

## 海富通一年定期开放债券型证券投资基金

### 更新招募说明书摘要

( 2015 年第 2 号 )

**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**

#### **重要提示**

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 2013 年 8 月 8 日中国证券监督管理委员会【2013】1062 号文注册募集。本基金的基金合同于 2013 年 10 月 24 日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

投资有风险，投资者在认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说

说明书和基金合同。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书所载内容截止日为 2015 年 10 月 24 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 9 月 30 日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 一、 基金管理人

### 一、 基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦  
36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦  
36-37 层

法定代表人：张文伟

成立时间：2003 年 4 月 18 日

电话：021-38650999

联系人：吴晨莺

注册资本：1.5 亿元人民币

股权结构：海通证券股份有限公司 51%、法国巴黎投资管理 BE 控股公司  
49%。

### 二、 主要人员情况

张文伟先生，董事长，硕士，高级经济师。历任交通银行河南省分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理，海富通基金管理有限公司董事、副总经理。2013 年 5 月起任海富通基金管理有限公司董事长。

邵国有先生，董事，工商管理硕士，副教授。历任吉林大学校党委副书记、

长春师范院校党委书记、长春新世纪广场有限公司副董事长兼总经理、海通证券股份有限公司宣传培训中心总经理，海富通基金管理有限公司董事长。2013年5月起任海富通基金管理有限公司董事。

**吉宇光先生**，董事，硕士，高级经济师。历任交通银行北京分行办公室副主任、交通银行北京分行证券部经理、海通证券北京朗家园营业部总经理等职。1997年至今任海通证券股份有限公司副总裁。2011年4月至今任海通国际证券集团有限公司董事会主席。

**陶乐斯( Ligia Torres )女士**，董事，法国与墨西哥双重国籍，双硕士学位，曾任职于东方汇理银行、渣打银行和欧洲联合银行，1996年加入法国巴黎银行集团工作，2010年3月至2013年6月任法国巴黎银行财产管理部英国地区首席执行官，2010年10月至今任法国巴黎银行英国控股有限公司董事，2013年7月至今任法国巴黎投资管理公司亚太区及新兴市场主管。

**简伟信 ( Vincent Camerlynck ) 先生**，董事，比利时国籍，国际政治学硕士，历任 CL Global Partners ( 纽约 ) 副总经理、汇丰投资银行 ( 伦敦 ) 副总经理、高盛投资银行 ( 伦敦及巴黎 ) 董事总经理、法国巴黎投资管理有限公司 ( 伦敦 ) 行政总裁兼董事，2012年9月至今任法国巴黎投资管理亚洲有限公司 ( 香港 ) 亚太区行政总裁。

**刘颂先生**，董事、总经理，英国籍，工商管理硕士。历任英国伦敦洛希尔父子有限公司投资银行助理，路透伦敦资产管理战略企划部全球总监，路透香港亚太区资产管理及研究总监，香港景顺投资管理有限公司驻北京办事处首席代表，景顺长城基金管理有限公司常务副总裁，德意志资产管理大中华区董事总经理。2015年3月加入海富通基金管理有限公司，现任海富通基金管理有限公

司董事、总经理。

**郑国汉先生**，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长、商学院院长及经济系讲座教授，现任香港岭南大学校长。

**巴约特 ( Marc Bayot ) 先生**，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授，先锋投资（米兰及都柏林）独立副董事长， Fundconnect 独立董事长、Degroof 资产管理（布鲁塞尔）独立董事和法国巴黎银行 B Control SICAV 独立董事。

**杨国平先生**，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任大众交通(集团)股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用事业(集团)股份有限公司董事长、上海交大昂立股份有限公司董事长。

**张馨先生**，独立董事，博士，教授。1984年7月至今任职于厦门大学经济学院，历任厦门大学经济学院教授、副院长兼财政系主任、院长。现任厦门大学经济学院教授、博士生导师。

**李础前先生**，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省财政厅中企处副主任科员，安徽省国有资产管理局科长，海通证券计划财务部副总经理、总经理和财务总监。

**魏海诺 ( Bruno Weil ) 先生**，监事，法国籍，博士。历任巴黎银行东南亚负责人、亚洲融资项目副经理，法国巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投行业务部负责人、零售部中国代表，南京银行副行长。现任法国巴

黎银行集团（中国）副董事长。

**俞涛先生**，监事，博士，CFA。先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根资产管理（英国）有限公司。曾任上投摩根基金管理有限公司业务发展部总监。2012年11月至今任海富通基金管理有限公司产品与创新总监。

