海富通双利分级债券型证券投资基金

2014 年度报告摘要

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：二〇一五年三月三十日

§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2015年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本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2014年1月1日起至2014年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通双利分级债券
基金主代码	519055
交易代码	519055
基金运作方式	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"。
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	93,149,367.82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	65,204,557.45份	27,944,810.37份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳定增值的基础上，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。

2.3 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	蒋松云
	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	2014年	2013年12月4日（基金合同生效日）至2013年12月31日
本期已实现收益	67,358,037.45	3,815,137.97
本期利润	70,111,059.12	1,700,887.66
加权平均基金份额本期利润	0.1079	0.0017
本期基金份额净值增长率	17.37%	0.20%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.1027	0.0017
期末基金资产净值	96,101,072.95	1,027,087,260.37
期末基金份额净值	1.032	1.002

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）。

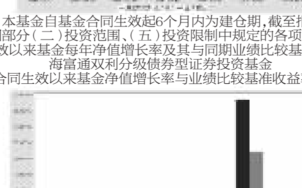
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	5.64%	0.21%	3.25%	0.15%	2.39%	0.06%
过去六个月	7.61%	0.16%	4.86%	0.11%	2.75%	0.05%
过去一年	17.37%	0.26%	10.82%	0.09%	6.55%	0.17%
自基金合同生效起至今	17.61%	0.25%	10.51%	0.09%	7.10%	0.16%

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

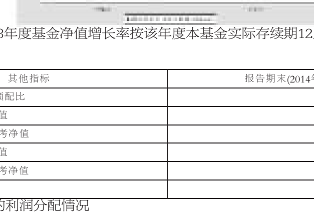
海富通双利分级债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年12月4日至2014年12月31日)



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十四部分（二）投资范围、（五）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：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12月4日（基金合同生效日）起至12月31日止计算。

3.3 其他指标

其他指标	报告期末(2014年12月31日)
双利A与双利B基金份额配比	2.33333333:1
期末双利A份额参考净值	1.004
期末双利A份额累计参考净值	1.052
期末双利B份额参考净值	1.097
期末双利B份额累计参考净值	1.255
双利A的预计年收益率	4.90%

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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
2013年	–	–	–	–	–
2014年	–	–	–	–	–
合计	–	–	–	–	–

注：本基金合同于2013年12月4日生效，未实施利润分配。

§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2014年12月31日，本基金管理人共管理32只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势股票型证券投资基金、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股票型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长股票型证券投资基金、海富通中证100指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘股票型证券投资基金、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、海富通大中华精选股票型证券投资基金、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）、海富通国策导向股票型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通现金管理货币市场基金、海富通养老收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通双利分级债券型证券投资基金、海富通内需热点股票型证券投资基金、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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
位健	本基金的基金经理，海富通货币基金经理，海富通养老收益混合基金经理，海富通一年定开债券基金经理	2013-12-04	2014-03-07	8年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005年3月至2010年5月任银河基金基金经理，2006年3月至2008年4月担任银河银富货币市场基金基金经理助理，2008年4月至2010年5月担任银河银富货币市场基金基金经理。2010年6月至2012年9月任英大证券投资副总监。2012年9月至2012年11月任浙金信托投资总监。2012年12月加入海富通基金管理有限公司。2013年1月至2014年3月任海富通货币基金经理，2013年5月至2014年3月任海富通养老收益混合基金经理，2013年10月至2014年3月任海富通一年定开债券基金经理，2013年12月至2014年3月任海富通双利分级债券基金经理。
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	2013-12-30	–	9年	金融学硕士。持有基金从业人员资格证书。2005年7月至2008年3月任通用技术集团投资管理有限公司研究员，2008年4月至2011年5月任富国基金管理有限公司研究员，2011年5月至2013年7月任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理，2012年5月至2013年7月任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理，2012年6月至2013年7月任富国可转换债券证券投资基金基金经理，2013年11月加入海富通基金管理有限公司。2013年12月起任海富通养老收益混合和海富通双利分级债券基金经理。2014年5月起兼任海富通双福分级债券基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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相对交易金额、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

