率债和中高等级信用债为主要投资标的，采取中等久期和较低杠杆的策略。对于可转债和长久期利率债，主要是择机波段交易。

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

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

本报告期内，本基金托管人在对海富通双利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)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,海富通双利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)的管理人——海富通基金管理有限公司在海富通双利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)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,海富通双利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)未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的海富通双利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)2015年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 海富通双利债券型证券投资基金

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。
投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

6.2 海富通双利分级债券型证券投资基金

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。
投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 海富通双利分级债券型证券投资基金

7.1.1 资产负债表（转型前）

会计主体：海富通双利分级债券型证券投资基金

报告截止日：2015年12月6日

单位：人民币元

资产	本期末 2015年12月6日	上年度末 2014年12月31日
资产：	-	-
银行存款	18,093,035.09	15,565,933.72
结算备付金	367,639.13	3,347,500.00
存出保证金	8,574.30	107,303.04
交易性金融资产	23,434,383.10	87,240,495.75
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	23,434,383.10	87,240,495.75
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	4,000,000.00
应收证券清算款	16,906,945.64	-
应收利息	755,889.93	1,680,510.28
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	59,566,467.19	111,941,742.79

负债和所有者权益	本期末 2015年12月6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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	15,348,889.55
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	6,809.34	92,462.47
应付托管费	1,945.51	26,417.87
应付销售服务费	2,003.38	31,299.95
应付交易费用	200.00	1,600.00
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	353,970.60	340,000.00
负债合计	364,928.83	15,840,669.84
所有者权益:	-	-
实收基金	46,294,170.95	86,257,101.20
未分配利润	12,907,367.41	9,843,971.75
所有者权益合计	59,201,538.36	96,101,072.95
负债和所有者权益总计	59,566,467.19	111,941,742.79

注: 1.报告截止日 2015 年 12 月 6 日(基金合并运作前日), A 类基金份额净值 1.022 元, B 类基金份额净值 1.246 元, 基金份额总额 51,808,980.58 份, 其中 A 类基金份额 23,864,170.21 份, B 类基金份额 27,944,810.37 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 6 日(基金合并运作前日)止期间。

7.1.2 利润表

会计主体：海富通双利分级债券型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月6日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至 2015年12月6日	2014年1月1日至 2014年12月31日
一、收入	7,382,862.42	88,795,225.39
1.利息收入	3,718,583.64	55,021,020.37
其中：存款利息收入	165,004.97	13,788,768.49
债券利息收入	3,504,414.88	39,921,331.98
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	49,163.79	1,310,919.90
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	4,309,948.95	31,021,183.35
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,309,948.95	31,021,183.35
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-645,670.17	2,753,021.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	1,348,874.86	18,684,166.27
1. 管理人报酬	500,564.73	4,789,347.22

2. 托管费	143,018.45	1,368,385.04
3. 销售服务费	202,102.34	1,868,465.79
4. 交易费用	2,915.93	12,452.70
5. 利息支出	108,237.81	10,235,347.47
其中：卖出回购金融资产支出	108,237.81	10,235,347.47
6. 其他费用	392,035.60	410,168.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	6,033,987.56	70,111,059.12
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	6,033,987.56	70,111,059.12

7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通双利分级债券型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月6日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015年1月1日至2015年12月6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）	86,257,101.20	9,843,971.75	96,101,072.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,033,987.56	6,033,987.56
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）	-39,962,930.25	-2,970,591.90	-42,933,522.15
其中：1.基金申购款	1,116,024.58	82,958.22	1,198,982.80

2.基金赎回款	-41,078,954.83	-3,053,550.12	-44,132,504.95
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）	46,294,170.95	12,907,367.41	59,201,538.36
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,025,386,372.71	1,700,887.66	1,027,087,260.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	70,111,059.12	70,111,059.12
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）	-939,129,271.51	-61,967,975.03	-1,001,097,246.54
其中：1.基金申购款	48,860,459.31	1,879,361.40	50,739,820.71
2.基金赎回款	-987,989,730.82	-63,847,336.43	-1,051,837,067.25
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）	86,257,101.20	9,843,971.75	96,101,072.95

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1.1 至 7.1.4, 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

