海富通稳进增利债券型证券投资基金（LOF）

2015 年度报告摘要

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金管理人:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	海富通稳进增利债券（LOF）
场内简称	海富增利
基金主代码	162308
交易代码	162308
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2011年8月1日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	56,779,221.35份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014年9月16日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险和保持资产适当流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金为债券型基金，对债券类资产的投资比例不低于基金资产的80%。在宏观层面上，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断，对固定收益类资产、权益类资产和货币资产等的投资比例进行动态调整，从而决定其配置比例。固定收益类资产中，本基金将采取久期管理、收益率曲线策略、类属配置等多种投资策略，在不同券种之间进行配置。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=中证全债指数×90%＋沪深300指数×10%
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，低于股票型基金和股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	莫万荣	田青
	联系电话	021-38926891	010-67595096
	电子邮箱	wxx@hftfund.com	tianqing.1.zh@ccb.com
客户服务电话		40088-40099	010-67595096
传真		021-33830166	010-66275853

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9月2日（转型后起始日）至2014年12月31日
本期已实现收益	16,522,333.10	12,269,791.70
本期利润	10,152,832.56	11,831,806.59
加权平均基金份额本期利润	0.2823	0.1331
本期基金份额净值增长率	14.84%	16.74%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.6723	0.4109
期末基金资产净值	94,951,248.39	52,976,702.95
期末基金份额净值	1.672	1.466

注:1.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。

2.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。

3.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。

4.本基金转型日为 2014 年9月1日。上年度数据为转型后数据。

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

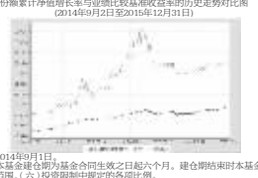
3.1.1 期间数据和指标	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.17%	0.57%	4.09%	0.18%	0.08%	0.39%
过去六个月	-2.46%	0.65%	3.22%	0.26%	-5.67%	0.39%
过去一年	14.84%	1.38%	8.94%	0.26%	5.90%	1.13%
自基金转型起至今	32.91%	1.26%	18.07%	0.24%	14.84%	1.02%

3.2.2 自基金转型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

海富通稳进增利债券型证券投资基金（LOF）

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

（2014年9月2日至2015年12月31日）



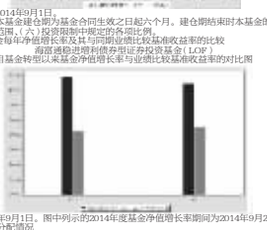
注:1.本基金转型日期为2014年9月1日。

2.按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期结束时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（六）投资限制中规定的各项比例。

3.2.3 自基金转型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（LOF）

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金转型日为2014年9月1日。图中列示的2014年度基金净值增长率期间为2014年9月2日至2014年12月31日。

3.3 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
2015年	-	-	-	-	-
2014年	-	-	-	-	-
2013年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注:本基金过去三年未发生利润分配的情况。

§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[2001]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BNP Paribas Investment Partners BE Holding")于2002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、海富通股票型证券投资基金、海富通保证证券投资基金、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、海富通精选成长混合型证券投资基金、海富通中证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、海富通稳健添益债券型证券投资基金、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、海富通稳健添益债券型证券投资基金、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、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、海富通收益增长证券投资基金、海富通国际市场证券投资基金、海富通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、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通稳健添益债券型证券投资基金、海富通季季稳利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、海富通国际市场证券投资基金、海富通沪深300指数证券投资基金、海富通中高端人民币债券投资基金、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。

