海富通稳固收益债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2013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

海富通稳固收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经2010年7月23日中国证券监督管理委员会证监许可【2010】983号文核准募集。本基金的基金合同于2010年11月23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。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前,需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括:因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金投资债券引发的信用风险,以及本基金投资策略所特有的风险等等。基金管理人及销售机构均不对基金的收益或本金安全做出保证。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,投资者在申购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2013年11月23日,有关财务数据和净值表现截止日为2013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:包瑾
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。历任交通银行郑州分行铁道支行行长、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,副教授。历任吉林大学校党委副书记、长春师范学院校党委书记、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月起转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。

田仁灿先生,董事、总经理,比利时籍,工商管理硕士。历任法国金融租赁Euroequipement S.A.公司总裁助理,富通银行区域经理、大中华地区主管,富通基金管理亚洲有限公司投资经理、业务发展部总经理、首席执行官。2003年至今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,EFAMA(欧洲基金和资产管理协会)和比利时基金公会名誉主席,INVESTPROTECT公司(布鲁塞尔)董事总经理、Pionner投资公司(米兰,都柏林,卢森堡)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 Flexible 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。

王明权先生,独立董事,硕士,高级经济师。历任武汉市人民政府副市长、交通银行行长、党委(组)书记、副董事长、中国光大(集团)总公司董事长、党委书记。现任全国人大代表、全国人大财经委员会委员。

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。

谷若鸿(Laurent Couraudon)先生,监事,法国籍,斯特拉斯堡的罗伯特舒曼大学的国际贸易硕士学位。历任法国外贸银行莫斯科分行董事及企业金融部主管、法国巴黎银行俄罗斯分行商务拓展主管及法国巴黎银行莫斯科分行首席执行官兼俄罗斯地区总裁等职。2011年至今任法国巴黎银行(中国)有限公司董事会主席兼中国区总裁。

奚万荣先生,监事,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监察稽核部稽核员。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司稽核经理、监察稽核总监。

高勇前先生,监事,经济学学士。历任宁波进出口公司财务部会计主管、上海科源医学高科技实业公司财务部财务主管、华安基金管理有限公司财务核算部副总监。2008年4月至今任海富通基金管理有限公司基金运营总监。

章明女士,督察长,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 年至今任海富通基金管理有限公司督察长。

陈洪先生,副总经理,硕士。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003年4月至今任海富通精选混合基金经理,2003年4月至2012年9月任海富通基金管理有限公司投资总监,2005年7月至2006年9月任海富通股票基金经理,2006年3月至9月任海富通收益增长混合基金经理,2006年5月起,任海富通基金管理有限公司副总经理,2007年2月至2007年8月任海富通风格优势股票基金经理,2007年4月至2007年8月任海富通精选式号混合基金经理,2008年6月至2011年2月任海富通中国海外股票(QDII)基金经理。

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。

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。

邵佳民先生,硕士。历任海通证券公司固定收益部债券业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资部经理。2003年4月任海富通基金管理有限公司固定收益分析师,2005年1月至2008年2月任海富通货币基金经理,2006年5月起任海富通强化回报混合基金经理,2007年10月至2013年1月任固定收益组合管理部总监,2008年10月起兼任海富通稳健添利债券基金经理,2010年11月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2013年1月起兼任海富通稳进增利分级债券基金经理。2013年1月起任投资副总监。

投资决策委员会常设委员有:田仁灿,总经理;陈洪,副总经理;戴德舜,投资总监;蒋征,投资副总监;邵佳民,投资副总监;丁俊,研究总监;杜晓海,定量及风险管理总监。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
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349,018,545,827元
联系电话:010-66105799
联系人:赵会军