**陈虹女士**，监事，法学士。历任香港的近律师事务所上海代表处律师，工银安盛人寿保险有限公司高级法律顾问，现任海富通基金管理有限公司高级法务经理。

**奚万荣先生**，督察长，经济学硕士，中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管，海通证券股份有限公司内部审计，2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任监事、监察稽核总监、总经理助理。2015年7月起，任海富通基金管理有限公司督察长兼上海富诚海富通资产管理有限公司监事。

**章明女士**，副总经理，硕士。历任加拿大 BBCC Tech & Trade Int'l Inc 公司高级财务经理、加拿大 Future Electronics 公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003年4月至2015年7月任海富通基金管理有限公司督察长，2015年7月起任海富通基金管理有限公司副总经理。

**阎小庆先生**，副总经理，硕士。历任中国人民银行上海分行助理经济师、富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部副经理、法国农业信贷银行上海华东区首席代表、富通基金管理公司上海代表处首席代表、海富通基金管理有限公司市场总监，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。2014年9月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事、总经理。

**陶网雄先生**，副总经理，硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长、上海中土实业发展公司主管会计、海通证券股份有限公司财务副经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，2003年4月至2006年4月任公司财务部负责人，2006年4月起任财务总监。2013年4月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

**戴德舜先生**，副总经理，硕士。历任天同证券有限责任公司分析师，中银国际证券有限公司分析师，2004年3月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、组合经理、研究总监、股票绝对收益组合总监、投资总监。2014年11月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

**何树方先生**，副总经理，博士。历任山东济宁市财政贸易委员会副科长，魁北克蒙特利尔大学研究助理（兼职），魁北克公共退休金管理投资公司分析师、基金经理助理，富国基金管理有限公司总经理助理，2011年6月加入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2014年11月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

**凌超先生**，硕士。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月担任光大保德信增利收益债券基金经理助理，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月起，兼任海富通一年定开债券基金经理，2014年4月起兼任海富通纯债债券基

金经理。2014 年 12 月起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。

本基金历任基金经理为位健，任职时间为 2013 年 10 月至 2014 年 3 月。

投资决策委员会常设委员有：刘颂，总经理；戴德舜，副总经理；邵佳民，总经理助理；丁俊，投资副总监；杜晓海，量化投资部总监，兼任上海富诚海富通资产管理有限公司投资总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊



### 三、 相关服务机构

#### 一、 基金份额发售机构

##### 1、 直销机构

名称：海富通基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦  
36-37 层

法定代表人：张文伟

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

联系人：康旭

电话：021-38650797、38650799

传真：021-33830160、33830161

##### 2、 其他销售机构

###### (1) 中国工商银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

电话：010-66107900

传真：010-66107914

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

###### (2) 中国银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

电话：010-66596688

传真：010-66593777

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

**(3) 交通银行股份有限公司**

地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

**(4) 江苏江南农村商业银行股份有限公司**

住所：江苏省常州市延陵中路 668 号

法定代表人：陆向阳

客户服务电话：96005

公司网站：http://www.jnbank.cc

**(5) 海通证券股份有限公司**

地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客户服务电话：021-95553 或 4008888001

联系人：李笑鸣

网址：www.htsec.com

(6) 国泰君安证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：万建华

客户服务电话：95521

联系人：芮敏祺、吴倩

网址：www.gtja.com

(7) 申万宏源证券有限公司

地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

客户服务电话：95523，4008895523

联系人：黄莹

网址：www.swhysc.com

(8) 中信建投证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-8888-108

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

(9) 招商证券股份有限公司

地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

客户服务电话：95565

联系人：林生迎

网址：www.newone.com.cn

(10) 中信证券股份有限公司

地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：王东明

电话：95558

联系人：顾凌

网址：www.cs.ecitic.com

(11) 中信证券(山东)有限责任公司

地址：青岛市崂山区深圳路 222 号天泰金融广场 A 座 20 层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：95548

