

海富通双利分级债券型证券投资基金

2014 第四季度报告

2014年12月31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
报告送出日期:二〇一五年一月二十二日

1.1 重要提示
基金管理人的董事会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2015年1月21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,保证复核对账内容存在虚假记载、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本年度报告财务资料已经审计。
本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

1.2 基金基本情况

基金名称	海富通双利分级债券型证券投资基金
基金代码	519065
基金运作方式	契约型,本基金以“先存后取”的方式运作。
基金合同生效日	2013年12月4日
基金募集金额	93,149,362.82元
报告期末基金份额总额	93,149,362.82份
投资目标	本基金追求基金资产长期稳定增值的基础上,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资产配置策略、债券组合策略、信用债投资策略、中小企业私募债投资策略、杠杆投资策略、利率策略、可转债投资策略等。
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,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币型基金,低于股票型基金。
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
下属设区的基金名称	海富通双利分级债券A
下属设区的基金代码	519062
下属设区的基金合同生效日	2013年12月4日
下属设区的基金的风险收益特征	本基金A类基金份额的风险收益特征与本基金一致。

1.3 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(2014年10月1日至2014年12月31日)
1.本期已实现收益	19,112,935.87
2.本期利润	14,647,201.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.0447
4.期末基金份额净值	96.101,072.95
5.期末基金份额净值增长率	1.032

1.4 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:中证全债指数收益率。

1.5 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益投资	87,248,065.25	77.83
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	4,000,000.00	3.57
6	应收利息	18,031,037.25	15.87
7	其他资产	1,274,313.32	1.00
8	合计	111,041,542.79	100.00

1.6 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.7 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.8 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.9 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.10 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.11 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.12 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.13 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.14 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.15 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.16 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.17 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.18 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.19 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.20 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.21 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.22 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.23 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.24 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.25 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.26 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.27 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.28 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.29 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	5,619,331.00	5.85
4	企业债	65,085,770.70	67.73
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,535,945.05	17.21
8	其他	-	-
9	合计	87,248,065.75	90.78

1.30 基金投资组合报告

截至2014年12月31日,