7.1.4 报表附注

7.1.4.1 基金基本情况

海富通双利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[2013]第 1084 号《关于核准海富通双利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《海富通双利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, 本基金以“运作周年滚动”的方式运作。双利 A 自基金合同生效日起每满 6 个月开放申购和赎回一次, 双利 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申购和赎回一次。双利 A 和双利 B 每次开放均仅开放一个工作日。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,024,312,220.00 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(2013)第 716 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《海富通双利分级债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 4 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 1,025,386,372.71 份, 其中认购资金利息折合 1,074,152.71 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《海富通双利分级债券型证券投资基金基金合同》和《海富通双利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, 即双利 A 和双利 B。双利 A 根据基金合同的规定获取约定收益, 双利 A 自基金合同生效日起每满 6 个月开放一次, 在双利 A 的单独开放日, 基金管理人将对双利 A 进行基金份额折算, 双利 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利 A 份额数按折算比例相应增减; 本基金在扣除双利 A 的本金及应计收益后的全部剩余资产归双利 B 享有, 亏损以双利 B 的资产净值为限由双利 B 首先承担, 双利 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。本基金双利 A 与双利 B 的份额初始配比原则上为 7: 3。

根据基金合同以及海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)披露的《海富通双利分级债券型证券投资基金分级份额终止运作及基金份额转换事宜的公告》, 投资者认购或申购且未赎回的每一份双利 A 和双利 B 基金份额, 在本基金份额转换基准日(即 2015 年 12 月 4 日)日终, 基金管理人将按照基金合同所约定的运作周年内资产及收益的分配规定分别计算基金份额净值、双利

A 和双利 B 的份额净值，双利 A 和双利 B 份额按各自份额净值与基金份额净值之比为基准转换为海富通双利债券型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通双利分级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固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、中小企业私募债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、债券回购、次级债、短期融资券、资产支持证券、中期票据、银行存款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固定收益类金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可投资于一级市场新股网上申购和增发新股申购，因通过发行、行权、可转换债券转股等原因形成的股票、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%。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。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在双利 A 的每个开放日前 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。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 3 月 24 日批准报出。

7.1.4.2 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》、《海富通双利分级债券型证券投资基金 投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.1.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 6 日(基金合并运作前日)止期间的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 12 月 6 日(基金合并运作前日)的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 6 日(基金合并运作前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.1.4.4 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。

7.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.1.4.5.2 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。

7.1.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.1.4.6 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》、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》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，包括买卖债券的差价收入，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。

7.1.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
法国巴黎投资管理 BE 控股公司(BNP Paribas Investment Partners BE Holding)	基金管理人的股东
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
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.1.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.1.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.1.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.1.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.1.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.1.4.8.2 关联方报酬

7.1.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月6日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	500,564.73	4,789,347.22
其中：支付销售机构的客户维护费	127,302.60	1,621,689.27

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%的费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.70% / 当年天数。

7.1.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年 12月6日	2014年1月1日至2014年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	143,018.45	1,368,385.04

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

7.1.4.8.2.3 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
	2015年1月1日至2015年12月6日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国工商银行	200,708.87
海富通	79.10
海通证券	21.85
合计	200,809.82
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国工商银行	1,787,726.52
海富通	63,532.69
海通证券	3.64
合计	1,851,262.85

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日海富通双利分级债券 A 的基金资产净值年费率 0.50% 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=前一日海富通双利分级债券 A 的基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

7.1.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.1.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.1.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.1.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.1.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年12月6日		2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,093,035.09	23,194.50	15,565,933.72	126,247.69
合计	1,093,035.09	23,194.50	15,565,933.72	126,247.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.1.4.8.6 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。

7.1.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.1.4.9 期末（2015年12月6日）本基金持有的流通受限证券

7.1.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.1.4.9.2 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。

7.1.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.1.4.9.3.1 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证券。

7.1.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的证券。

7.1.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2015年12月6日(基金合并运作前日)，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为23,434,383.10元，无属于第一层次和第三层次的余额(2014年12月31日：属于第一层次的余额为86,961,495.75元，属于第二层次的余额为279,000.00元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，本基金于2015年3月24日起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(附注7.1.4.4.15)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年12月6日(基金合并运作前日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.2 海富通双利债券型证券投资基金

7.2.1 资产负债表（转型后）

会计主体：海富通双利债券型证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2015年12月31日
资产：	-
银行存款	6,237,156.09
结算备付金	367,639.13
存出保证金	8,574.30
交易性金融资产	184,261,876.10
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	184,261,876.10
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	2,500,000.00
应收证券清算款	-
应收利息	3,206,543.62
应收股利	-

