

# 海富通双利分级债券型证券投资基金

## 2015】第二季度报告

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:二〇一五年七月十八日

### 1 重要提示

基金管理人的名称及办公地址、基金名称、基金类型、基金运作方式、基金合同的当事人及其权利义务、基金的基本情况、基金主要财务指标、基金募集情况、基金合同摘要、基金合同全文、基金产品概況、基金投资组合报告、基金净值表现、基金收益分配政策、基金风险特征、基金销售机构等信息，详见本报告所载明的本基金招募说明书。

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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告附录财务数据未经审计。

### 2 基金产品概况

基金简称	海富通双利分级债券
基金主代码	519055
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年1月18日
申购赎回金额的限制	5,000.00元起购
投资目标	本基金追求基金份额长期稳定的增值，力求获得高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略分为两个部分：一是通过投资于货币市场工具、银行存款、短期融资券、国债、企业债、可转换债券、权证、股票等资产，实现资产的长期增值；二是通过投资于国债、企业债、可转换债券、权证、股票等资产，实现资产的长期增值。
业绩比较基准	中证国债指数
风险收益特征	本基金属于债券型基金，属于债券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益水平低于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
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
下属基金的基金简称	海富通双利分级债券A 海富通双利分级债券B
下属基金的交易代码	519055 519053
份额总额的基金的份额总额	23,861,470.21份
单位净值	27.9440,37.07份
下属两类基金的风险特征	双利A表现出现低风险，收益相对较高；双利B表现出现较高风险，收益相对较高的特征。

### 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,919,348.62
2.本期利润	2,222,082.14
3.期间平均基金份额利润	0.0269
4.期末基金份额净值	57,615,955.27
5.期末基金份额净值	1.112
(1)本期基金份额净值增长率不包括持有人认购或交易本基金的各项费用，计入费用后实际收益率要低于上述数字。 (2)本期已实现收益指基金利息收入、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。	

3.1 主要财务指标

姓名	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1 国债	2,998,178.40	5.20	
2 行业票据	-	-	
3 金融债券	-	-	
4 企业债券	48,555,169.20	84.27	
5 企业短期融资券	-	-	
6 中期票据	-	-	
7 可转债	-	-	
8 其他	-	-	
9 合计	51,553,347.60	89.48	

5.6 报告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

5.7 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

5.8 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权证投资明细

5.9 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股指期货投资明细

5.10 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国债期货投资明细

5.11 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资产支持证券投资基金组合

5.12 基金净值表现

5.13 其他指标

5.14 报告期内基金的利润分配情况

5.15 报告期内基金的分红情况

5.16 报告期内基金的收益分配情况

5.17 报告期内基金的费用概況

5.18 报告期内基金的交易费用

5.19 报告期内基金的申购、赎回费用

5.20 报告期内基金的定期定额投资费用

5.21 报告期内基金的转换费用

5.22 报告期内基金的其他费用

5.23 报告期内涉及退市基金的说明

5.24 报告期内涉及暂停上市基金的说明

5.25 报告期内涉及恢复上市基金的说明

5.26 报告期内涉及终止上市基金的说明

5.27 报告期内涉及未开放基金的说明

5.28 报告期内涉及暂停申购基金的说明

5.29 报告期内涉及暂停赎回基金的说明

5.30 报告期内涉及暂停转换基金的说明

5.31 报告期内涉及暂停定期定额投资计划的说明

5.32 报告期内涉及暂停申购、赎回、定期定额投资业务的说明

5.33 报告期内涉及暂停转换业务的说明

5.34 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.35 报告期内涉及暂停转换、定期定额转换业务的说明

5.36 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.37 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.38 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.39 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.40 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.41 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.42 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.43 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.44 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.45 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.46 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.47 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.48 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.49 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.50 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.51 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.52 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.53 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.54 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.55 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.56 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.57 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.58 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.59 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.60 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.61 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.62 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.63 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.64 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.65 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.66 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.67 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.68 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.69 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.70 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.71 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.72 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.73 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.74 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.75 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.76 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.77 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.78 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.79 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.80 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.81 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.82 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.83 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.84 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.85 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.86 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.87 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.88 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.89 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.90 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.91 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.92 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.93 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.94 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.95 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.96 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.97 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.98 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.99 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.10 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.11 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.12 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.13 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.14 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.15 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.16 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.17 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.18 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.19 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.20 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.21 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.22 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明

5.23 报告期内涉及暂停定期定额转换业务的说明