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:二〇一六年三月二十八日

海富通一年定期开放债券型证券投资基金

2015 年度报告摘要

§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	海富通一年定开债券	
基金主代码	519061	
交易代码	519061	
基金运作方式	契约型开放式,本基金以定期开放方式运作。	
基金合同生效日	2013年10月24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	1,314,210,942.66份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通一年定A	海富通一年定C
下属分级基金的交易代码	519061	001976
报告期末下属分级基金的份额总额	1,260,250,207.33份	53,960,735.33份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上,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债券投资组合策略、信用类债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、杠杆策略、可转换债券投资策略及新股申购策略。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于较低风险水平的投资品种。

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	莫万荣	洪渊
	联系电话	021-33950891	010-66106799
	电子邮箱	wrx@hfuntd.com	cuistody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-33830166	010-66106798

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.hfuntd.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		2013年10月24日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	海富通一年定A	海富通一年定C	海富通一年定A	海富通一年定C	海富通一年定A	海富通一年定C
本期已实现收益	35,034,123.10	46,489.96	48,049,860.68	-	4,685,243.97	-
本期利润	30,025,566.74	540,477.15	63,868,839.94	-	4,685,516.93	-
加权平均基金份额本期利润	0.0160	0.1879	0.1566	-	0.0096	-
本期基金份额净值增长率	20.82%	0.62%	46.44%	-	1.00%	-
3.1.2期末数据和指标	2015年末		2014年末		2013年末	
	海富通一年定A	海富通一年定C	海富通一年定A	海富通一年定C	海富通一年定A	海富通一年定C
期末可供分配基金份额利润	0.7872	0.7970	0.2429	-	0.0096	-
期末基金资产净值	2,252,276,565.73	96,428,477.15	83,166,227.38	-	493,680,275.88	-
期末基金份额净值	1.787	1.787	1.479	-	1.050	-

注:1、本基金合同生效日为2013年10月24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)。

5、本基金自2015年11月23日起,根据收费模式的不同,将基金份额分为A类和C类。

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

1. 海富通一年定A:

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	1.42%	0.12%	1.00%	0.01%	0.42%	0.11%
过去六个月	0.22%	0.18%	1.90%	0.01%	-1.68%	0.17%
过去一年	20.82%	1.17%	3.75%	0.01%	17.07%	1.16%
自基金合同生效起至今	78.70%	1.02%	8.93%	0.01%	69.77%	1.01%

2. 海富通一年定C:

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
自基金合同生效起至今	0.62%	0.05%	0.41%	0.01%	0.21%	0.04%

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

海富通一年定期开放债券型证券投资基金

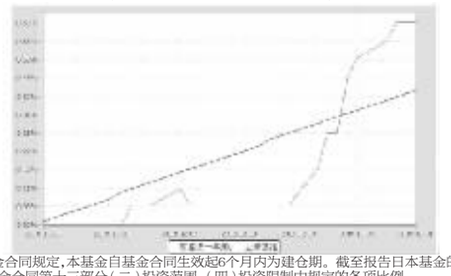
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1. 海富通一年定A

(2013年10月24日至2015年12月31日)

2. 海富通一年定C

(2015年11月23日至2015年12月31日)



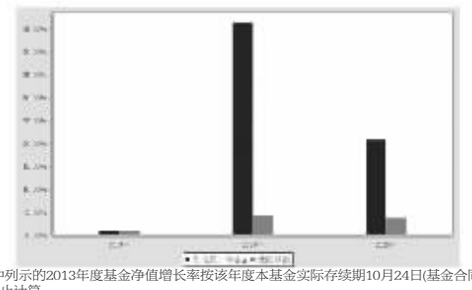
注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三部分(二)投资范围、(四)投资限制中规定的各项比例。

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

海富通一年定期开放债券型证券投资基金

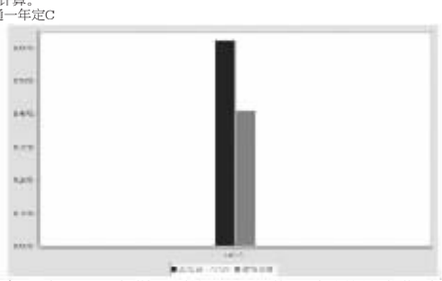
自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1. 海富通一年定A



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10月24日(基金合同生效日)起至12月31日止计算。

2. 海富通一年定C



注:本基金自2015年11月23日起增加C类份额,图中列示的2015年度基金净值增长率自11月23日起至12月31日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通一年定A:

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	-	-	-	-	-

2、海富通一年定C:

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	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注:1、本基金合同于2013年10月24日生效,未实施利润分配。

