

海富通一年定期开放债券型证券投资基金
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。本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通一年定开债券	
基金主代码	519051	
交易代码	519051	
基金运作方式	契约型开放式，本基金以定期开放方式运作。	
基金合同生效日	2013 年 10 月 24 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,314,210,942.66 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通一年定 A	海富通一年定 C
下属分级基金的交易代码	519051	001976
报告期末下属分级基金的份 额总额	1,260,250,207.33 份	53,960,735.33 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，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债券投资组合策略、信用类债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、杠杆策略、可转换债券投资策略及新股申购策略。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于较低风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	海富通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	奚万荣	洪渊
	联系电话	021-38650891	010-66105799
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-33830166	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	2015 年		2014 年		2013 年 10 月 24 日（基 金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日	
	海富通一 年定 A	海富通一 年定 C	海富通一 年定 A	海富通一 年定 C	海富通一年 定 A	海富通一 年定 C
本期已实现 收益	35,034,12 3.10	46,489.95	48,049,86 0.68	-	4,685,243.9 7	-
本期利润	30,025,55 5.74	540,477.1 5	63,868,83 9.94	-	4,685,516.9 3	-
加权平均基 金份额本期 利润	0.2050	0.1879	0.1566	-	0.0096	-
本期基金份 额净值增长 率	20.82%	0.62%	46.44%	-	1.00%	-
3.1.2 期末数 据和指标	2015 年末		2014 年末		2013 年末	
	海富通一 年定 A	海富通一 年定 C	海富通一 年定 A	海富通一 年定 C	海富通一年 定 A	海富通一 年定 C

期末可供分配基金份额利润	0.7872	0.7870	0.2429	-	0.0096	-
期末基金资产净值	2,252,276,565.73	96,428,677.15	83,166,227.38	-	493,680,275.88	-
期末基金份额净值	1.787	1.787	1.479	-	1.010	-

注：1、本基金合同生效日为 2013 年 10 月 24 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、本基金自 2015 年 11 月 23 日起，根据收费模式的不同，将基金份额分为 A 类和 C 类。

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

1. 海富通一年定 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.42%	0.12%	1.00%	0.01%	0.42%	0.11%
过去六个月	0.22%	0.18%	1.90%	0.01%	-1.68%	0.17%
过去一年	20.82%	1.17%	3.75%	0.01%	17.07%	1.16%
自基金合同生效起至今	78.70%	1.02%	8.93%	0.01%	69.77%	1.01%

2. 海富通一年定 C:

