

海富通稳健添利债券型证券投资基金

【 2015 】 第 四 季 度 报 告

海富通稳进增利债券型证券投资基金（LOF）

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：二〇一六年一月二十一日

1 重要提示

基金管理人及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责任。

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1月21日复核了本报告中的财务指标、净值数据、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告日期2015年10月1日起至12月31日止。

2 基金产品概况

基金名称	海富通稳健添利债券
基金代码	510303
交易代码	510303
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2008年10月24日
报告期末基金份额总额	500,169,027.42份
投资目标	在确保本金安全的前提下，积极追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将以价值投资为原则，采用自上而下确定投资组合，采取久期策略、类属配置和债券选择策略等积极投资策略，发现、确认并充分利用市场失衡，实现组合增值。
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，属于中低风险品种，其预期收益和风险水平高于货币型基金，低于股票型基金和混合型基金。
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名称	海富通稳健添利债券A
下属两级基金的交易代码	510304
报告期末下属两级基金的份额总额	449,426,546.56份

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 2015年10月1日-2015年12月31日	海富通稳健添利债券C
1.本期已实现收益	12,303,363.02	1,772,346.09
2.本期利润	8,356,307.24	1,046,172.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.0167	0.0166
4.期末基金净值	562,197,913.07	62,389,673.69
1.期末基金份额净值	1.251	1.229

注：(1) 所谓基金份额净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际基金份额净值水平列于附注。

(2) 本期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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

(3) 海富通稳健添利债券型证券投资基金于2009年3月13日刊登公告，自2009年3月18日起增加一种收费模式：A类收费模式，该类收费模式申购费从赎回费中扣除，不收取申购费。

3.2 基金投资组合

3.2.1 报告期末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	净值增长率A	净值增长率基准	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	1.54%	0.06%	2.75%	0.07%	-1.21%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来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

海富通稳健添利债券型证券投资基金历史走势图

海富通稳健添利债券型证券投资基金历史走势图

3.1 主要财务指标

3.2 基金投资组合

3.2.1 报告期末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

3.2.2 自基金合同生效以来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

海富通稳健添利债券型证券投资基金历史走势图

海富通稳健添利债券型证券投资基金历史走势图

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：二〇一六年一月二十一日

1 重要提示

基金管理人及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责任。

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1月21日复核了本报告中的财务指标、净值数据、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告日期2015年10月1日起至12月31日止。

2 基金产品概况

基金名称	海富通新内需混合
基金代码	510310
交易代码	510310
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2014年11月27日
报告期末基金份额总额	1,031,369,662.09份
投资目标	本基金将以价值投资为原则，采用自上而下确定投资组合，采取久期策略、类属配置和债券选择策略等积极投资策略，发现、确认并充分利用市场失衡，实现组合增值。
投资策略	本基金将以价值投资为原则，采用自上而下确定投资组合，采取久期策略、类属配置和债券选择策略等积极投资策略，发现、确认并充分利用市场失衡，实现组合增值。
业绩比较基准	MSCI中国A股指数×60%+上证国债指数×40%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金和货币型基金，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
下属两级基金的基金名称	海富通新内需混合A
下属两级基金的交易代码	510313
报告期末下属两级基金的份额总额	1,031,369,662.09份

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 2015年10月1日-2015年12月31日	海富通新内需混合C
1.本期已实现收益	11,031,565.57	0.83
2.本期利润	13,830,851.31	1.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0118	0.0095
4.期末基金净值	1,432,472,873.40	1.290
1.期末基金份额净值	1.390	1.290

注：(1) 所谓基金份额净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际基金份额净值水平列于附注。

(2) 本期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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

(3) 海富通新内需混合型证券投资基金于2014年11月27日刊登公告，自2014年11月27日起增加一种收费模式：A类收费模式，该类收费模式申购费从赎回费中扣除，不收取申购费。

3.2 基金投资组合

3.2.1 报告期末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	净值增长率A	净值增长率基准	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	0.87%	0.09%	0.88%	0.07%	-0.81%	-0.78%