应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	196,581,789.24
负债和所有者权益	本期末 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	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	5,419,173.22
应付赎回款	212,919.48
应付管理人报酬	33,472.71
应付托管费	9,563.61
应付销售服务费	2,337.41
应付交易费用	1,075.00
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	340,000.00
负债合计	6,018,541.43
所有者权益:	-
实收基金	145,195,456.55
未分配利润	45,367,791.26
所有者权益合计	190,563,247.81
负债和所有者权益总计	196,581,789.24

注: 1.报告截止日 2015 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.151 元, 基金份额总额

165,523,673.84 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2015 年 12 月 7 日(基金合并运作后首日)至 2015 年 12 月 31 日。

7.2.2 利润表

会计主体：海富通双利债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 12 月 7 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2015 年 12 月 7 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		196,199.21
1.利息收入		128,135.52
其中：存款利息收入	7.2.4.6.11	7,239.68
债券利息收入		111,184.52
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		9,711.32
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		75,366.41
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.2.4.6.13	75,366.41
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.2.4.6.17	-7,323.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.2.4.6.18	20.81

减：二、费用		25,308.50
1. 管理人报酬		26,663.37
2. 托管费		7,618.10
3. 销售服务费		334.03
4. 交易费用	7.2.4.6.19	928.80
5. 利息支出		3,334.80
其中：卖出回购金融资产支出		3,334.80
6. 其他费用	7.2.4.6.20	-13,570.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		170,890.71
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		170,890.71

7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通双利债券型证券投资基金

本报告期：2015年12月7日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015年12月7日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	46,294,170.95	12,907,367.41	59,201,538.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	170,890.71	170,890.71
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)	98,901,285.60	32,289,533.14	131,190,818.74

其中：1.基金申购款	114,336,563.92	35,858,066.61	150,194,630.53
2.基金赎回款	-15,435,278.32	-3,568,533.47	-19,003,811.79
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）	145,195,456.55	45,367,791.26	190,563,247.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.2.1 至 7.2.4，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

7.2.4 报表附注

7.2.4.1 基金基本情况

海富通双利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原海富通双利分级债券型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原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[2013]第 1084 号《关于核准海富通双利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《海富通双利分级债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型证券投资基金，原基金以“运作周年滚动”的方式运作。双利 A 自基金合并运作后首日起每满 6 个月开放申购和赎回一次，双利 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申购和赎回一次。双利 A 和双利 B 每次开放均仅开放一个工作日。原基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,024,312,220.00 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(2013)第 716 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通双利分级债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 4 日正式生效，基金合并运作后首日的基金份额总额为 1,025,386,372.71 份，其中认购资金利息折合 1,074,152.71 份基金份额。

根据《海富通双利分级债券型证券投资基金基金合同》以及海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)披露的《海富通双利分级债券型证券投资基金分级份额终止运作及基金份额转换

事宜的公告》，投资者认购或申购且未赎回的每一份双利 A 和双利 B 基金份额，在本基金份额转换基准日(即 2015 年 12 月 4 日)日终，基金管理人将按照基金合同所约定的运作周年内资产及收益的分配规定分别计算基金份额净值、双利 A 和双利 B 的份额净值，双利 A 和双利 B 份额按各自份额净值与基金份额净值之比为基准转换为海富通双利债券型证券投资基金(基金简称：海富通双利债券，基金代码：519055)的份额。无论基金份额持有人单独持有或同时持有双利 A 和双利 B 份额，均无需支付本次转换基金份额的费用。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《海富通双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固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、中小企业私募债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、债券回购、次级债、短期融资券、资产支持证券、中期票据、银行存款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固定收益类金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可投资于一级市场新股网上申购和增发新股申购，因通过发行、行权、可转换债券转股等原因形成的股票、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%。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。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在双利 A 的每个开放日前 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。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 3 月 24 日批准报出。

7.2.4.2 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》、《海富通双利债券型证券投资基金投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.2.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 12 月 7 日(基金合并运作后首日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的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 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 12 月 7 日(基金合并运作后首日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.2.4.6 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》、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》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, 包括买卖债券的差价收入, 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。

7.2.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“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
法国巴黎投资管理 BE 控股公司(BNP Paribas Investment Partners BE Holding)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.2.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.2.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.2.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期期间无应支付关联方的佣金。

7.2.4.8.2 关联方报酬

7.2.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年12月7日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	26,663.37
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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%的费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.70% / 当年天数。

7.2.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2015年12月7日至2015年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	7,618.10	