2014年国内经济基本面较为疲弱，经济下滑预期逐季升温。在这种背景下，央行采取了定向宽松和非对称降息等货币政策，在保持流动性适度充裕的同时引导市场利率下行。债券市场呈现出明显的牛市格局，中债指数持续上涨，债券收益率震荡下行。2014年，中债新综合指数（财富）全年上涨10.34%，创下2002年以来的第二大年度涨幅。中债固定利率国债、政策性金融债、企业债（AAA级）和中短期票据（AAA级）平均收益率分别较上年末下行100、152、136和144个基点。2014年年中以来股市强势上涨，沪港通、一带一路、降息等政策红利以及股市财富效应带来的居民资产配置调整成为股市重要推动力。在股市推动下转债市"水涨船高"，转债个券也全线上涨。

2014年，本基金在风险可控和波动较小的前提下，为持有人实现了较高的收益。一季度基金建仓期主要配置了中等评级信用债和高利率同业存款，但由于产品属性的原因对组合久期控制较严格。二季度本基金迎来双利A的第一个开放日，之后组合杠杆比例被动上升。三季度本基金减持了部分久期稍长债券，参与了个别公司债和可转债的申购。进入四季度后，本基金的资产流动性进一步提高，顺利度过第一个运作周期的开放日。12月中下旬，本基金显著提高了转债的配置比例，信用债的比例也在逐步提升。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为17.37%，同期业绩比较基准收益率为10.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年，我们预计宏观经济难改弱势，通胀水平保持在较低的位置，经济基本面对利率债有一定支撑。但是下半年，需要防备托底政策和地产回暖带来的经济小幅改善的风险。货币政策预计比较宽松，进一步降息或降准的可能性较大。资金面总体预计比较充裕，不过会受到银行信贷投放季节因素、每月IPO、财政缴款等因素扰动。信用债方面，风险与机会并存。在当前经济动能不足、通缩风险加剧的背景下，部分发行人的信用风险仍在上升。但是，信用债供给可能出现下降，需求却依然有增长，良好的供求关系有利于信用利差的缩小。转债方面，全年股市仍有望创出新高，但是波动明显加大。转债市场已陷入供不应求的境地，尚未进入赎回期的品种享受很高的估值溢价。全年来看转债具有交易价值但不具有配置价值。总体而言，今年债市将呈现出区间波动的特征，本基金将灵活操作，随时针对变化调整策略。

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分级债券型证券投资基金2014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：海富通双利分级债券型证券投资基金

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产：		
银行存款	15,565,933.72	811,554,942.80
结算备付金	3,347,500.00	–
存出保证金	107,303.04	–
交易性金融资产	87,240,495.75	503,875,061.05
其中：股票投资	–	–
基金投资	–	–
债券投资	87,240,495.75	503,875,061.05
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	–	43,356,555.95
应收利息	1,680,510.28	16,327,318.15
应收股利	–	–
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	111,941,742.79	1,375,113,877.95
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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	–	319,299,947.20
应付证券清算款	15,348,889.55	27,661,099.70
应付赎回款	–	–
应付管理人报酬	92,462.47	531,406.69
应付托管费	26,417.87	151,830.50
应付销售服务费	31,299.95	265,855.67
应付交易费用	1,600.00	–
应交税费	–	–
应付利息	–	86,477.82
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	340,000.00	30,000.00
负债合计	15,840,669.84	348,026,617.58
所有者权益：		
实收基金	86,257,101.20	1,025,386,372.71
未分配利润	9,843,971.75	1,700,887.66
所有者权益合计	96,101,072.95	1,027,087,260.37
负债和所有者权益总计	111,941,742.79	1,375,113,877.95

注：1. 报告截止日2014年12月31日，A类基金份额净值1.004元，B类基金份额净值1.097元，基金份额总额93,149,367.82份，其中A类基金份额65,204,557.45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2014年度和2013年12月4日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间。