4.1.2 基金经理（或基金委员会成员）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		
邵佳民	本基金的基金经理,海富通稳健添利债券基金经理,海富通稳健添益债券基金经理,海富通季季稳利债券基金经理,海富通纯债债券基金经理,海富通稳健添益纯债债券基金经理,总经理助理	2013-01-06	2015-01-23	18年	硕士,经济师。2000年1月至2006年2月在海通证券公司固定收益部从事债券投资业务工作。2006年2月至2008年1月在海通证券资产管理(香港)有限公司从事债券投资业务工作。2008年1月至2009年2月在海通证券股份有限公司固定收益部从事债券投资业务工作。2009年2月至2010年1月在海通证券资产管理(香港)有限公司从事债券投资业务工作。2010年1月至2011年1月在海通证券股份有限公司固定收益部从事债券投资业务工作。2011年1月至2012年1月在海通证券资产管理(香港)有限公司从事债券投资业务工作。2012年1月至2013年1月在海通证券股份有限公司固定收益部从事债券投资业务工作。2013年1月至2015年1月在海富通基金管理有限公司固定收益部担任债券投资基金经理。2015年1月至今在海富通基金管理有限公司固定收益部担任债券投资基金经理,总经理助理。
张晓平	本基金的基金经理,海富通货币基金经理,海富通季季稳利债券基金经理,海富通上证可质押城投债ETF基金经理,海富通稳健添益债券基金经理	2015-12-18	-	6年	博士,特许金融分析师（CFA）,持有基金从业人员资格证书。2006年1月至2008年6月在Marsico Investment Group LLC分析师。2008年10月至2011年6月在瑞银证券管理（上海）有限公司新董事。2011年10月加入海富通基金管理有限公司,任债券投资经理。2013年3月起任海富通货币基金经理。2014年6月起兼任海富通季季稳利债券基金经理。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月兼任海富通稳健添益纯债债券基金经理。2015年12月兼任海富通稳健添益债券基金经理。2015年12月兼任海富通稳健添益债券基金经理。2015年12月兼任海富通稳健添益纯债债券基金经理。

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为: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 管理人对投资管理的内部控制

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、勤勉尽责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管理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,涵盖了投权、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,公司投资交易业务相关制度和流程保证了各投资组合在投资决策和执行层面,能够其在获得投资信息、投资建议和投资机会上享有公平的机会。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系由交易、投资组、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。

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投权、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做到公平对待。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96%置信区间,检验组合间是为的可能性检验,结合趋势图、离群度、交易方向比例等指标,综合相之间的横向比较分析,并形成了公司内部控制和风险管理的报告。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,在二季度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显露创下近年来的新低。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一个较低的水平。在这种情况下政府一方面保持货币政策的稳健性,提出了供给侧改革的思路,加快经济结构调整,另一方面则加大财政政策的力度,推出一系列的稳增长措施,在全年实行并实施了五次降准和五次降息,并持续通过SLF、MLF等定向释放市场资金流动性。具体来看2015年存款准备金率共下调了300BP,一年期贷款利率从年初的6%下调至目前的4.75%,一年期存款利率从2.75%下调至目前的2.5%,同时打开了存款区间,形成了利率市场化。其次,财政政策也积极发力,2015年赤字率目标由14年的2.1%提升至2.3%,并推出了化地方债置换以及千亿专项金融债,希望拉动投资回升。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,经济全额约束问题。

在此背景下,15年债券市场经历了牛市行情,一方面资金利率导致于货币宽松总体保持低位平稳,下半年7天回购利率始终平稳维持25%左右水平,另一方面6月份以后股市断崖式回落,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。经体看全年,国内经济数据一直处于下行趋势,一方面宏观经济数据GDP、CPI、PPI等数据一直处于下行趋势,而市场利率水平在经历了年初的上行后,一直处于下行趋势,期限利差及信用利差均迅速收窄。在这种背景下,债券市场一直处于牛市行情,收益率曲线一直处于下行趋势,期限利差及信用利差均迅速收窄。

在此背景下,本基金采取久期管理、收益率曲线策略、类属配置等多种投资策略,在不同券种之间进行配置。本基金将采取久期管理、收益率曲线策略、类属配置等多种投资策略,在不同券种之间进行配置。

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14.84%,同期业绩比较基准收益率为8.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

经济基本面看,当前经济仍未出现明显的见底信号,总需求不振,而供给端改革的作用短期难以体现,明年上半年可能出现工业增长、工业产能以及固定资产投资的进一步下行。但是,明年传统的稳增长政策尤其是积极财政政策可能会有所加大,下半年经济或存在逐步企稳、回升的趋势。

货币政策方面,目前利率市场化已近收官,随总政策边际效应减减,央行开始逐步从单一通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实现经济政策的多元化。