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

7.2.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.2.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.2.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.2.4.8.5 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	
	2015年12月7日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	6,237,156.09	6,816.26
合计	6,237,156.09	6,816.26

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.2.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期期间未通过关联方购买其承销的证券。

7.2.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.2.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.2.4.9.2 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。

7.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.4.9.3.1 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证券。

7.2.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的证券。

7.2.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为184,261,876.10元，无属于第一层次和第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 海富通双利分级债券型证券投资基金

8.1.1 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	23,434,383.10	39.34
	其中：债券	23,434,383.10	39.34
	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	18,460,674.22	30.99
7	其他各项资产	17,671,409.87	29.67
8	合计	59,566,467.19	100.00

8.1.2 报告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。

8.1.3 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。

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1 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进行股票投资。

8.1.4.2 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进行股票投资。

8.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

8.1.5 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	4,946,840.00	8.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,006,900.00	5.08
	其中：政策性金融债	3,006,900.00	5.08
4	企业债券	15,480,643.10	26.15
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	23,434,383.10	39.58

8.1.6 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	010107	21 国债(7)	46,000	4,946,840.00	8.36
2	122170	12 江药债	48,600	4,860,486.00	8.21
3	122909	10 宜兴债	31,200	3,141,840.00	5.31
4	122085	11 深高速	30,000	3,054,900.00	5.16
5	018001	国开 1301	30,000	3,006,900.00	5.08

8.1.7 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。

8.1.8 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。

8.1.9 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。

8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1.10.1 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。

8.1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本组合不参与股指期货投资。

8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.1.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本组合不参与国债期货投资。

8.1.11.2 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。

8.1.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本组合不参与国债期货投资。

8.1.12 投资组合报告附注

8.1.12.1 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。

8.1.12.2 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。

8.1.12.3 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	8,574.30
2	应收证券清算款	16,906,945.64
3	应收股利	-
4	应收利息	755,889.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,671,409.87

8.1.12.4 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。

8.1.12.5 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。

8.2 海富通双利债券型证券投资基金

8.2.1 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	184,261,876.10	93.73
	其中：债券	184,261,876.10	93.73
	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	2,500,000.00	1.27
	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	6,604,795.22	3.36
7	其他各项资产	3,215,117.92	1.64
8	合计	196,581,789.24	100.00

8.2.2 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。

8.2.3 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。

8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.2.4.1 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进行股票投资。

8.2.4.2 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进行股票投资。

8.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

8.2.5 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	47,894,343.00	25.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,668,300.00	62.80
	其中：政策性金融债	119,668,300.00	62.80
4	企业债券	16,699,233.10	8.76
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	184,261,876.10	96.69

8.2.6 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	150210	15 国开 10	500,000	54,180,000.00	28.43
2	150314	15 进出 14	500,000	52,475,000.00	27.54
3	010107	21 国债(7)	250,100	27,118,343.00	14.23
4	010303	03 国债(3)	200,000	20,776,000.00	10.90
5	150215	15 国开 15	100,000	10,013,000.00	5.25

8.2.7 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。

8.2.8 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。

8.2.9 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。

8.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.2.10.1 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。

8.2.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本组合不参与股指期货投资。

8.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.2.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本组合不参与国债期货投资。

8.2.11.2 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。

8.2.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本组合不参与国债期货投资。

8.2.12 投资组合报告附注

8.2.12.1 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。

8.2.12.2 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。

8.2.12.3 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	8,574.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,206,543.62
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,215,117.92

8.2.12.4 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。

8.2.12.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 海富通双利分级债券型证券投资基金

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
海富通双利分级 债券 A	445	53,627.35	-	-	23,864,170.21	100.00%
海富通双利分级 债券 B	13	2,149,600.80	27,941,276.14	99.99%	3,534.23	0.01%
合计	458	113,120.04	27,941,276.14	53.93%	23,867,704.44	46.07%

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）。

9.1.2 海富通双利债券型证券投资基金

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
354	467,581.00	153,636,099.55	92.82%	11,887,574.29	7.18%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

9.2.1 海富通双利分级债券型证券投资基金

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	海富通双利分级债券 A	107.54	0.0005%
	海富通双利分级债券 B	-	-
	合计	107.54	0.0002%

9.2.2 海富通双利债券型证券投资基金

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	海富通双利债券	96.12	0.0001%
	合计	96.12	0.0001%

9.3 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

9.3.1 海富通双利分级债券型证券投资基金

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

9.3.2 海富通双利债券型证券投资基金

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	海富通双利债券	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通双利债券	0