3.2.2 自基金合同生效以来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

海富通新内需混合型证券投资基金历史走势图

海富通新内需混合型证券投资基金历史走势图

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：二〇一六年一月二十一日

1 重要提示

基金管理人及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责任。

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1月21日复核了本报告中的财务指标、净值数据、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告日期2015年10月1日起至12月31日止。

2 基金产品概况

基金名称	海富通新内需混合
基金代码	510310
交易代码	510310
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2014年11月27日
报告期末基金份额总额	1,031,369,662.09份
投资目标	本基金将以价值投资为原则，采用自上而下确定投资组合，采取久期策略、类属配置和债券选择策略等积极投资策略，发现、确认并充分利用市场失衡，实现组合增值。
投资策略	本基金将以价值投资为原则，采用自上而下确定投资组合，采取久期策略、类属配置和债券选择策略等积极投资策略，发现、确认并充分利用市场失衡，实现组合增值。
业绩比较基准	MSCI中国A股指数×60%+上证国债指数×40%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金和货币型基金，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
下属两级基金的基金名称	海富通新内需混合A
下属两级基金的交易代码	510313
报告期末下属两级基金的份额总额	1,031,369,662.09份

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 2015年10月1日-2015年12月31日	海富通新内需混合C
1.本期已实现收益	11,031,565.57	0.83
2.本期利润	13,830,851.31	1.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0118	0.0095
4.期末基金净值	1,432,472,873.40	1.290
1.期末基金份额净值	1.390	1.290

注：(1) 所谓基金份额净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际基金份额净值水平列于附注。

(2) 本期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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

(3) 海富通新内需混合型证券投资基金于2014年11月27日刊登公告，自2014年11月27日起增加一种收费模式：A类收费模式，该类收费模式申购费从赎回费中扣除，不收取申购费。

3.2 基金投资组合

3.2.1 报告期末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	净值增长率A	净值增长率基准	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	0.87%	0.09%	0.88%	0.07%	-0.81%	-0.78%

3.2.2 自基金合同生效以来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

海富通新内需混合型证券投资基金历史走势图

海富通新内需混合型证券投资基金历史走势图

注：按基金合同约定，本基金基金合同生效30个工作日内为建仓期，截至建仓期末本基金的各项投资比例均符合基金合同“第二部分（二）投资组合范围、比例限制”的规定。

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：二〇一六年一月二十一日

1 重要提示

基金管理人及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责任。

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1月21日复核了本报告中的财务指标、净值数据、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告日期2015年10月1日起至12月31日止。

2 基金产品概况

基金名称	海富通稳进增利债券（LOF）
基金代码	510309
交易代码	510309
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2011年9月1日
报告期末基金份额总额	56,779,221.36份
投资目标	本基金在控制风险和保持资产流动性合理的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为债券型基金，其预期收益和风险水平高于货币型基金，低于股票型基金和混合型基金。
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，属于中低风险品种，其预期收益和风险水平高于货币型基金，低于股票型基金和混合型基金。
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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 2015年10月1日-2015年12月31日	海富通稳进增利债券C
1.本期已实现收益	3,399,113.63	3,880,866.64
2.本期利润	3,399,113.63	3,880,866.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0601	0.0601
4.期末基金净值	94,961,248.29	1.072
1.期末基金份额净值	1.672	1.072

注：(1) 所谓基金份额净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际基金份额净值水平列于附注。

(2) 本期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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

(3) 海富通稳进增利债券型证券投资基金于2011年9月1日刊登公告，自2011年9月1日起增加一种收费模式：A类收费模式，该类收费模式申购费从赎回费中扣除，不收取申购费。

3.2 基金投资组合

3.2.1 报告期末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	净值增长率A	净值增长率基准	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	4.17%	0.67%	4.09%	0.18%	0.08%	0.39%

3.2.2 自基金合同生效以来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

海富通稳进增利债券型证券投资基金历史走势图

海富通稳进增利债券型证券投资基金历史走势图

3.1 主要财务指标

3.2 基金投资组合

3.2.1 报告期末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

3.2.2 自基金合同生效以来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

海富通稳进增利债券型证券投资基金历史走势图

海富通稳进增利债券型证券投资基金历史走势图

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：二〇一六年一月二十一日

1 重要提示

基金管理人及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责任。

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1月21日复核了本报告中的财务指标、净值数据、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告日期2015年10月1日起至12月31日止。