在这种环境下,我们对明年债市保持谨慎乐观,基本面和资金面因素对债市的相对有利,期限收益率出现大幅上行的可能,但明年财政发力带来的跌出效应,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,因此明年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,需者密切关注国内外的资金的流向和流向,对债市形成新的扰动,尤其是目前歇值压力加大,需要保持密切关注。

2016年,本基金会保持谨慎乐观,债券方面以高评级为主。股票方面耐心等待市场机会,择机参与反弹,争取为持有人带来好的投资回报。

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做出独立判断。估值委员会负责制定、更新本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投资管理人的意见,并根据相关投资管理人充分协商后,向估值委员会提交估值建议以及估值政策和程序评估报告,以便估值委员会决策。估值政策估值委员会审阅同意,并经本公司总裁办公室批准。

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委员会提供估值建议。

上述参与估值决策的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。对于国定收益品种,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数据来估值。

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,每次分配比例不得低于可供分配收益的90%。

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

本报告期内,本基金自2015年7月2日至2015年9月24日,连续43个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全履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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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:海富通稳进增利债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

姓名	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	2,216,997.66	1,908,267.27
结算备付金	3,007,593.43	370,306.44
存出保证金	140,715.83	31,585.75
交易性金融资产	96,123,125.01	79,862,390.78
其中:股票投资	18,065,052.25	10,277,127.48
基金投资	-	-
债券投资	77,058,072.76	69,585,263.30
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	647,989.15	488,275.02
应收利息	2,928,866.46	1,281,333.27
应收股利	-	-
应收申购款	17,741.95	6,051.78
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	104,083,366.49	83,948,200.41

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	6,000,000.00	30,000,000.00
应付证券清算款	2,001,555.88	-
应付赎回款	70,702.95	441,882.50
应付管理人报酬	57,110.48	31,512.62
应付托管费	16,317.29	9,003.60
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	568,351.71	80,873.04
应交税费	78,000.00	78,000.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	340,041.79	330,234.70
负债合计	9,132,118.10	30,971,506.46
所有者权益:		
实收基金	56,779,221.35	36,394,844.69
未分配利润	38,172,027.04	16,581,849.26
所有者权益合计	94,951,248.39	52,976,702.95
负债和所有者权益总计	104,083,366.49	83,948,200.41

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.672元,基金份额总额56,779,221.35份。比较财务报表的实际编制期间为2014年9月2日（转型后起始日）至2014年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:海富通稳进增利债券型证券投资基金（LOF）

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

姓名	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月2日（转型后起始日）至2014年12月31日
一、收入	13,965,344.91	12,636,167.45
1.利息收入	2,611,300.51	1,873,612.70
其中:存款利息收入	79,724.22	16,133.56
债券利息收入	2,530,572.18	1,846,778.19
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,004.11	10,700.96
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	17,706,478.60	11,150,741.29
其中:股票投资收益	7,036,793.70	919,014.30
基金投资收益	-	-
债券投资收益	10,608,533.13	10,231,726.99
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利红利	61,176.77	-
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-6,369,560.54	-433,985.11
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	17,006.34	45,798.57
减:二、费用	3,812,512.35	804,360.86
1. 管理人报酬	467,144.97	270,618.44
2. 托管费	133,469.99	77,319.49
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,319,831.72	135,980.62
5. 利息支出	451,401.91	169,042.11
其中:卖出回购金融资产支出	451,401.91	169,042.11
6. 其他费用	440,663.76	151,400.20
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	10,152,832.56	11,831,806.59
减:所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	10,152,832.56	11,831,806.59

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体:海富通稳进增利债券型证券投资基金（LOF）

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）	36,394,844.69	16,591,858.26	52,986,702.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,152,832.56	10,152,832.56
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）	20,384,376.66	11,427,336.22	31,821,712.88
其中:1.基金申购款	65,709,695.76	45,114,606.16	110,824,301.92
2.基金赎回款	-45,315,319.10	-33,687,269.94	-79,002,589.04
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）	56,779,221.35	38,172,027.04	94,951,248.39

项目	上年度可比期间 2014年9月2日（转型后起始日）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）	220,512,564.26	56,911,789.47	277,424,353.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,831,806.59	11,831,806.59
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）	-184,127,719.57	-52,151,737.80	-236,279,457.37
其中:1.基金申购款	827,506.35	276,781.99	1,104,287.34
2.基金赎回款	-184,955,224.92	-52,428,519.79	-237,383,744.71
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）	36,384,844.69	16,591,858.26	52,976,702.95