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

		准差②	率③	率标准差 ④		
自基金合 同生效起 至今	0.62%	0.05%	0.41%	0.01%	0.21%	0.04%

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

海富通一年定期开放债券型证券投资基金

自基金合同生效以来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

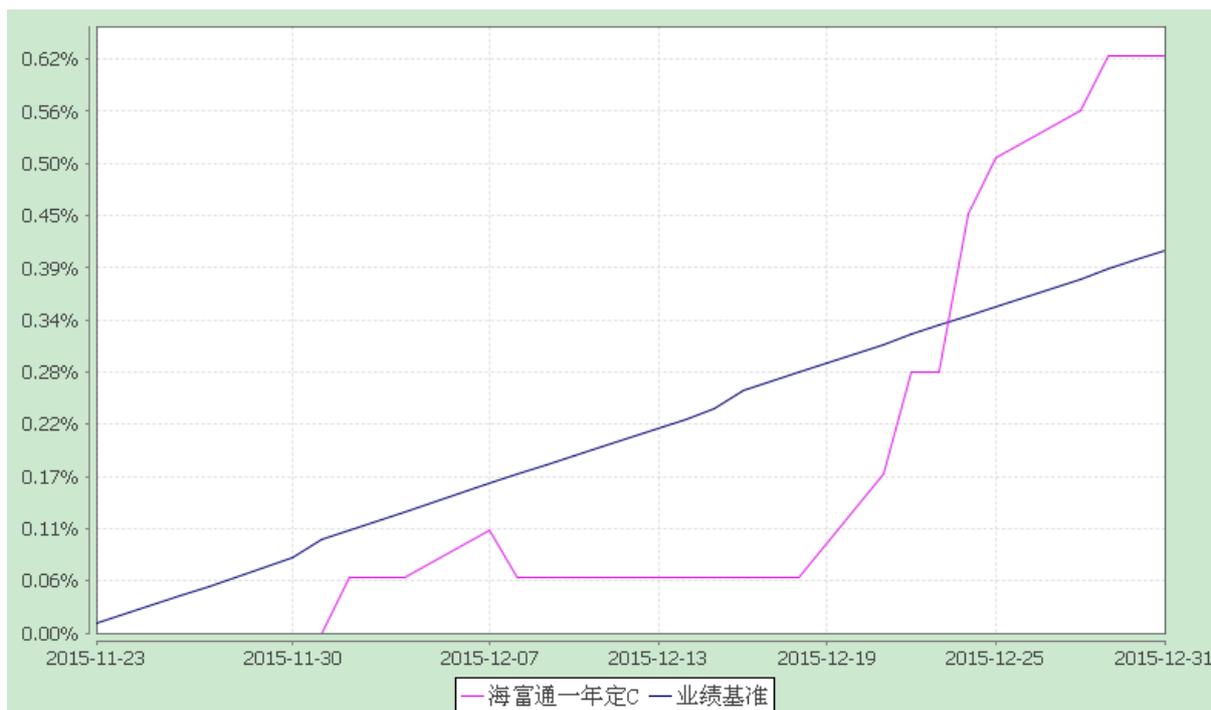
1. 海富通一年定 A

(2013 年 10 月 24 日至 2015 年 12 月 31 日)



2. 海富通一年定 C

(2015 年 11 月 23 日至 2015 年 12 月 31 日)



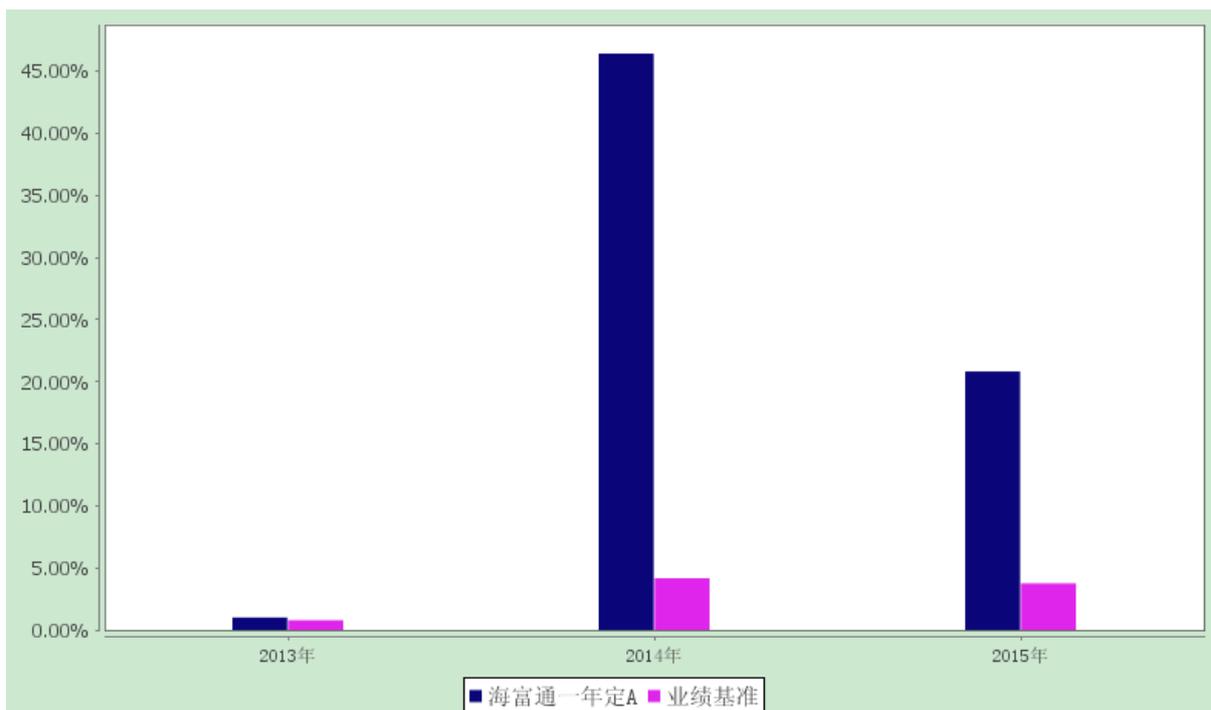
注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

