

海富通双利债券型证券投资基金
2016 年半年度报告
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 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	13
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合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	34
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	35
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	35
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	35
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	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	35
7.12 投资组合报告附注	36

§8 基金份额持有人信息	36
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	37
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.....	37
§9 开放式基金份额变动	37
§10 重大事件揭示	37
10.1 基金份额持有人大会决议.....	37
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.....	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4 基金投资策略的改变.....	38
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	38
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.....	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	38
10.8 其他重大事件.....	40
§11 影响投资者决策的其他重要信息	42
§12 备查文件目录	43
12.1 备查文件目录.....	43
12.2 存放地点.....	43
12.3 查阅方式.....	43

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	35,870,253.11 份
基金合同存续期	不定期

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，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。

2.3 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
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴花园	北京市西城区复兴门内大街

	石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层	55号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	张文伟	易会满

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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	1,021,995.96
本期利润	1,122,829.22
加权平均基金份额本期利润	0.0127
本期加权平均净值利润率	1.10%
本期基金份额净值增长率	1.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	10,118,915.03
期末可供分配基金份额利润	0.2821

期末基金资产净值	41,731,912.85
期末基金份额净值	1.163
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	1.66%

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）。

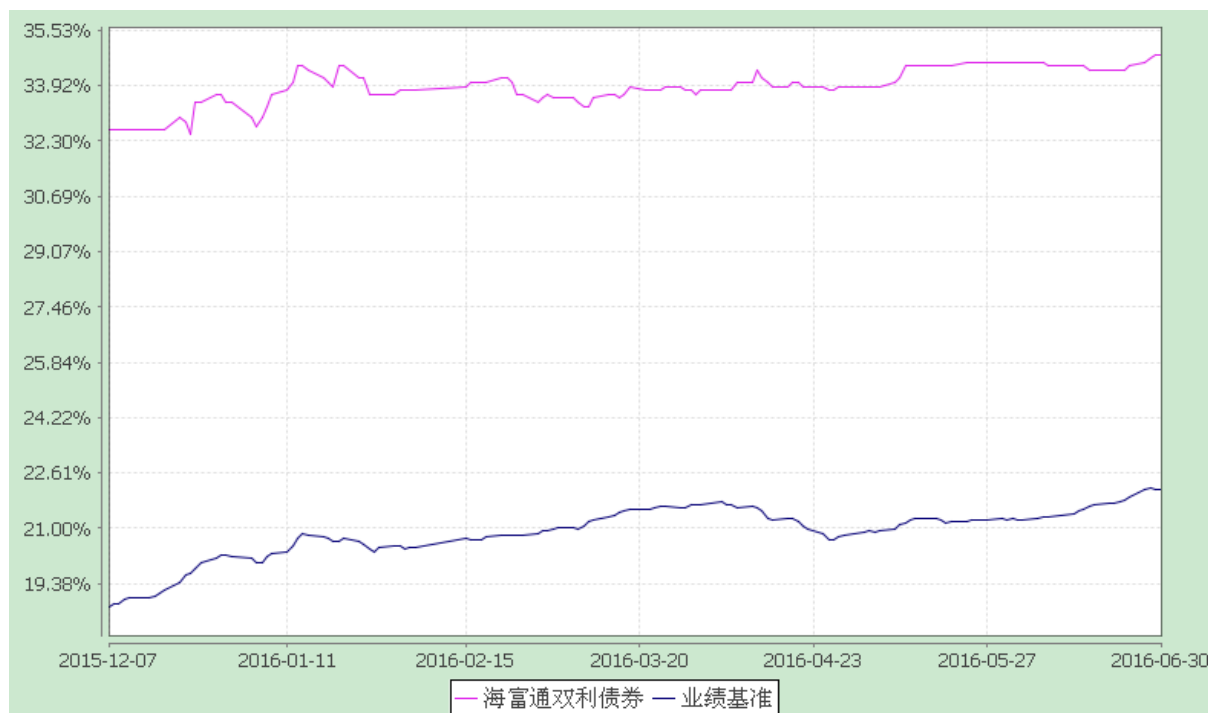
3.2 基金净值表现

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	0.17%	0.05%	0.72%	0.05%	-0.55%	0.00%
过去三个月	0.87%	0.07%	0.36%	0.06%	0.51%	0.01%
过去六个月	1.04%	0.11%	1.62%	0.06%	-0.58%	0.05%
自基金转型起至今	1.66%	0.13%	2.90%	0.07%	-1.24%	0.06%