2 基金产品概况

基金名称	海富通新内需混合
基金代码	510310
交易代码	510310
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2014年11月27日
报告期末基金份额总额	1,031,369,662.09份
投资目标	本基金将以价值投资为原则，采用自上而下确定投资组合，采取久期策略、类属配置和债券选择策略等积极投资策略，发现、确认并充分利用市场失衡，实现组合增值。
投资策略	本基金将以价值投资为原则，采用自上而下确定投资组合，采取久期策略、类属配置和债券选择策略等积极投资策略，发现、确认并充分利用市场失衡，实现组合增值。
业绩比较基准	MSCI中国A股指数×60%+上证国债指数×40%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金和货币型基金，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
下属两级基金的基金名称	海富通新内需混合A
下属两级基金的交易代码	510313
报告期末下属两级基金的份额总额	1,031,369,662.09份

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 2015年10月1日-2015年12月31日	海富通新内需混合C
1.本期已实现收益	11,031,565.57	0.83
2.本期利润	13,830,851.31	1.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0118	0.0095
4.期末基金净值	1,432,472,873.40	1.290
1.期末基金份额净值	1.390	1.290

注：(1) 所谓基金份额净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际基金份额净值水平列于附注。

(2) 本期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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

(3) 海富通新内需混合型证券投资基金于2014年11月27日刊登公告，自2014年11月27日起增加一种收费模式：A类收费模式，该类收费模式申购费从赎回费中扣除，不收取申购费。

3.2 基金投资组合

3.2.1 报告期末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	净值增长率A	净值增长率基准	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	0.87%	0.09%	0.88%	0.07%	-0.81%	-0.78%

3.2.2 自基金合同生效以来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

海富通新内需混合型证券投资基金历史走势图

海富通新内需混合型证券投资基金历史走势图

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：二〇一六年一月二十一日

1 重要提示

基金管理人及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责任。

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1月21日复核了本报告中的财务指标、净值数据、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告日期2015年10月1日起至12月31日止。

2 基金产品概况

基金名称	海富通新内需混合
基金代码	510310
交易代码	510310
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2014年11月27日
报告期末基金份额总额	1,031,369,662.09份
投资目标	本基金将以价值投资为原则，采用自上而下确定投资组合，采取久期策略、类属配置和债券选择策略等积极投资策略，发现、确认并充分利用市场失衡，实现组合增值。
投资策略	本基金将以价值投资为原则，采用自上而下确定投资组合，采取久期策略、类属配置和债券选择策略等积极投资策略，发现、确认并充分利用市场失衡，实现组合增值。
业绩比较基准	MSCI中国A股指数×60%+上证国债指数×40%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金和货币型基金，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
下属两级基金的基金名称	海富通新内需混合A
下属两级基金的交易代码	510313
报告期末下属两级基金的份额总额	1,031,369,662.09份

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 2015年10月1日-2015年12月31日	海富通新内需混合C
1.本期已实现收益	11,031,565.57	0.83
2.本期利润	13,830,851.31	1.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0118	0.0095
4.期末基金净值	1,432,472,873.40	1.290
1.期末基金份额净值	1.390	1.290

注：(1) 所谓基金份额净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际基金份额净值水平列于附注。

(2) 本期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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

(3) 海富通新内需混合型证券投资基金于2014年11月27日刊登公告，自2014年11月27日起增加一种收费模式：A类收费模式，该类收费模式申购费从赎回费中扣除，不收取申购费。

3.2 基金投资组合

3.2.1 报告期末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	净值增长率A	净值增长率基准	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	0.87%	0.09%	0.88%	0.07%	-0.81%	-0.78%

3.2.2 自基金合同生效以来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

海富通新内需混合型证券投资基金历史走势图

海富通新内需混合型证券投资基金历史走势图

注：按基金合同约定，本基金基金合同生效30个工作日内为建仓期，截至建仓期末本基金的各项投资比例均符合基金合同“第二部分（二）投资组合范围、比例限制”的规定。