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

海富通一年定期开放债券型证券投资基金

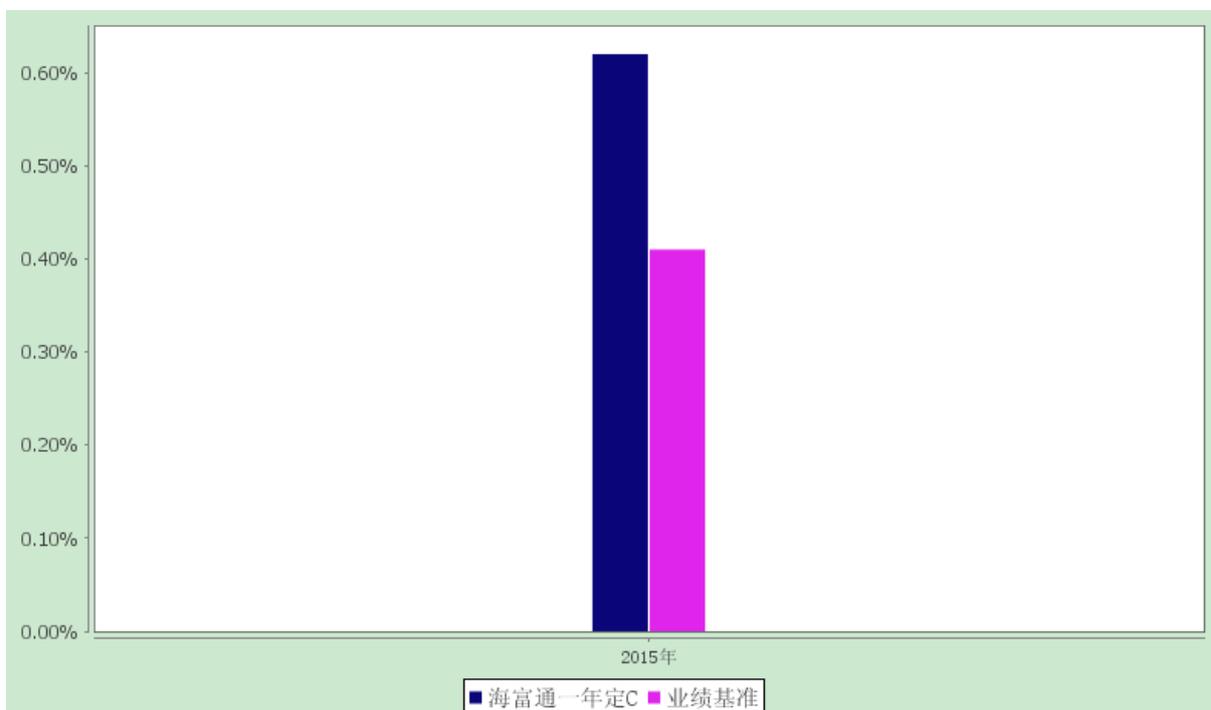
自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1. 海富通一年定 A



注：图中列示的 2013 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 10 月 24 日(基金合同生效日)起至 12 月 31 日止计算。

2. 海富通一年定 C



注：本基金自 2015 年 11 月 23 日起增加 C 类份额，图中列示的 2015 年度基金净值增长率自 11 月 23 日起至 12 月 31 日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通一年定 A:

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	-	-	-	-	-

2、海富通一年定 C:

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：1、本基金合同于 2013 年 10 月 24 日生效，未实施利润分配。

2、本基金自 2015 年 11 月 23 日起，根据收费模式的不同，将基金份额分为 A 类和 C 类。

§ 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		
凌超	本基金的基金经理；海富通纯债债券基金经理；海富通稳固收益债券基金经理；海富通稳进增利债券（LOF）基金经理；海富通现金管理货币基金经理	2013-12-19	-	9 年	硕士,持有基金从业人员资格证书,先后任职于长江证券股份有限公司、光大保德信基金管理有限公司,曾任光大保德信货币基金经理。2006 年 7 月至 2009 年 6 月在长江证券股份有限公司先后担任债券高级研究员、投资经理;2009 年 7 月至 2010 年 2 月在光大保德信基金管理有限公司担任债券研究员,2010 年 2 月至 2010 年 8 月担任光大保德信增利收益债券基金经理助理,2010 年 9 月至 2012 年 2 月担任光大保德信货币基金经理;2012 年 3 月加入海富通基金管理有限公司,2013 年 3 月至 2015 年 10 月任海富通现金管理货币基金经理。2013 年 12 月至 2016 年 1 月兼任海富通一年定开债券基金