3.2.2 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历史走势对比图
 (2015年12月7日至2016年6月30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。

§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		
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	2016-04-29	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 月至 2016 年 4 月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 月至 2016 年 4 月兼任海富通双福分级债券基金经理。2015 年 12 月至 2016 年 4 月兼任海富通一年定开债券和海富通纯债债券基金经理。
何谦	本基金的基金经理；海富通纯债债	2016-05-06	-	5 年	硕士, 持有基金从业人员资格证书。历任平安银行资金交易员, 华安基金管理有限

	券基金经理；海富通双福分级基金经理；海富通货币基金经理				公司债券交易员，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司，任海富通货币基金经理助理。2016 年 5 月起任海富通纯债债券、海富通双福分级债券、海富通双利债券及海富通货币基金经理。
谈云飞	本基金的基金经理；海富通季季增利理财债券基金经理；海富通稳健添利债券基金经理；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；海富通纯债债券基金经理	2016-04-22	-	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。
夏妍妍	本基金的基金经理助理；海富通纯债债券基金经理助理；海富通双福分级债券基金经理助理；海富通养老收益混合基金经理助理；海富通一年定开债券基金经理助理	2016-01-04	-	1 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生，西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师，2014 年加入海富通基金管理有限公司，任固定收益分析师。2016 年 1 月起任海富通双利债券、海富通双福分级债券、海富通养老收益混合、海富通一年定开债券、海富通纯债债券的基金经理助理。

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。

3、本公司于 2016 年 7 月 26 日发布公告，自 2016 年 7 月 22 日起，聘任张靖爽女士担任本基金基金经理。

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，公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，检验结果表明，在 T 日、T+3 日和 T+5 日不同循环期内，不管是买入或是卖出，公司各组合间买卖价差并不显著，表明报告期内公司对旗下各基金进行了公平对待，不存在各投资组合之间进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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。

本基金在 1 月集中增持了长久期政策性金融债，但在春节前后完成减持。随后基金规模稍有波动，稳定后开始大幅提高信用债的配置比例。春节后，参与了一些可转债交易。本基金在二季度初显著降低了信用债的仓位，在四月份信用债的调整中受损较小，在五、六月份小幅提高了高等级信用债的仓位，显著提高了长端利率债的仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，基金净值增长率为 1.04%，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。

本基金下半年将继续延续信用债基本配置、参与可转债交易性机会的策略，选择一些溢价率低、公司基本面良好的转债进行配置，力争为持有人获得较好的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值委员会，委员会成员具有 3 年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能，并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组。估值工作小组充分听取相关部门的建议，并和相关托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告，以便估值委员会决策。

估值政策经估值委员会审阅同意，并经本公司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

本报告期内，本基金自 2016 年 4 月 13 日至 2016 年 6 月 30 日，连续 55 个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§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合规守信、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双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：海富通双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	132,419.41	6,237,156.09
结算备付金		76,082.29	367,639.13
存出保证金		48,930.08	8,574.30
交易性金融资产	6.4.7.2	48,676,111.00	184,261,876.10
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		48,676,111.00	184,261,876.10
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	-	2,500,000.00
应收证券清算款		4,880,935.80	-
应收利息	6.4.7.5	586,513.48	3,206,543.62

应收股利		-	-
应收申购款		123.99	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		54,401,116.05	196,581,789.24
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		-	-
卖出回购金融资产款		12,299,878.50	-
应付证券清算款		-	5,419,173.22
应付赎回款		112,401.32	212,919.48
应付管理人报酬		16,600.16	33,472.71
应付托管费		4,742.90	9,563.61
应付销售服务费		-	2,337.41
应付交易费用	6.4.7.7	1,346.50	1,075.00
应交税费		-	-
应付利息		5,164.92	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	229,068.90	340,000.00
负债合计		12,669,203.20	6,018,541.43
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	31,455,474.56	145,195,456.55
未分配利润	6.4.7.10	10,276,438.29	45,367,791.26
所有者权益合计		41,731,912.85	190,563,247.81
负债和所有者权益总计		54,401,116.05	196,581,789.24