7.2 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：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年12月4日（基金合同生效日）至2013年12月31日
一、收入	88,795,225.39	3,166,102.05
1.利息收入	55,021,020.37	5,270,769.97
其中：存款利息收入	13,788,768.49	3,917,315.39
债券利息收入	39,921,331.98	1,243,937.90
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	1,310,919.90	109,516.68
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"–"填列)	31,021,183.35	9,486.43
其中：股票投资收益	–	–
基金投资收益	–	–
债券投资收益	31,021,183.35	9,486.43
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)	2,753,021.67	–2,114,250.31
4.汇兑收益(损失以"–"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"–"号填列)	–	95.96
减：二、费用	18,684,166.27	1,465,214.39
1.管理人报酬	4,789,347.22	531,406.69
2.托管费	1,368,385.04	151,830.50
3.销售服务费	1,868,465.79	265,855.67
4.交易费用	12,452.70	1,540.60
5.利息支出	10,235,347.47	483,299.43
其中：卖出回购金融资产支出	10,235,347.47	483,299.43
6.其他费用	410,168.05	31,281.50
三、利润总额(亏损总额以"–"号填列)	70,111,059.12	1,700,887.66
减：所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"–"号填列)	70,111,059.12	1,700,887.66

7.3 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：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2013年12月4日(基金合同生效日)至2013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	–	1,025,386,372.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	1,700,887.66	1,700,887.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"–"号填列）	–	–	–
其中：1.基金申购款	–	–	–
2.基金赎回款	–	–	–
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"–"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	1,025,386,372.71	1,700,887.66	1,027,087,260.37

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：张文伟，主管会计工作负责人：陶网雄，会计机构负责人：张琦

7.4 报表附注

7.4.1 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《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2015年3月25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》、《海富通双利分级债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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2014年度和2013年12月4日(基金合同生效日)至2013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2014年12月31日和2013年12月31日的财务状况以及2014年度和2013年12月4日(基金合同生效日)至2013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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2014年度和2013年12月4日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据基金合同的规定，每一运作周年内，本基金（包括双利A 和双利B）不进行收益分配。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

7.4.7 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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年12月4日（基金合同生效日）至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,789,347.22	531,406.69
其中：支付销售机构的客户维护费	1,621,689.27	229,883.10

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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年12月4日（基金合同生效日）至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,368,385.04	151,830.50

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 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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年12月4日(基金合同生效日)至2013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	252,598.87
海富通	11,285.27
海通证券	–
合计	263,884.14

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。

7.4.8.3 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 2014年1月1日至2014年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2013年12月4日(基金合同生效日)至2013年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国中国工商银行	15,565,933.72	126,247.69	11,554,942.80	61,153.99
合计	15,565,933.72	126,247.69	11,554,942.80	61,153.99

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（2014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
110030	格力转债	2014-12-30	2015-01-13	未上市可转债	100.00	100.00	2,790	279,000.00	279,000.00	–

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

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。

7.4.10 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2014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(2013年12月31日：第一层次503,875,061.05元，无属于第二层的余额，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

本基金本期及上年度可比期间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2014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(2013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	87,240,495.75	77.93
	其中：债券	87,240,495.75	77.93
	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	4,000,000.00	3.57
	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	18,913,433.72	16.90
7	其他各项资产	1,787,813.32	1.60
8	合计	111,941,742.79	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

本基金本报告期内未进行股票投资。

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

本基金本报告期内未进行股票投资。

8.4.3 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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	5,619,331.00	5.85
	其中：政策性金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债券	65,085,770.70	67.73
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	16,535,394.05	17.21
8	其他	–	–
9	合计	87,240,495.75	90.78

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	122214	12大秦债	90,400	9,074,352.00	9.44
2	122951	09淮城投	83,390	8,422,390.00	8.76
3	122310	13苏新城	64,890	6,878,340.00	7.16
4	122953	09岳城建	60,490	6,061,098.00	6.31
5	018001	国开1301	54,700	5,619,331.00	5.85