					经理。2014 年 4 月至 2016 年 1 月兼任海富通纯债债券基金经理。2014 年 12 月至 2016 年 1 月兼任海富通稳固收益债券和海富通稳进增利债券 (LOF) 基金经理。
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；海富通双利债券基金经理；海富通纯债债券基金经理	2015-12-18	-	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期开放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、本公司于 2016 年 1 月 14 日发布公告，自 2016 年 1 月 12 日起，凌超先生不再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。

本基金在 2015 年总体维持中短久期。一季度，考虑政策托底力度逐步增大，股票二级市场表现相对积极，主要侧重转债品种；二季度，考虑权益市场上行趋势较强但波动加剧，对权益仓位进行适度减持，组合结构趋于平衡；三季度，基金仓位保持稳定，操作上保持低杠杆短久期；四季度开放期后，基金规模显著增长，随后开始建仓操作，以高等级短融、公司债和利率债为主要标的。转债方面一直保持较低仓位，参与力度较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通一年定期开放债券 A 基金净值增长率为 20.82%，同期业绩比较基准收益率为 3.75%。海富通一年定期开放债券 C 基金净值增长率为 0.62%，同期业绩比较基准收益率为 0.41%。

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 international 的资金流向，对债市形成阶段性扰动。

展望 2016 年，本基金对债市谨慎乐观，主要配置高评级中等久期信用债，辅以适量配置高性价比信用个券，择机通过长久期利率债波段操作增厚收益。转债方面耐心等待市场调整后的机会，适量参与。建仓期之后拟采用一定杠杆，争取为持有人实现较高的稳定回报。

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

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

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一年定期开放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，海富通一年定期开放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一年定期开放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，海富通一年定期开放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一年定期开放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

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 资产负债表

会计主体：海富通一年定期开放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	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	5,550,247.39	1,378,969.62
结算备付金	3,276,456.44	3,854,461.03
存出保证金	41,556.13	153,527.84
交易性金融资产	2,331,432,523.13	134,824,930.95
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,331,432,523.13	134,824,930.95
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	-	-
应收证券清算款	-	11,833,246.51
应收利息	21,224,492.57	577,905.84
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,361,525,275.66	152,623,041.79
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 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	11,000,000.00	69,000,000.00
应付证券清算款	2,140.36	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,044,103.72	44,052.87
应付托管费	298,315.37	12,586.54

应付销售服务费	17,919.06	-
应付交易费用	17,554.27	175.00
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	440,000.00	400,000.00
负债合计	12,820,032.78	69,456,814.41
所有者权益：		
实收基金	1,314,210,942.66	56,238,597.68
未分配利润	1,034,494,300.22	26,927,629.70
所有者权益合计	2,348,705,242.88	83,166,227.38
负债和所有者权益总计	2,361,525,275.66	152,623,041.79

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.787 元，基金份额总额 1,314,210,942.66 份。其中 A 类基金份额总额 1,260,250,207.33 份，基金份额净值 1.787 元；C 类基金份额总额 53,960,735.33 份，基金份额净值 1.787 元。

7.2 利润表

会计主体：海富通一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	34,283,893.12	78,964,483.86
1.利息收入	6,612,603.82	32,926,037.26
其中：存款利息收入	492,332.25	9,669,858.52
债券利息收入	6,000,031.33	23,044,007.07
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	120,240.24	212,171.67
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	32,184,256.78	30,218,476.16
其中：股票投资收益	2,457,590.96	-
基金投资收益	-	-

债券投资收益	29,726,665.82	30,218,476.16
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）	-4,514,580.16	15,818,979.26
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,612.68	991.18
减：二、费用	3,717,860.23	15,095,643.92
1. 管理人报酬	1,734,023.77	3,019,521.86
2. 托管费	495,435.38	862,720.51
3. 销售服务费	17,922.36	-
4. 交易费用	163,072.90	12,107.72
5. 利息支出	823,094.71	10,747,599.72
其中：卖出回购金融资产支出	823,094.71	10,747,599.72
6. 其他费用	484,311.11	453,694.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	30,566,032.89	63,868,839.94
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	30,566,032.89	63,868,839.94

