

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司  
送出日期：2016年03月28日

## § 1 重要提示及目录

基金管理人的声明、重大事项披露函所载资料不含有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性和完整性负责。  
基金合同由公司和银行共同签署，由公司和银行共同盖章，由公司和银行共同签署并盖章。于2016年3月11日签署。本文件的财务报告、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、风险管理报告等信息，将存续至法律法规规定的信息披露期限，以供投资者查阅或复制。  
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及其更新报告。  
本基金根据法律法规要求向特定对象募集，仅限合格投资者。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报告。

本年度报告摘要经审计。报告期所有收入均来自基金资产。报告期无利润分配。

报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

## § 2 基金简介

基金基本情况	
基金名称	国海恒久信用债券
基金代码	450018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年09月11日
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末份额总额	41,900,807,132.00
基金合同存续期间	不定期
下一报告期基金简称	国海恒久信用债券A类
下一报告期基金代码	450018
下一报告期基金总份额	450019
报告期末A类基金的份额总额	35,561,013.12份
报告期末A类基金的份额总额	6,439,794.01份

2.2 基金产品说明	
投资目标	在有风险的前提下追求资本的保值增值，通过有效的风险管理，力求本基金资产的长期稳定增值。
1.资产配置策略	本基金将通过分析宏观经济形势、利率走势、资金供求关系、证券市场的运行特征、行业风格和个股的基本面等，择优选择各类资产进行投资，实现资产的优化配置。
投资策略	1.定期投资策略：通过定期定额投资，使投资者能够以较低的成本定期地获得收益，从而降低投资风险，同时建立研究分析的定期机制。 2.投资决策与操作策略：通过定期定额投资，使投资者能够以较低的成本定期地获得收益，从而降低投资风险，同时建立研究分析的定期机制。
业绩比较基准	60%×中债企业债全价指数+40%×国债到期收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险、较低波动性的品种，其预期风险水平低于货币市场基金、低风险股票型基金。

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	国海富兰克林基金管理有限公司 中国农业银行股份有限公司
姓名	施丽丽 林巍
信息披露负责人	施丽丽 010-6006-0009
联系电话	021-5655-5565
电子邮箱	service@ftfund.com ftgxp@chinabank.com
客户服务电话	400-700-4518, 0610-5680-RD21 95599
传真	021-6888 3060 010-6812 1816

2.4 信息披露方式	
基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ftfund.com
基金管理人和基金托管人的住所	

3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	
金额单位：人民币元	
3.1.3 期间数据和指标	
国海恒久信用债券A类	
2015年 2014年 2013年	
本期已实现收益 940,561.57 4,261,211.61 4,892,451.05	
本期利润 1,172,552.08 4,300,020.07 2,397,102.60	
期初平均基金份额净值 0.0022 0.1730 0.0100	
本期平均基金份额利润率 264% 16.68% -1.95%	
本期份额净值增长率 26.7% 2.28% -2.9%	
3.1.4 期末数据和指标	
2015年末 2014年末 2013年末	
本期已实现收益 2,097,217.00 1,221,176.27	
本期利润 99,072.28 3,967,222.88 -876,213.07	
期初平均基金份额净值 0.00228 0.1568 -0.0118	
本期平均基金份额利润率 1.89% 15.46% -1.16%	
本期份额净值增长率 1.82% 1.07% -3.26%	
3.1.5 本期未到期指标	
2015年末 2014年末 2013年末	
基金资产净值增长率 23.60% 2.23% -1.30%	
3.1.6 累计期数和净增长比率	
国海恒久信用债券A类	
2015年 2014年 2013年	
本期已实现收益 89,071.71 2,937,217.00 1,221,176.27	
本期利润 99,072.28 3,967,222.88 -876,213.07	
期初平均基金份额净值 0.00228 0.1568 -0.0118	
本期平均基金份额利润率 2.27% 10.61% -2.22%	
本期份额净值增长率 2.23% 1.86% -1.30%	
注：1. 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的《证券投资基金信息披露编报规则—第1号〈主要财务指标的计算及披露〉》。 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. 期间可供分配利润，采取月末资产负债表后未分配利润与本期利润孰高原则计算。	

3.2 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	份额净值增长 率	
(国海恒久信用债券A类)	份额净值增 长率	
长短期	业绩比较基 准收益率	
①-③	②-④	
过去三个月	0.82% 0.06% 1.08% 0.09%	-0.26% -0.04%
过去六个月	0.41% 0.10% 2.20% 0.08%	-1.79% 0.02%
过去一年	2.57% 0.08% 2.68% 0.10%	-0.12% -0.02%
过去三年	21.63% 0.24% 45.4% 0.11%	16.99% 0.13%
自基金合同生效日起至今	23.60% 0.23% 4.03% 0.10%	19.67% 0.13%
3.3 期间数据和指标		
国海恒久信用债券A类		
2015年 2014年 2013年		
本期已实现收益 1,468,636.36 1,069,558.01 -206,510.04		
本期利润 0.2266 0.1960 -0.0223		
期初平均基金份额净值 7,898,462.37 6,410,389.64 12,673,631.17		
本期平均基金份额利润率 1.22% 1.19% 0.03%		
本期份额净值增长率 1.23% 1.26% 0.05%		
3.3.1 本期未到期指标		
2015年末 2014年末 2013年末		
基金资产净值增长率 23.60% 2.23% -1.30%		
3.4 期间数据和指标		
国海恒久信用债券A类		
2015年 2014年 2013年		
本期已实现收益 89,071.71 2,937,217.00 1,221,176.27		
本期利润 99,072.28 3,967,222.88 -876,213.07		
期初平均基金份额净值 0.00228 0.1568 -0.0118		
本期平均基金份额利润率 2.27% 10.61% -2.22%		
本期份额净值增长率 2.23% 1.86% -1.30%		
注：1. 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的《证券投资基金信息披露编报规则—第1号〈主要财务指标的计算及披露〉》。 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. 期间可供分配利润，采取月末资产负债表后未分配利润与本期利润孰高原则。		

4.1 基金管理人及其管理基金的情况	
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金代销机构	无
基金销售机构	无

4.2 基金管理人对旗下基金履行持续信息披露义务的承诺	
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金代销机构	无
基金销售机构	无

4.3 基金管理人对旗下基金履行持续信息披露义务的承诺	
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金代销机构	无
基金销售机构	无

4.4 基金管理人对旗下基金履行持续信息披露义务的承诺	
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金代销机构	无
基金销售机构	无

4.5 基金管理人对旗下基金履行持续信息披露义务的承诺	
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金代销机构	无
基金销售机构	无

4.6 基金管理人对旗下基金履行持续信息披露义务的承诺	
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金代销机构	无
基金销售机构	无

4.7 基金管理人对旗下基金履行持续信息披露义务的承诺	


<tbl\_r cells="2"