注:海富通稳进增利债券型证券投资基金(LOF)基金转换日原海富通稳进增利分级债券型证券投资基金A类份额和B类份额转换而来。转换前,原海富通稳进增利分级债券型证券投资基金A类份额数为176,410,051.34份,原海富通稳进增利分级债券型证券投资基金B类份额数为44,102,514.11份;转换后,海富通稳进增利债券型证券投资基金(LOF)基金份额数为220,512,564.26份。转换前后的1.10份基金份额数差异在上年度可比期间报告期初计入未分配利润科目。

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:刘颖,主管会计工作负责人:陶网施,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

海富通稳进增利债券型证券投资基金(LOF)（以下简称"本基金"）是由原海富通稳进增利分级债券型证券投资基金转型而来。根据《海富通稳进增利分级债券型证券投资基金基金合同》,原海富通稳进增利分级债券型证券投资基金为契约型基金,封闭期为一年,封闭期届满后转为上市开放式基金(LOF)。根据深圳证券交易所深证上[2014]302号《终止上市同意书》,原海富通稳进增利分级债券型证券投资基金于2014年8月20日进行基金份额权益登记,于2014年9月11日终止上市。自2014年9月2日转型后首日起,海富通稳进增利分级债券型证券投资基金基金更名为海富通稳进增利债券型证券投资基金(LOF),并更名为海富通稳进增利债券型证券投资基金(LOF)。本基金为契约型开放式,存续期间不定,本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《海富通稳进增利债券型证券投资基金基金合同》和《海富通稳进增利分级债券型证券投资基金招募说明书》,海富通稳进增利分级债券型证券投资基金在封闭期届满前,按照基金合同在封闭期内的资产及收益的分配约定分别对增利A份额和增利B份额计算封闭期末基金份额净值,并以净值份额净值为基础,按照每百份基金份额持有人分配债券证券投资基金的基金份额净值转换为海富通稳进增利债券型证券投资基金(LOF)的份额。于2014年9月11日基金份额转换日日转,增利A份额转换出份额数为176,410,051.34份,转换比例为0.913983526,转换后对应本基金份额数为161,235,833.59份;增利B份额转换出份额数为44,102,514.11份,转换比例为1.134406865,转换后对应本基金份额数为50,276,730.67份。本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司根据基金合同约定,对增利A、增利B的份额持有人的基金份额进行了计算,并向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。

经深圳证券交易所深证上[2014]330号审核同意,本基金132,635,001.00份基金份额(截至2014年9月9日止)于2014年9月16日在深圳证券交易所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通稳进增利债券型证券投资基金(LOF)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金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%。投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的20%,权证投资不超过基金资产净值的3%,且现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为中证全债指数×90%＋沪深300指数×10%。

本财务报表由本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 会计报表所遵循的基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日发以前颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《海富通稳进增利债券型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注7.4.8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,本基金本报告期内为采用中证指数有限公司提供《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》所独立提供的估值数据来估值。

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[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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,暂减按25%计入应纳税所得额,目前暂减按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。

(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

项目	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
中国建设银行股份有限公司（"中国建设银行"）	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:1.还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

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年9月2日（转型后起始日）至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	677,299,212.57	43.28%	5,938,310.77	6.52%

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

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年9月2日（转型后起始日）至2014年12月31日	
	当期佣金	占当期佣金总额的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	604,158.46	44.00%	81,598.51	14.36%

关联方名称	上年度可比期间 2014年9月2日（转型后起始日）至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总额的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	5,284.82	0.42%	3,793.57	4.61%

注:上述佣金参考市场行情经本基金的基金管理人与对方协商确定,以不低于中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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9月2日（转型后起始日）至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	467,144.97	270,618.44
其中:支付销售机构的客户维护费	98,577.29	36,778.34

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0.7%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 0.7% / 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9月2日（转型后起始日）至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	133,469.99	77,319.49

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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 0.2% / 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与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认申用债券型证券投资基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未认申用债券型证券投资基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方