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，本组合不参与股指期货投资。

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，本组合不参与国债期货投资。

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，本组合不参与国债期货投资。

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被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

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

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	113006	深燃转债	5,024,673.00	5.23
2	110019	恒丰转债	4,407,200.00	4.59
3	126729	燕京转债	2,963,707.20	3.08

§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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
海富通双利分级债券A	686	95,050.38	–	–	65,204,557.45	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	699	133,260.90	27,941,276.14	30.00%	65,208,091.68	70.00%

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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

§10 开放式基金份额变动

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	717,474,010.21	307,912,362.50
本报告期基金总申购份额	50,739,820.71	–
减：本报告期基金总赎回份额	723,033,148.57	328,475,443.23
本报告期基金拆分变动份额	20,023,875.10	48,507,891.10
本报告期期末基金份额总额	65,204,557.45	27,944,810.37

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

1、2014年6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审议通过，同意陈洪先生辞去公司副总经理职务。

2、2014年9月27日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司2014年第二次股东会议审议通过，聘请魏海诺（Mr. Bruno Weil）先生担任本公司监事。同时，谷若鸿(Mr. Laurent couraudon)先生不再担任本公司监事。

3、2014年10月24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次会议审议通过，聘请孟辉先生担任本公司副总经理。

4、2014年11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四次会议审议通过，聘请何树方先生担任本公司副总经理。

5、2014年11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四次会议审议通过，聘请戴德舜先生担任本公司副总经理。

6、2015年1月17日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司职工代表大会民主选举，公司股东会审议通过，聘请俞涛先生担任本公司职工监事，高勇前先生因个人原因离职，不再担任本公司职工监事。

7、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，代为履行总经理职务的期限不超过90日。公司已按有关规定向中国证券监督管理委员会和上海监管局报告。

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称"本行"）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

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80,000元，目前事务所已提供审计服务是1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

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
齐鲁证券	2	–	–	–	–	–
民族证券	2	–	–	–	–	–
宏源证券	2	–	–	–	–	–
华泰证券	1	–	–	–	–	–
中信建投	1	–	–	–	–	–
国金证券	1	–	–	–	–	–
东兴证券	1	–	–	–	–	–
财通证券	1	–	–	–	–	–
兴业证券	2	–	–	–	–	–
中金公司	2	–	–	–	–	–
方正证券	1	–	–	–	–	–
东方证券	1	–	–	–	–	–

注：本基金本报告期内新增宏源证券2个交易单元；退租日信证券1个交易单元。

（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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	回购交易 成交金额	占当期回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
齐鲁证券	–	–	–	–	–	–
民族证券	–	–	–	–	–	–
宏源证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
东兴证券	–	–	–	–	–	–
财通证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
中金公司	2,203,650,390.82	100.00%	30,519,449,000.00	100.00%	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–

§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2014年12月31日，海富通管理的公募基金资产规模为287亿元人民币。

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2014年12月31日，海富通为80多家企业超过347亿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2014年12月31日，海富通旗下专户理财管理资产规模超过65亿元。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。

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2014年12月31日，投资咨询及海外业务规模超过220亿元人民币。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。

2012年3月，国内权威财经媒体《中国证券报》等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，《证券时报》授予 海富通精选混合基金"2011年中国基金业明星奖—五年持续回报平衡混合型明星基金" 荣誉。2013年4月，《上海证券报》授予海富通精选混合基金2012年 "金基金"奖——分红基金奖。

海富通同时还在不断践行其社会责任。公司自2008年启动"绿色与希望–橄榄枝公益环保计划"，针对汶川震区受灾学校、上海民工小学、安徽老区小学进行了物资捐赠，向内蒙古库伦旗捐建了环保公益林。几年来，海富通的公益行动进一步升级，持续为上海民工小学学生捐献生活物资，并向安徽农村小学捐献图书室。此外，海富通还积极推进投资者教育工作，推出了以"幸福投资"为主题和特色的投资者教育活动，向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

海富通基金管理有限公司
二〇一五年三月三十日