2、本基金自2015年11月23日起,根据收费模式的不同,将基金份额分为A类和C类。

§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、海富通股票混合型证券投资基金、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、海富通精选或号混合型证券投资基金、海富通中国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、海富通领先成长混合型证券投资基金、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、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、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)、海富通国策导向混合型证券投资基金、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、海富通内需热点混合型证券投资基金、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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
凌超	本基金的基金经理;海富通纯债债券基金经理;海富通稳健添利债券基金经理;海富通稳进增利债券(LOF)基金经理;海富通现金管理货币基金经理	2013-12-19	-	9年	硕士,持有基金从业人员资格证书。先后任职于长江证券股份有限公司、光大保德信基金管理有限公司。曾任光大保德信货币基金经理。2006年7月至2009年6月在长江证券股份有限公司先后担任债券高级研究员、投资经理;2009年7月至2010年2月在光大保德信基金管理有限公司担任债券研究员,2010年2月至2010年8月担任光大保德信债券投资基金经理助理,2010年9月至2012年2月担任光大保德信货币基金经理;2012年3月加入海富通基金管理有限公司,2013年3月至2015年10月任海富通现金管理货币基金经理。2013年12月至2016年1月兼任海富通一年定开债券基金经理。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月兼任海富通稳固收益债券和海富通稳进增利债券(LOF)基金经理。
赵恒毅	本基金的基金经理;海富通养老收益混合型基金经理;海富通双福分级债券基金经理;海富通双利债券基金经理;海富通纯债债券基金经理	2015-12-18	-	10年	金融学硕士,持有基金从业人员资格证书。2006年7月至2008年3月任德邦证券股份有限公司研究员,2008年4月至2011年8月任富国基金管理有限公司研究员,2011年8月至2013年7月任银河天惠沙纸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月任富国新天锋定期开放债券型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。2015年12月起兼任海富通一年定开债券基金经理和海富通纯债债券基金经理。

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: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4日发布公告,自2016年1月4日起,聘任夏妍妍女士担任本基金基金经理助理。

4、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模拟输送金额、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

2015年经济基本面总体疲弱,在三期叠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屡屡创下近年来的新低。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较低的水平。在这种情况下,政府一方面促转型调结构,提出了供给侧改革的思路;另一方面也依旧显现出较强的稳增长意愿。首先,货币政策持续宽松,全年央行共实施了五次降准和五次降息,并持续通过SLF、MLF等定向手段向市场注入流动性。其次,财政政策也积极发力,并推出万亿地方债置换以及千亿专项金融债。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。

在此背景下,债券市场延续了牛市行情,一方面资金利率总体保持低位平稳,另一方面6月份以后股市断崖式下跌,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。信用债在钱多缺资产的格局下表现更为出色,尤其是在经济下行信用风险加大的情况下中短久期、中高评级信用债成为市场追捧对象,信用利差被压缩至历史低位,城投债也因为地方债置换安全度提高而投资情绪回暖。转债方面,1至5月转债受股市推动大幅上涨,众多个券纷纷触发赎回退市,转债稀缺性进一步推升估值。然而六月股市剧烈震荡,转债在正股和估值双重压力下急剧下跌,归还了年初以来累积的回报。虽然四季度股市有所反弹,但转债受制于高估值弹性严重不足。

本基金在2015年总体维持中短久期。一季度,考虑政策托底力度逐步增大,股票二级市场表现相对积极,主要侧重转债品种;二季度,考虑权益市场上行趋势较强但波动加剧,对权益仓位进行适度减持,组合结构趋于平衡;三季度,基金仓位保持稳定,操作上保持低杠杆短久期;四季度开放期后,基金规模显著增长,随后开始建仓操作,以高等级短融、公司债和利率债为主要标的。转债方面一直保持较低仓位,参与力度较小。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通一年定期开放债券A基金净值增长率为20.82%,同期业绩比较基准收益率为3.75%。海富通一年定期开放债券C基金净值增长率为0.62%,同期业绩比较基准收益率为0.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济基本面看,当前经济仍未出现明显的见底信号。2016年上半年可能出现工业增长和固定资产投资的进一步下行。但是,2016年传统的稳增长政策尤其是积极财政政策可能会加码,下半年经济或许能逐步企稳,尚待观察。货币政策方面,目前利率市场化几近收官,降息政策边际效应递减,央行开始逐步构建一个适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明年货币政策难以出现大幅放水但也难以转向,总体仍会维持平稳和适度宽松,降准的空间会大于降息。

在这种环境下,我们对2016年债市保持谨慎乐观,基本面和资金面因素对债市仍相对有利,限制收益率出现大幅上行的可能,但财政发力带来的挤出效应、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,两者影响了国内和国际的资金流向,对债市形成阶段性扰动。

展望2016年,本基金对债市谨慎乐观,主要配置高评级中等久期信用债,辅以适量配置高性价比信用个券,择机通过长久期利率债波段操作增厚收益。转债方面耐心等待市场调整后的机会,适量参与。建仓期之后拟采用一定杠杆,争取为持有人实现较高的稳定回报。