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015 年 1 月 1 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）	56,238,597.68	26,927,629.70	83,166,227.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数	-	30,566,032.89	30,566,032.89

(本期利润)			
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)	1,257,972,344.98	977,000,637.63	2,234,972,982.61
其中: 1.基金申购款	1,294,674,659.26	1,005,500,204.97	2,300,174,864.23
2.基金赎回款	-36,702,314.28	-28,499,567.34	-65,201,881.62
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)	1,314,210,942.66	1,034,494,300.22	2,348,705,242.88
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)	488,994,758.95	4,685,516.93	493,680,275.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	63,868,839.94	63,868,839.94
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)	-432,756,161.27	-41,626,727.17	-474,382,888.44
其中: 1.基金申购款	23,140,059.75	2,971,660.27	26,111,720.02
2.基金赎回款	-455,896,221.02	-44,598,387.44	-500,494,608.46
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)	56,238,597.68	26,927,629.70	83,166,227.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海富通一年定期开放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 1062 号《关于核准海富通一年定期开放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《海富通一年定期开放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 488,739,053.00 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 637 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 10 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 488,994,758.95 份，其中认购资金利息折合 255,705.95 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《关于海富通一年定期开放债券型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，自 2015 年 11 月 23 日起，本基金根据赎回费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额的称为 A 类基金份额；从本类基金资产中计提销售服务费，并不再收取认购/申购费用的基金份额的称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，并分别计算基金份额净值。

本基金以定期开放的方式运作，在本基金的封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金的封闭期为自《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效之日起(包括生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期最长不超过 20 个工作日，最短不少于 5 个工作日，开放期的具体时间由基金管理人在开放期前依照《证券投资基金信息披露办法》的有关规定在指定媒体上予以公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通一年定期开放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国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款等，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，也可持有因可转换债券转股所形成的股票以及股票派发或可分离交易可转债分离交易的权证等资产。因上述原因持有的股票、权证等权益类资产，基金将在其可交易之日起的 6 个月内卖出。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80 % (但应开放期流动性需要, 为保护基金份额持有人利益, 开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制); 本基金持有的股票、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%。

开放期内, 本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%, 封闭期内不受上述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为: 一年期银行定期存款税后收益率+1.2%。

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。

7.4.2 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》、《海富通一年定期开放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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间没有需作说明的会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.8.1.1 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。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.2 关联方报酬**7.4.8.2.1 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31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	1,734,023.77	3,019,521.86
其中：支付销售机构的客户维护费	529,601.06	1,697,077.90

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31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托管费	495,435.38	862,720.51

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。

7.4.8.2.3 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31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通一年定A	海富通一年定C	合计
中国工商银行	-	-	-
海通证券	-	-	-
海富通	-	3,189.91	3,189.91
合计	-	3,189.91	3,189.91
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		
	海富通一年定A	海富通一年定C	合计
中国工商银行	-	-	-
海通证券	-	-	-
海富通	-	-	-
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类份额对应的基金资产净值的年费率 0.40% 计提,逐日累计至每月月底,按月支付给海富通基金管理有限公司,再由海富通基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日销售服务费=前一日 C 类份额对应的基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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31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	5,550,247.39	303,763.52	1,378,969.62	64,689.42

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。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 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。

7.4.9 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

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
136087	15 保利 01	2015-12-11	2016-01-22	新债未上市	99.99	99.99	500,000	49,996,273.97	49,996,273.97	-
136095	15 锡交 01	2015-12-17	2016-01-29	新债未上市	99.98	99.98	350,000	34,994,047.12	34,994,047.12	-
136108	14 粤运 02	2015-12-21	2016-01-28	新债未上市	99.97	99.97	269,040	26,896,553.28	26,896,553.28	-
136088	15 保利 02	2015-12-11	2016-01-22	新债未上市	99.99	99.99	200,000	19,998,386.85	19,998,386.85	-
136106	15 三友 02	2015-12-17	2016-01-14	新债未上市	99.99	99.99	200,000	19,997,676.71	19,997,676.71	-
136107	15 穗工债	2015-12-21	2016-01-11	新债未上市	99.96	99.96	20,000	1,999,281.10	1,999,281.10	-
123001	蓝标转债	2015-12-23	2016-01-08	新债未上市	100.00	100.00	6,520	652,000.00	652,000.00	-