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.163 元，基金份额总额 35,870,253.11 份。

6.2 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：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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		1,797,062.30
1.利息收入		1,515,674.01
其中：存款利息收入	6.4.7.11	29,352.77
债券利息收入		1,465,330.87
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		20,990.37
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-197,926.30
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	-197,926.30
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	100,833.26
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	378,481.33
减：二、费用		674,233.08
1. 管理人报酬		360,681.26
2. 托管费		103,051.78
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,951.52
5. 利息支出		36,263.62
其中：卖出回购金融资产支出		36,263.62
6. 其他费用	6.4.7.20	170,284.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,122,829.22
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,122,829.22
-------------------	--	---------------------

注：本基金由海富通双利分级债券型证券投资基金于 2015 年 12 月 07 日转型而来，上年度可比期间无比较数据。

6.3 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：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）	145,195,456.55	45,367,791.26	190,563,247.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,122,829.22	1,122,829.22
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）	-113,739,981.99	-36,214,182.19	-149,954,164.18
其中：1.基金申购款	24,391,925.60	7,795,233.68	32,187,159.28
2.基金赎回款	-138,131,907.59	-44,009,415.87	-182,141,323.46
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）	31,455,474.56	10,276,438.29	41,731,912.85

注：本基金由海富通双利分级债券型证券投资基金于 2015 年 12 月 07 日转型而来，上年度可比期间无比较数据。

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 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》、《海富通双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 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 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、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 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	132,419.41
定期存款	-
其他存款	-
合计	132,419.41

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 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	28,646,370.08	16,740.92
	银行间市场	19,943,130.00	69,870.00
	合计	48,589,500.08	86,610.92

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	48,589,500.08	48,676,111.00	86,610.92

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 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,081.13
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	30.78
应收债券利息	585,381.77
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	19.80
合计	586,513.48

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
	2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	1,346.50
合计	1,346.50

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2016 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	229,068.90
合计	229,068.90

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	165,523,673.84	145,195,456.55
本期申购	27,815,996.67	24,391,925.60
本期赎回（以“-”号填列）	-157,469,417.40	-138,131,907.59
本期末	35,870,253.11	31,455,474.56

注：申购含转入份额，赎回含转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	45,945,133.71	-577,342.45	45,367,791.26
本期利润	1,021,995.96	100,833.26	1,122,829.22
本期基金份额交易产生的变动数	-36,848,214.64	634,032.45	-36,214,182.19
其中：基金申购款	7,789,652.13	5,581.55	7,795,233.68
基金赎回款	-44,637,866.77	628,450.90	-44,009,415.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,118,915.03	157,523.26	10,276,438.29

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,037.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,646.01
其他	3,669.34
合计	29,352.77

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期期间无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	526,569,318.94
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	517,822,369.84
减：应收利息总额	8,944,875.40
买卖债券差价收入	-197,926.30

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期期间无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期期间无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期期间无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	100,833.26
——股票投资	-
——债券投资	100,833.26
——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	100,833.26

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	378,345.89
基金转换费收入	135.44
合计	378,481.33

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	1,376.52
银行间市场交易费用	2,575.00
合计	3,951.52

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	119,233.64
债券托管账户维护费	18,800.00
银行划款手续费	2,416.00
合计	170,284.90

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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。

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 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	360,681.26
其中：支付销售机构的客户维护费	18,397.73

注：1、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。

2、本基金由海富通双利分级债券型证券投资基金于 2015 年 12 月 07 日转型而来,上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	103,051.78

注：1、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。

2、本基金由海富通双利分级债券型证券投资基金于 2015 年 12 月 07 日转型而来,上年度可比期间无比较数据。

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

本基金本报告期期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	132,419.41	20,037.42
合计	132,419.41	20,037.42

注：1、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。

2、本基金由海富通双利分级债券型证券投资基金于 2015 年 12 月 07 日转型而来，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