联系人：吴忠超

网址：www.zxwt.com.cn

(12) 广州证券股份有限公司

地址：广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19 楼

法定代表人：刘东

客户服务电话：020-961303

联系人：林洁茹

网址：www.gzs.com.cn

(13) 国金证券股份有限公司

地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号成证大厦 16 楼

法定代表人：冉云

客户服务电话：4006600109

联系人：金喆

网址：www.gjq.com.cn

(14) 信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

客户服务电话：400-800-8899

联系人：唐静

网址：www.cindasc.com

(15) 中国中投证券有限责任公司

地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第18层至21层

法定代表人：龙增来

客户服务电话：95532 或 400-600-8008

联系人：刘毅

网址：http://www.china-invs.cn/

(16) 长城证券股份有限公司

地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

客户服务电话：4006666888

联系人：高峰

网址：www.cgws.com

( 17 ) 财富证券有限责任公司

地址：湖南长沙芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26、27 层

法定代表人：蔡一兵

电话：400-88-35316

联系人：郭磊

网址：www.cfzq.com

( 18 ) 国信证券股份有限公司

地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 层到 26 层

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

联系人：齐晓燕

网址：www.guosen.com.cn

( 19 ) 平安证券有限责任公司

地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林

客户服务电话：95511 转 8

联系人：吴琼

网址：stock.pingan.com

( 20 ) 天相投资顾问有限公司

地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

客户服务电话：010-66045678

联系人：尹伶

网址：www.txsec.com

**( 21 ) 中泰证券股份有限公司**

地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

联系人：孙豪志

网址：www.qlzq.com.cn

**( 22 ) 中国民族证券有限责任公司**

地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F

法定代表人：赵大建

客户服务电话：400-889-5618

联系人：李微

网址：www.e5618.com

**( 23 ) 江海证券有限公司**

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：刘爽

客服电话：400-666-2288

公司网站：www.jhzq.com.cn

**( 24 ) 中山证券有限责任公司**

地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：黄扬录

客户服务电话：4001022011

联系人：罗艺琳

网址：[www.zszq.com.cn](http://www.zszq.com.cn)