	合计	0
--	----	---

§10 开放式基金份额变动

10.1 海富通双利分级债券型证券投资基金

(报告期: 2015年1月1日-2015年12月6日)

单位: 份

项目	海富通双利分级债券 A	海富通双利分级债券 B
基金合同生效日(2013年12月4日)基金份额总额	717,474,010.21	307,912,362.50
本报告期期初基金份额总额	65,204,557.45	27,944,810.37
本报告期基金总申购份额	1,198,982.80	-
减: 本报告期基金总赎回份额	44,132,504.95	-
本报告期基金拆分变动份额	1,593,134.91	-
本报告期期末基金份额总额	23,864,170.21	27,944,810.37

10.2 海富通双利债券型证券投资基金

(报告期: 2015年12月7日-2015年12月31日)

单位: 份

项目	海富通双利债券
基金转型日(2015-12-07)基金份额总额	35,914,846.94
本报告期期初基金份额总额	35,914,846.94
本报告期基金总申购份额	130,339,884.03
减: 本报告期基金总赎回份额	731,057.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	165,523,673.84

注: (1)、海富通双利分级债券型证券投资基金报告期期间:2015年1月1日至2015年12月6日。

(2)、海富通双利债券型证券投资基金报告期期间:2015年12月7日至2015年12月31日。

(3)、基金转型日:2015年12月7日。

(4)、基金转型日份额 35,914,846.94 份与转型前日份额 51,808,980.58 份差额为 15,894,133.64 份，主要原因是：在基金转型日 2015 年 12 月 7 日确认 2015 年 12 月 4 日投资者双利 A 赎回申请 9,941,176.45 份，双利 B 赎回申请 6,424,932.97 份；并于 2015 年 12 月 7 日对确认赎回申请后的海富通双利分级债券型证券投资基金 A 类份额、B 类份额进行转换。转型日基金份额 $35,914,846.94 = (\text{双利 A} 2015 \text{ 年 } 12 \text{ 月 } 6 \text{ 日份额} - 2015 \text{ 年 } 12 \text{ 月 } 7 \text{ 日双利 A 确认赎回份额}) * \text{转换比例} + (\text{双利 B} 2015 \text{ 年 } 12 \text{ 月 } 6 \text{ 日份额} - 2015 \text{ 年 } 12 \text{ 月 } 7 \text{ 日双利 B 确认赎回份额}) * \text{转换比例}$ 。

(5)、总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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 8 月 20 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四十五次临时

会议审议通过，同意孟辉先生辞去公司副总经理职务。

2015 年 10 月 15 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，聘请陈虹女士担任本公司监事，奚万荣先生不再担任本公司监事。

2016 年 1 月 20 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。

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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为其审计的会计师事务所。报告期内应付审计费金额为 60,000 元，目前事务所已提供审计服务是 2 年。

11.6 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。本报告期内，公司已经完成了决定书中所指出问题的整改工作并通过了监管部门的检查验收。公司整改期于 2015 年 8 月 10 日正式结束，公司自该日起可以正常上报基金产品。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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 海富通双利分级债券型证券投资基金

11.7.1.1 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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总 额的比例		金总量的 比例	
国金证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券(原齐鲁)	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

注：1、于2015年1月26日，宏源证券更名为申万宏源。

2、本基金本报告期内租用券商交易单元没有发生变更。

3、（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核准。

11.7.1.2 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
中金公司	374,278,352.07	86.45%	1,121,900,000.00	91.01%	-	-
东兴证券	58,678,432.22	13.55%	110,800,000.00	8.99%	-	-

11.7.2 海富通双利债券型证券投资基金

11.7.2.1 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	
国金证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券(原齐鲁)	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

注：1、于2015年1月26日，宏源证券更名为申万宏源。

2、本基金本报告期内租用券商交易单元没有发生变更。

3、（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核准。

11.7.2.2 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
兴业证券	31,890,833.20	59.94%	40,500,000.00	27.31%	-	-
中泰证券(原齐鲁)	21,312,123.30	40.06%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	107,800,000.00	72.69%	-	-

§12 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12月31日，海富通管理的公募基金资产规模超过469亿元人民币。

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12月31日，海富通为近80家企业超过349亿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 12 月 31 日，海富通旗下专户理财管理资产规模超过 103 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 12 月 31 日，投资咨询及海外业务规模超过 111 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。

海富通基金管理有限公司

二〇一六年三月二十八日