海富通双利债券型证券投资基金于 2016 年 7 月实施本年度第一次分红：收益分配基准日为 2016 年 7 月 1 日，权益登记日、除息日为 2016 年 7 月 20 日，现金红利发放日为 2016 年 7 月 22 日；本次分红方案为：2.23 元/10 份基金份额，以现金形式发放总额：489,397,731.14 元，以再投资形式发放总额：61,505.26 元，本次利润分配总额共计：489,459,236.40 元。

本基金初始面值为 1 元，由于基金转换原因，截至 2016 年 7 月 1 日的面值为 0.877 元。本次分红收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后为 0.943 元，不低于面值，符合基金合同要求。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 999,878.50 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
160408	16 农发 08	2016-07-05	100.59	10,000	1,005,900.00
合计				10,000	1,005,900.00

6.4.12.3.2 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 11,300,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型证券投资基金，属于中低风险品种。本基金投资的金融工具主要为固定收益类金融工具。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以上风险控制在限定的范围之内，使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。

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，

确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年末 2015年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	12,592,440.00	13,013,300.00
合计	12,592,440.00	13,013,300.00

注：未评级部分为政策性金融债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年末 2015年12月31日
AAA	486,495.00	8,426,623.50
AAA 以下	3,322,500.00	8,272,609.60
未评级	32,274,676.00	154,549,343.00
合计	36,083,671.00	171,248,576.10

注：未评级部分为国债、政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余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。

于 2016 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 12,299,878.50 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计

2016 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	132,419.41	-	-	-	132,419.41
结算备付金	76,082.29	-	-	-	76,082.29
存出保证金	48,930.08	-	-	-	48,930.08
交易性金融资产	12,592,440.00	486,495.00	35,597,176.00	-	48,676,111.00
应收申购款	-	-	-	123.99	123.99
应收证券清算款	-	-	-	4,880,935.80	4,880,935.80
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	586,513.48	586,513.48
资产总计	12,849,871.78	486,495.00	35,597,176.00	5,467,573.27	54,401,116.05
负债					
卖出回购金融资产款	12,299,878.50	-	-	-	12,299,878.50
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	112,401.32	112,401.32
应付管理人报酬	-	-	-	16,600.16	16,600.16
应付托管费	-	-	-	4,742.90	4,742.90
应付交易费用	-	-	-	1,346.50	1,346.50
应付利息	-	-	-	5,164.92	5,164.92
其他负债	-	-	-	229,068.90	229,068.90
负债总计	12,299,878.50	-	-	369,324.70	12,669,203.20
利率敏感度缺口	549,993.28	486,495.00	35,597,176.00	5,098,248.57	41,731,912.85
上年度末 2015 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	6,237,156.09	-	-	-	6,237,156.09
结算备付金	367,639.13	-	-	-	367,639.13
存出保证金	8,574.30	-	-	-	8,574.30
交易性金融资产	23,620,713.10	6,091,820.00	154,549,343.00	-	184,261,876.10
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	2,500,000.00	-	-	-	2,500,000.00
应收利息	-	-	-	3,206,543.62	3,206,543.62

资产总计	32,734,082.62	6,091,820.00	154,549,343.00	3,206,543.62	196,581,789.24
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	5,419,173.22	5,419,173.22
应付赎回款	-	-	-	212,919.48	212,919.48
应付管理人报酬	-	-	-	33,472.71	33,472.71
应付托管费	-	-	-	9,563.61	9,563.61
应付销售服务费	-	-	-	2,337.41	2,337.41
应付交易费用	-	-	-	1,075.00	1,075.00
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	340,000.00	340,000.00
负债总计	-	-	-	6,018,541.43	6,018,541.43
利率敏感度缺口	32,734,082.62	6,091,820.00	154,549,343.00	-2,811,997.81	190,563,247.81

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 16	增加约 290
	市场利率上升 25 个基点	减少约 16	减少约 284

注：金额为约数，精确到万元。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，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%，投资于债券的比例不低于基金资产的 80%。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。

于 2016 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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	48,676,111.00	89.48
	其中：债券	48,676,111.00	89.48
	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	208,501.70	0.38
7	其他各项资产	5,516,503.35	10.14
8	合计	54,401,116.05	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。