( 25 ) 华西证券股份有限公司

地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号

法定代表人：杨炯洋

客户服务电话：400-888-8818 95584

联系人：周志茹

网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

( 26 ) 西藏同信证券股份有限公司

地址：上海市闸北区永和路 118 弄 24 号

法定代表人：贾绍君

客户服务电话：40088-11177

联系人：汪尚斌

网址：<http://www.xzsec.com/>

( 27 ) 财达证券有限责任公司

地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23-26 层

法定代表人：翟建强

客户服务电话：4006128888

联系人：李卓颖

网址：<http://www.s10000.com/>



( 28 ) 太平洋证券股份有限公司

地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

法定代表人：李长伟

客户服务电话：4006650999

联系人：谢兰

网址：<http://www.tpyzq.com/>

( 29 ) 深圳众禄基金销售有限公司

地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006-788-887

联系人：童彩平

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

( 30 ) 杭州数米基金销售有限公司

地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000-766-123

联系人：张裕

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

( 31 ) 上海好买基金销售有限公司

地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

联系人：张茹

网址：www.ehowbuy.com

**( 32 ) 上海长量基金销售投资顾问有限公司**

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：单丙焯

客服电话：400-820-2899

公司网站：www.erichfund.com

**( 33 ) 上海天天基金销售有限公司**

地址：徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

法定代表人：其实

客户服务电话：400-1818-188

联系人：潘世友

网址：www.1234567.com.cn

**( 34 ) 和讯信息科技有限公司**

地址：上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 E 座 18F

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022

联系人：吴卫东

网址：licaikexun.com

**( 35 ) 北京展恒基金销售有限公司**

地址：北京顺义区后沙峪镇安富街 6 号

法定代表人：闫振杰

客户服务电话：400-888-6661

联系人：翟飞飞

网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

**( 36 ) 浙江同花顺基金销售有限公司**

地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼

法定代表人：凌顺平

客户服务电话：0571-88920897、4008-773-772

联系人：胡璇

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

**( 37 ) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司**

法定代表人：陈操

地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 室

联系人：刘宝文

客户服务电话：400-850-7771

网站：<https://t.jrj.com/>

**( 38 ) 一路财富（北京）信息科技有限公司**

法定代表人：吴雪秀

地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702

联系人：段京璐

客服电话：400-001-1566

网址：[www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

( 39 ) 上海联泰资产管理有限公司

法定代表人：燕斌

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

客服电话：4000-466-788

联系人：凌秋艳

<http://www.66zichan.com/>

( 40 ) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

法定代表人：罗细安

客服电话：400-001-8811

联系人：史丽丽

<http://www.zcvc.com.cn/>

( 41 ) 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：车倩倩

电话：010-56183769

客服电话：400-893-6885

网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

( 42 ) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

客服电话：400-820-2819

联系人：朱翔宇

<http://www.chinapnr.com/>

**( 43 ) 嘉实财富管理有限公司**

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心办公楼二期 46 层 4609-10

单元

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

联系人：余永健

网址：<http://www.harvestwm.cn/>

**( 44 ) 泰诚财富基金销售 ( 大连 ) 有限公司**

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

客服电话：400-6411-999

联系人：张晓辉

网址：<http://www.taichengcaifu.com>

基金管理人可以根据需要，增加其他符合要求的机构销售本基金，并按照相关规定及时公告。

## 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：010-50938856

传真：010-50938907

联系人：崔巍

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：孙睿

联系电话：021-31358666

经办律师：黎明、孙睿

### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：李丹

经办注册会计师：陈玲、黄靖婷

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：黄靖婷

#### 四、 基金的名称

本基金名称：海富通一年定期开放债券型证券投资基金

#### 五、 基金的类型

本基金类型：契约型开放式基金

#### 六、 基金的投资目标

本基金的投资目标为：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。

## 七、 基金的投资方向

本基金主要投资于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，基金将在其可交易之日起的6个月内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：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。

## 八、 基金的投资策略

### 1、债券投资组合策略



在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。

(1) 久期管理策略是根据对宏观经济环境、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金资产风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

(2) 收益率曲线策略是指在确定组合久期以后，根据收益率曲线的形态特征进行利率期限结构管理，确定组合期限结构的分布方式，合理配置不同期限品种的配置比例。通过合理期限安排，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，在保持组合一定流动性的同时，可以从长期、中期、短期债券的价格变化中获利。

(3) 类属配置包括现金、不同类型固定收益品种之间的配置。在确定组合久期和期限结构分布的基础上，根据各品种的流动性、收益性以及信用风险等确定各子类资产的配置权重，即确定债券、存款、回购以及现金等资产的比例。类属配置主要根据各部分的相对投资价值确定，增持相对低估、价格将上升的类属，减持相对高估、价格将下降的类属，借以取得较高的总回报。

## 2、信用类债券投资策略

信用债券收益率可以分解为与其具有相同期限的无风险基准收益率加上反映信用风险的信用利差之和。信用利差收益主要受两方面的影响：一是该债券对应的信用利差曲线；二是该信用债券本身的信用变化的影响，因此本基金分别采用基于信用利差曲线变化策略和基于本身信用变化的策略：

### (1) 基于信用利差曲线变化策略

信用利差曲线的变化受宏观经济周期及市场供求两方面的影响较大，因此

本基金一方面通过分析经济周期及相关市场的变化，判断信用利差曲线的变化，另一方面将分析债券市场的市场容量、市场形势预期、流动性等因素对信用利差曲线的影响，综合各种因素确定信用债券总的投资比例及分行业投资比例。

## （2）基于信用债信用变化策略

本基金主要依靠内部信用评级系统分析信用债的信用水平变化、违约风险及理论信用利差等。本基金信用评级体系将通过定性与定量相结合，着力分析信用债券的实际信用风险，并寻求足够的收益补偿。另外，评级体现将从动态的角度，分析发行人的资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，进而预测信用水平的变化趋势，决定投资策略的变化。

## 3、中小企业私募债券投资策略

与传统的信用债券相比，中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让，普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金对中小企业私募债券的投资将着力分析个券的实际信用风险，并寻求足够的收益补偿，增加基金收益。本基金管理人将对个券信用资质进行详尽的分析，从动态的角度分析发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，进而预测信用水平的变化趋势，决定投资策略。在流动性风险控制，本基金将重点放在一级市场，并根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模，严格防范流动性风险。

## 4、资产支持证券投资策略

对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风

险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。

#### 5、杠杆策略

杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较，判断是否存在利差套利空间，从而确定是否进行杠杆操作。进行杠杆放大策略时，基金管理人将严格控制信用风险及流动性风险。

#### 6、可转换债券投资策略

由于可转换债券兼具债性和股性，本基金将着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究。对于可转换债券的投资将主要从三个方面的分析：数量为主的价值分析、债股性分析和公司基本面分析。通过以上分析，力求选择债券价值有一定支撑、安全性和流动性较好，并且发行人成长性良好的品种进行投资。

#### 7、新股申购策略

参与新股申购和增发是降低投资组合风险，增强收益的良好渠道。因此，本基金将根据股票市场整体定价水平，估计新股上市交易的合理价格，同时参考一级市场资金供求关系，从而制定相应的新股申购策略。根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低，确定继续持有或者卖出。

