

海富通双利分级债券型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

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：二〇一五年十月二十七日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及高级管理人员不保证本基金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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2015年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核结果与本报告一致。

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。

基金管理的过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告告白中财务数据未经审计。

§ 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	610966
交易代码	610966
基金运作方式	契约型，本基金以“运作年滚筹”的方式运作，双A自成立以来全部归双A所有，双B在存续期内每年定期开放，每次开放期仅开放一个工作日，运作周期结束后，在满足基金合同约定的条件下，本基金将自动转换为“海富通双利债券型证券投资基金”。
基金合同生效日	2013年10月24日
报告期末基金份额总额	61,800,000.00份
投资目标	本基金通过追求基准收益率，力争在扣除一定的管理费用后，实现绝对收益。
投资策略	本基金在严格控制风险的前提下，通过资产配置策略、行业策略、可转换债券投资策略、新股申购策略、银行存款和货币市场基金等资产配置，力争在扣除一定的管理费用后，实现绝对收益。
业绩比较基准	中证企债指数
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
下属两级基金的基金简称	海富通双利分级债券A 海富通双利分级债券B
报告期末下属两级基金的份额总额	61,096,323.01份 61,096,323.01份
报告期末下属两级基金的风险等级	双A类风险评级为低风险，双B类风险评级为中风险。
报告期末下属两级基金的费率特	定的特征。
§ 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7月1日-2015年9月30日)	
1.本期已实现收益	1,033,976.02
2.本期利润	1,067,332.01
3.期初至报告期末的基金利润	0.02006
4.期末基金资产净值	56,683,798.10
5.期末基金份额净值	1.1133

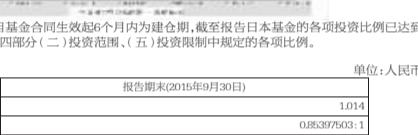
(注：1) 所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。
(2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 本期利润金额占净资产份额净值增长率为0.02%，与业绩比较基准收益率的比较

主要财务指标 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 净值收益率差(%) ①-③ ②-④

②-④

3.2.2 日基金合同生效以来基金累计净值增长率变化及其同行业业绩比较基准收益率变动的比较



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起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账金合同第十四部分（二）投资范围、（五）投资限制中规定的各项比例。

3.3 其他指标

单位：人民币元

报告期末(2015年9月30日)	
净利润	1014
利润+利息收入减去费用后的余额	0.08539703.1
利润+利息收入减去费用后的余额	1,000
利润+利息收入减去费用后的余额	1,234
利润+利息收入减去费用后的余额	1,302
利润+利息收入减去费用后的余额	4,30%

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期间		说明		
		任职日期	离任日期			
本基金的基金经理，海富通双利分级债券基金经理，海富通双利分级债券基金经理，海富通双利分级债券基金经理，海富通双利分级债券基金经理						
赵恒毅 2013-12-30 - 10年						

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期为基金合同生效日，离任日期为公司公告决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期为公司公告决定之日。
2、证券从业人员的统计标准：指基金从业经验满一年的人员。

2.4 报告期内本基金运作情况的说明

报告期内，本基金认真遵守《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公司公平交易的说明

4.3.1 平均交易量的执行情况

公司根据证监会2011年发布的《关于规范证券投资基金公平交易行为的指导意见》，制定了公平交易制度，明确了公平交易的原则、方法、操作流程和监督机制，以及相关的责任追究机制，确保在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面遵循公平原则，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 不同基金之间公平交易的专项说明

公司根据证监会2011年发布的《关于规范证券投资基金公平交易行为的指导意见》，制定了公平交易制度，明确了公平交易的原则、方法、操作流程和监督机制，以及相关的责任追究机制，确保在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面遵循公平原则，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3.3 相同基金之间公平交易的专项说明

公司根据证监会2011年发布的《关于规范证券投资基金公平交易行为的指导意见》，制定了公平交易制度，明确了公平交易的原则、方法、操作流程和监督机制，以及相关的责任追究机制，确保在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面遵循公平原则，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.4 报告期内本基金的公平交易情况

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情况。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场走势的简要展望

从经济基本面看，一方面经济运行平稳，但经济下行压力仍然存在，经济增速可能继续放缓，但幅度可能不及预期，政策面可能继续推出稳增长政策，同时随着供给侧结构性改革的深入，经济结构可能继续优化，但结构性矛盾可能依然存在，因此，预计未来经济可能继续保持平稳增长，但增速可能继续放缓。

4.6 管理人对本基金投资组合的展望

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.7 管理人对本基金投资策略的说明

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.8 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.9 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.10 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.11 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.12 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.13 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.14 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.15 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.16 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.17 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.18 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.19 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.20 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.21 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.22 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.23 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.24 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.25 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.26 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.27 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.28 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.29 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.30 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.31 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.32 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.33 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.34 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.35 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.36 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.37 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。

4.38 管理人对本基金投资组合的流动性管理

本基金将继续坚持“双利”策略，即在保持较低风险的前提下，力争获取较高的收益。