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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 11,000,000.00 元，于 2016 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 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且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 3,923,595.00 元，属于第二层次的余额为 2,327,508,928.13 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 134,824,930.95 元，无属于第二层次以及第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(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 7.4.5.2)，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 31 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	2,331,432,523.13	98.73
	其中：债券	2,331,432,523.13	98.73
	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	-	-
	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	8,826,703.83	0.37
7	其他各项资产	21,266,048.70	0.90
8	合计	2,361,525,275.66	100.00

8.2 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。

8.3 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000089	深圳机场	20,799,284.03	25.01
2	002391	长青股份	6,929,732.76	8.33
3	601988	中国银行	6,776,789.94	8.15
4	002408	齐翔腾达	6,269,822.57	7.54
5	600219	南山铝业	6,007,062.64	7.22
6	002521	齐峰新材	5,380,964.32	6.47
7	600023	浙能电力	5,140,675.08	6.18
8	600037	歌华有线	4,739,939.37	5.70
9	601139	深圳燃气	2,702,336.60	3.25

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。

8.4.2 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	000089	深圳机场	21,958,837.61	26.40
2	600219	南山铝业	7,530,561.68	9.05
3	002391	长青股份	6,699,897.72	8.06
4	601988	中国银行	6,441,572.94	7.75
5	002408	齐翔腾达	6,088,915.88	7.32
6	600037	歌华有线	5,849,271.76	7.03
7	002521	齐峰新材	5,253,992.77	6.32
8	600023	浙能电力	5,026,541.56	6.04
9	601139	深圳燃气	2,354,606.35	2.83

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。

8.4.3 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	64,746,607.31
卖出股票的收入（成交）总额	67,204,198.27

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。

8.5 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	24,448,796.40	1.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	532,635,000.00	22.68
	其中：政策性金融债	532,635,000.00	22.68
4	企业债券	442,328,379.73	18.83
5	企业短期融资券	972,529,000.00	41.41
6	中期票据	352,280,000.00	15.00
7	可转债	7,211,347.00	0.31
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,331,432,523.13	99.26

8.6 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	2,500,000	270,900,000.00	11.53
2	150314	15 进出 14	1,500,000	157,425,000.00	6.70
3	041558085	15 中航集 CP001	1,500,000	150,780,000.00	6.42
4	150205	15 国开 05	1,000,000	104,310,000.00	4.44
5	101554094	15 苏交通 MTN004	1,000,000	101,000,000.00	4.30

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	41,556.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,224,492.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	21,266,048.70
---	----	---------------

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	3,923,595.00	0.17
2	110031	航信转债	2,635,752.00	0.11

8.12.5 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

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
海富通一年定A	8,850	142,401.15	619,716,670.32	49.17%	640,533,537.01	50.83%
海富通一年定C	1,803	29,928.31	112,549.24	0.21%	53,848,186.09	99.79%
合计	10,653	123,365.34	619,829,219.56	47.16%	694,381,723.10	52.84%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通一年定A	73,456.41	0.0058%
	海富通一年定C	6,190.21	0.0115%
	合计	79,646.62	0.0061%

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

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	海富通一年定 A	0
	海富通一年定 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通一年定 A	0
	海富通一年定 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通一年定 A	海富通一年定 C
基金合同生效日（2013 年 10 月 24 日）基金份额总额	488,994,758.95	-
本报告期期初基金份额总额	56,238,597.68	-
本报告期基金总申购份额	1,240,713,923.93	53,960,735.33
减：本报告期基金总赎回份额	36,702,314.28	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,260,250,207.33	53,960,735.33

注：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 年第四次临时股东大会审议通过，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。本年度应支付的审计费用是 60,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 3 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 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	
中金公司	2	67,204,198.27	100.00%	60,163.32	100.00%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内交易单元无变化。

(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 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	1,370,902,293.48	82.82%	4,613,900,000.00	69.90%	-	-
东兴证券	187,662,912.03	11.34%	1,613,000,000.00	24.44%	-	-
兴业证券	80,854,330.61	4.88%	297,000,000.00	4.50%	-	-
中泰证券	15,904,843.06	0.96%	77,000,000.00	1.17%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-

§ 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