#### 8、投资决策和程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作，又责任明确，在各自职责内按照业务程序独立工作并合

理地相互制衡。具体的决策流程如下：

(1) 投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规，决定公司针对市场环境重大变化所采取的对策；决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整；对旗下基金重大投资的批准与授权等。

(2) 投资总监在公司有关规章制度授权范围内，对重大投资进行审查批准；并且根据基金合同的有关规定，在组合业绩比较基准的基础上，制定各组合资产和行业配置的偏差度指标。

(3) 分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本面等进行分析，提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。

(4) 定期不定期召开基金经理例会，基金经理们在充分听取各分析师意见的基础上，确立公司对市场、资产和行业的投资观点，该投资观点是指导各基金进行资产和行业配置的依据。

(5) 基金经理在投资总监授权下，根据基金经理例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标，在充分听取策略分析师宏观配置意见、股票分析师行业配置意见及固定收益分析师的债券配置意见，进行投资组合的资产及行业配置；之后，在债券分析师设定的债券池内，根据所管理组合的风险收益特征和流动性特征，构建基金组合。

(6) 基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

(7) 定量分析师负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。

(8) 定量分析师负责完成内部基金业绩评估，并完成有关评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要，对上述投资管理程序做出调整。

## 九、 基金的业绩比较基准

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%

在每个封闭期首日至下一个开放期最后一日，上述“一年期银行定期存款税后收益率”指当期封闭期首日（若为首个封闭期，则为基金合同生效日）中国人民银行公布并执行的一年期金融机构人民币存款基准税后利率，以后每一个封闭期首日进行调整。

如果今后法律法规发生变化，或中国人民银行调整或停止该基准利率的发布，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。本基金管理人经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

## 十、 基金的风险收益特征

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。

## 十一、 投资组合报告

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。

任。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于2015年11月19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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止至2015年9月30日（“报告期末”）。

### 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	73,191,803.00	73.55
	其中：债券	73,191,803.00	73.55
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	24,487,024.70	24.61
7	其他资产	1,832,912.61	1.84
8	合计	99,511,740.31	100.00

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	1,066,700.00	1.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	34,738,267.50	35.06
	其中：政策性金融债	34,738,267.50	35.06
4	企业债券	21,174,862.70	21.37
5	企业短期融资券	5,035,000.00	5.08
6	中期票据	-	-
7	可转债	11,176,972.80	11.28
8	其他	-	-
9	合计	73,191,803.00	73.86

**5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018001	国开 1301	344,250	34,738,267.50	35.06
2	126018	08 江铜债	87,020	8,563,638.20	8.64
3	122327	13 卧龙债	61,000	6,367,180.00	6.43
4	011547001	15 华润 SCP001	50,000	5,035,000.00	5.08
5	113008	电气转债	28,500	3,737,775.00	3.77

**6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。



## 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

## 11 投资组合报告附注

11.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	71,452.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,761,459.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,832,912.61

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	3,737,775.00	3.77
2	128009	歌尔转债	3,123,404.80	3.15
3	110030	格力转债	1,284,580.50	1.30

### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## 十二、 基金的业绩

基金业绩截止日为2015年9月30日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

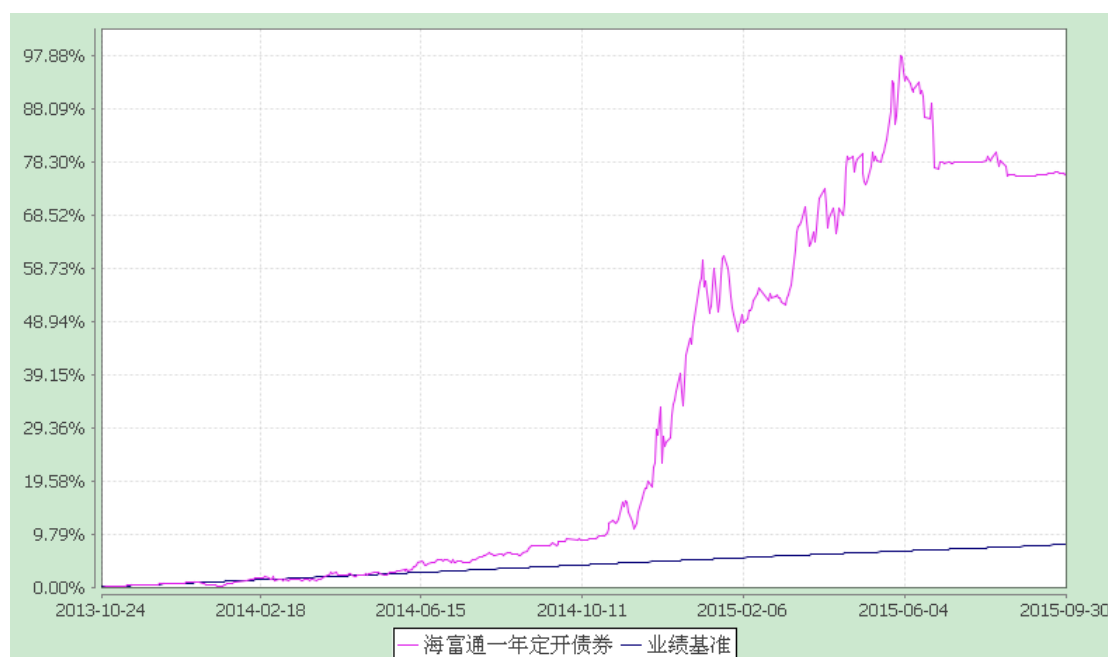
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2013年10月24日(基金合同生效日)至2013年12月31日	1.00%	0.05%	0.78%	0.01%	0.22%	0.04%
2014年1月1日-2014年12月31日	46.44%	0.96%	4.17%	0.01%	42.27%	0.95%
2015年1月1日-2015	20.55%	1.68%	1.82%	0.01%	18.73%	1.67%

年6月30日						
2013年10月24日(基金合同生效日)至 2015年9月30日	76.20%	1.08%	7.85%	0.01%	68.35%	1.07%

(二) 本基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势

对比图：

(2013年10月24日至2015年9月30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。

## 十三、 基金的费用和税收

### 一、 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付

日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务年费率为 0.4%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计算，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中划出，由基金管理人代收后按照相关协议支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 4 - 9 项费用”，根据有关法规及相应协议规

定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

海富通一年定期开放债券型证券投资基金更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

一、“二、释义”部分：增加了部分词语或简称的定义。

二、“三 基金管理人”部分：

1. 增加了陈虹女士的简历。

2.更新了邵国有先生、巴约特 ( Marc Bayot ) 先生、奚万荣先生、章明女士、凌超先生的简历。

3.删除了孟辉先生的简历。

4.更新了投资决策委员会的相关信息。

三、“四 基金托管人”部分：对基金托管人的相关信息进行了更新。

四、“五 相关服务机构”部分：

1.对部分销售机构的相关信息进行了更新。

2.更新了登记机构的信息。

3.更新了审计基金财产的会计师事务所的信息。

五、“九、基金份额的申购、赎回与转换”部分：

1.更新了“六 申购费用和赎回费用”部分的内容。

2.更新了“七 申购份额与赎回金额的计算”部分的内容。

3.更新了“十一 巨额赎回的情形及处理方式”部分的内容。

六、“十 基金的投资”和“十一 基金的业绩”部分，根据2015年第三季度报告，更新了基金投资组合报告和基金业绩的内容，相关数据截止期为2015年9月30日。

七、“十三、基金资产的估值”部分：更新了“四 估值程序”部分的内容。

八、“十四、基金的收益与分配”部分：更新了“三 基金收益分配原则”的内容。

九、“十五、基金的费用和税收”部分：



1.更新了“一 基金费用的种类”部分的内容。

2.更新了“二 基金费用计提方法、计提标准和支付方式”部分的内容。

十、“十九、基金合同的变更、终止于基金财产的清算”部分：更新了“五基金财产清算剩余财产的分配”部分的内容。

十一、“基金合同的内容摘要”部分：

1. 更新了“一 基金合同当事人及权利义务”部分的内容。

2. 更新了“三 基金的收益与分配”部分的内容。

3. 更新了“四 基金费用与税收”部分的内容。

4. 更新了“六 基金财产净值的估算方法和公告方式”部分的内容。

5. 更新了“七 《基金合同》的变更、终止”部分的内容。

十二、“基金托管协议的内容摘要”部分：

1. 更新了基金托管人的相关信息。

2. 更新了“五 基金资产净值计算和会计核算”部分的内容。

3. 更新了“八 托管协议的修改与终止”部分的内容。

2015年12月7日