7.3 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

本基金本报告期内未进行股票投资。

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进行股票投资。

7.4.3 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。

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	24,854,116.00	59.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,013,000.00	47.96
	其中：政策性金融债	20,013,000.00	47.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,808,995.00	9.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	48,676,111.00	116.64
----	----	---------------	--------

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	019533	16 国债 05	126,000	12,592,440.00	30.17
2	010107	21 国债(7)	113,450	12,261,676.00	29.38
3	160408	16 农发 08	100,000	10,059,000.00	24.10
4	160205	16 国开 05	100,000	9,954,000.00	23.85
5	110033	国贸转债	10,000	1,179,000.00	2.83

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本组合不参与股指期货投资。

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，本组合不参与国债期货投资。

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，本组合不参与国债期货投资。

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	48,930.08
2	应收证券清算款	4,880,935.80
3	应收股利	-
4	应收利息	586,513.48
5	应收申购款	123.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,516,503.35

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

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

302	118,775.67	27,400,758.88	76.39%	8,469,494.23	23.61%
-----	------------	---------------	--------	--------------	--------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	96.12	0.0003%

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金转型日（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	165,523,673.84
本报告期基金总申购份额	27,815,996.67
减：本报告期基金总赎回份额	157,469,417.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	35,870,253.11

§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

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

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	
兴业证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

方正证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内租用券商交易单元没有发生变更。

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。

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
兴业证券	303,715,235.31	52.35%	279,900,000.00	51.21%	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	90,835,771.75	15.66%	74,000,000.00	13.54%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	4,856,913.70	0.84%	26,000,000.00	4.76%	-	-
东方证券	11,408,434.68	1.97%	-	-	-	-
中泰证券	114,618,991.	19.76%	164,200,000	30.04%	-	-

	55	%	.00	%		
民族证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	28,722,041.92	4.95%	-	-	-	-
中金公司	26,000,854.68	4.48%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	2,500,000.00	0.46%	-	-

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 2015 年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-01
2	海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-04
3	海富通基金管理有限公司关于旗下基金在指数熔断期间调整开放时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-04
4	海富通基金管理有限公司关于因交易所发生指数熔断至收市调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-04
5	海富通基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停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》	2016-01-06
6	海富通基金管理有限公司关于因交易所发生指数熔断至收市调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-08
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宜信普泽投资顾问（北京）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》	2016-01-13
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在宜信普泽投资顾问（北京）有限公司开展申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-13
9	海富通基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-20
10	海富通基金管理有限公司关于参加上海凯石财富基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-28
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海凯石财富基金销售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》	2016-01-28

12	海富通基金管理有限公司关于参加中证金牛（北京）投资咨询有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-03-02
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中证金牛（北京）投资咨询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》	2016-03-02
14	海富通基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-03-03
15	海富通基金管理有限公司关于参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-03-09
16	海富通基金管理有限公司关于参加泰诚财富基金销售（大连）有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-03-11
17	海富通基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-03-11
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京展恒基金销售股份有限公司为销售机构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》	2016-03-31
19	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》	2016-04-16
20	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》	2016-04-19
21	海富通双利债券型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-04-26
22	海富通基金管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-04-28
23	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构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》	2016-04-29
24	海富通双利债券型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-04-30
25	海富通基金管理有限公司关于参加深圳富济财富管理有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-04-30
26	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳富济财富管理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》	2016-04-30
27	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构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》	2016-04-30

28	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增奕丰金融服务（深圳）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》	2016-05-07
29	海富通双利债券型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-05-10
30	海富通基金管理有限公司关于官方淘宝店和网上直销支付宝渠道暂停办理基金开户、申购等业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-05-17
31	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信期货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》	2016-05-28
32	海富通基金管理有限公司关于参加上海联泰资产管理有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-06-16
33	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华金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》	2016-06-21
34	海富通基金管理有限公司关于参加浙江金观诚财富管理有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-06-23
35	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江金观诚财富管理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》	2016-06-23
36	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在官方京东店开展申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-06-28

§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。

§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利债券型证券投资基金的文件
- （二）海富通双利债券型证券投资基金基金合同
- （三）海富通双利债券型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通双利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）报告期内本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
二〇一六年八月二十六日