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

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,每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的20%。

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一年定期开放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,海富通一年定期开放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一年定期开放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,海富通一年定期开放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一年定期开放债券型证券投资基金2015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:海富通一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	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	5,550,247.39	1,378,969.62
结算备付金	3,276,456.44	3,854,461.03
存出保证金	41,556.13	153,527.84
交易性金融资产	2,331,432,523.13	134,824,930.95
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,331,432,523.13	134,824,930.95
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	-	11,833,246.51
应收利息	21,224,492.57	577,906.84
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,361,525,275.66	152,623,041.79
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	11,000,000.00	69,000,000.00
应付证券清算款	2,140.36	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,044,103.72	44,052.37
应付托管费	298,315.37	12,586.54
应付销售服务费	17,919.06	-
应付交易费用	17,564.27	175.00
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	440,000.00	400,000.00
负债合计	12,820,042.78	69,456,814.41
所有者权益:		
实收基金	1,314,210,942.66	56,238,597.68
未分配利润	1,034,494,300.22	26,927,629.70
所有者权益合计	2,348,705,242.88	83,166,227.38
负债和所有者权益总计	2,361,525,275.66	152,623,041.79

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.787元,基金份额总额1,314,210,942.66份。其中A类基金份额总额1,260,250,207.33份,基金份额净值1.787元;C类基金份额总额53,960,735.33份,基金份额净值1.787元。

7.2 利润表

会计主体:海富通一年定期开放债券型证券投资基金

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	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	34,283,893.12	78,964,483.86
1.利息收入	6,612,603.82	32,926,037.26
其中:存款利息收入	402,332.25	9,669,868.52
债券利息收入	6,000,031.33	23,044,007.07
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	120,240.24	212,171.67
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	32,184,256.78	30,218,476.16
其中:股票投资收益	2,457,590.96	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	29,726,665.82	30,218,476.16
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)	-4,514,580.16	15,818,979.26
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,612.68	991.18
减:二、费用	3,717,860.23	15,095,643.92
1. 管理人报酬	1,734,023.77	3,019,523.86
2. 托管费	496,435.38	862,720.51
3. 销售服务费	17,922.36	-
4. 交易费用	163,072.90	12,107.72
5. 利息支出	823,094.71	10,747,599.72
其中:卖出回购金融资产支出	823,094.71	10,747,599.72
6. 其他费用	484,311.11	453,694.11
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	30,566,032.89	63,868,839.94
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	30,566,032.89	63,868,839.94

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通一年定期开放债券型证券投资基金

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)	56,238,597.68	26,927,629.70	83,166,227.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,566,032.89	30,566,032.89
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)	1,257,972,344.98	977,000,637.63	2,234,972,982.61
其中:1.基金申购款	1,294,674,659.26	1,005,500,204.97	2,300,174,864.23
2.基金赎回款	-36,702,314.28	-28,499,567.34	-65,201,881.62
四、本期内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)	1,314,210,942.66	1,034,494,300.22	2,348,705,242.88

项目	上年度可比期间 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)	488,994,758.95	4,685,516.93	493,680,275.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	63,868,839.94	63,868,839.94
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)	-432,756,161.27	-41,626,727.17	-474,382,888.44
其中:1.基金申购款	23,140,069.75	2,971,660.27	26,111,730.02
2.基金赎回款	-455,896,231.02	-44,598,387.44	-500,494,618.46
四、本期内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)	56,238,597.68	26,927,629.70	83,166,227.38

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:陶网雄,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

海富通一年定期开放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1062号《关于核准海富通一年定期开放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《海富通一年定期开放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,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集488,739,053.00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637号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2013年10月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为488,994,758.95份,其中认购资金利息折合255,705.95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《关于海富通一年定期开放债券型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同的公告》,自2015年11月23日起,本基金根据赎回费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额的称为A类基金份额;从本类基金资产中计提销售服务费,并不再收取认购/申购费用的基金份额的称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,并分别计算基金份额净值。

本基金以定期开放的方式运作,在本基金的封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。本基金的封闭期为自《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效之日起(包括生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起进入开放期,期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期最长不超过20个工作日,最短不少于5个工作日,开放期的具体时间由基金管理人在开放期前依照《证券投资基金信息披露办法》的有关规定在指定媒体上予以公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通一年定期开放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具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款等,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,也可持有因可转换债券转股所形成的股票以及股票派发或可分离交易可转债分离交易的权证等资产。因上述原因持有的股票、权证等权益类资产,基金将在其可交易日起的6个月内卖出。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%(但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制);本基金持有的股票、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%。

开放期内,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%,封闭期内不受上述5%的限制。本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款税后收益率+1.2%。

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2016年3月24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》、《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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2015年度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年度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,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间没有需作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》、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,于2015年9月8日前暂减按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。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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

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 2015年1