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
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
全国统一客户服务号码:40088-40099(免长途话费)
电话:021-38650797
传真:021-33830160
2、场外销售机构
(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
(2)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
传真:010-66275654
客户服务电话:95533
联系人:张静
网址:www.ccb.com
(3)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
(4)中国农业银行股份有限公司
地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:蒋超良
客户服务电话:95599
传真:010-85108557
网址:www.abchina.com
(5)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
(6)招商银行股份有限公司
地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:傅育宁
客户服务电话:95555
联系人:邓炯鹏
网址:www.cmbchina.com
(7)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
客户服务电话:95528
联系人:高天,虞谷云
网址:www.spdb.com.cn
(8)中国光大银行股份有限公司
地址:北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人:唐双宁
客户服务电话:95595(全国)
联系人:李伟
网址:www.cebbank.com
(9)平安银行股份有限公司
地址:广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:孙建一
客户服务电话:95511-3
开放式基金业务传真:0755-25879453
网址:www.bank.pingan.com
(10)中信银行股份有限公司
地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:常振明
客户服务电话:95558
网址:http://bank.ecitic.com/
(11)中国民生银行股份有限公司
地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn
(12)浙商银行股份有限公司
地址:中国杭州市庆春路288号
法定代表人:张达洋
客户服务电话:95527
联系人:毛真海
网址:www.czbank.com
(13)华夏银行股份有限公司
地址:北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人:吴建
客户服务电话:95577
网址:www.hxb.com.cn
(14)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
(15)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
(16)光大证券股份有限公司
地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:袁长清(代)
客户服务电话:95525
联系人:刘晨、李芳芳
网址:www.ebscn.com
(17)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
(18)中信建投证券股份有限公司
地址:北京市朝阳门内大街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
(19)华泰证券股份有限公司
地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
客户服务电话:95597
联系人:肖亦玲
网址:www.htsc.com.cn
(20)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
(21)兴业证券股份有限公司
地址:福建省福州市湖东路268号
法定代表人:兰荣
客户服务电话:95562
联系人:谢高得
网址:www.xyzq.com.cn
(22)长江证券股份有限公司
地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
客户服务电话:95579
联系人:李良
网址:www.95579.com
(23)申银万国证券股份有限公司
地址: 上海市常熟路171号
法定代表人:储晓明
客户服务电话:95523,4008895523
联系人:高天
网址:www.sywg.com
(24)华泰联合证券有限责任公司
地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦25、24、10层
法定代表人:吴晓东
客户服务电话:95513
联系人:盛宗凌
网址:www.lhzq.com
(25)广发证券股份有限公司
法定代表人:孙树明
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
联系人:黄岚
统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点
公司网站:www.gf.com.cn
(26)东方证券股份有限公司
地址:上海市中山南路318号2号楼21层-29层
法定代表人:潘鑫军
客户服务电话:95503
联系人:吴宇
网址:www.dfzq.com.cn
(27)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
(28)中国银河证券股份有限公司
地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
客户服务电话:4008-888-888
联系人:田薇
网址:www.chinastock.com.cn
(29)平安证券有限责任公司
地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
客户服务电话:95511转8
联系人:郑舒丽
网址:stock.pingan.com
(30)中信万通证券有限责任公司
地址:山东省青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15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
(31)东北证券股份有限公司
地址:吉林省长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
客户服务电话:4006000686
联系人: 潘锴
网址:www.nesc.cn
(32)德邦证券有限责任公司
地址:上海市福山路500号城建国际中心26层
法定代表人:姚文平
客户服务电话:4008888128
联系人:罗芳
网址:www.tebon.com.cn
(33)宏源证券股份有限公司
地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
客户服务电话:4008-000-562
联系人:李巍
网址:www.hysec.com
(34)齐鲁证券有限公司
地址:山东省济南市经七路86 号
法定代表人:李玮
客服电话:95538
联系人:孙豪志
网址:www.qlzq.com.cn
(35)第一创业证券股份有限公司
地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
法定代表人:刘学民
客户服务电话:4008881888
联系人:魏颖
网址:http://www.fcsc.com
(36)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4006008008
联系人:刘毅
网址:http://www.china-invs.cn/
(37)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
(38)华福证券有限责任公司
地址:福州五四路新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金琳
客户服务电话:0591-96326
联系人:张腾
网址:www.gfhfzq.com.cn
(39)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:高冠江
客户服务电话:400-800-8899
联系人:唐静
网址:www.cindasc.com
(40)渤海证券股份有限公司
地址:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:杜庆平
客户服务电话:400-651-5988
联系人:王兆权
网址:www.ewww.com.cn
(41)中银国际证券有限责任公司
地址:上海市浦东银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:许刚
客户服务电话:400-6208-888,021-61195566
联系人:吕品
网址:www.bocichina.com.cn
(42)长城证券有限责任公司
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
(43)方正证券股份有限公司
地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
客户服务电话:95571
联系人:郭军瑞
网址:www.foundersc.com
(44)东莞证券有限责任公司
地址: 广东省东莞市莞城区可园南路1 号金源中心30 楼
法定代表人:张运勇
客户服务电话:961130(省内直拨,省外请在前加拨区号0769)
联系人:梁建伟
网址:www.dgzq.com.cn
(45)广州证券有限责任公司
地址: 广州市越秀区先烈中路69号东山广场主楼17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
(46)上海证券有限责任公司
地址:上海市黄浦区西藏中路336号
法定代表人:龚德雄
客户服务电话:4008918918,021-962518
联系人:陈翔
网址:www.962518.com
(47)大通证券股份有限公司
地址:大连市沙河口区会展路129号
法定代表人:董永成
客户服务电话:4008169169
联系人:谢立军
网址:www.daton.com.cn
(48)江海证券有限公司
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:高悦铭
客服电话:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn
(49)山西证券股份有限公司
地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
客户服务电话:400-666-1618
联系人:张治国
网址:www.i618.com.cn
(50)国都证券有限责任公司
地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
法定代表人:常喆
客户服务电话:400-818-8118
联系人:黄静
网址:www.guodu.com
(51)东兴证券股份有限公司
地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层
法定代表人:魏庆华
客户服务电话:4008-888-993
联系人:黄英
网址:www.dxzq.net
(52)财富证券有限责任公司
地址:湖南长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼-28层
法定代表人:孙智勇
电话:0731-84403360@
传真:0731-84403330
联系人:朱友谊
网址:www.cfzq.com
(53)民生证券股份有限公司
地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A层16-18层
法定代表人:余政
客户服务电话:4006198888
联系人:赵明
网址:www.mszq.com
(54)华龙证券有限责任公司
地址:甘肃省兰州市东岗西路638号
法定代表人:李晓安
客户服务电话:4006898888
联系人:邓鹏怡
网址:www.hlzqgs.com
(55)华宝证券有限责任公司
地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
法定代表人:陈林
客户服务电话:4008209898
联系人:刘闯川
网址:www.cnhbstock.com
(56)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:林爽
网址:www.txsec.com
(57)安信证券股份有限公司
地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼
法定代表人:牛冠兴
客户服务电话:400-800-1001
联系人:陈剑虹
网址:www.essence.com.cn
(58)中信证券(浙江)有限责任公司
地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人:沈强
客户服务电话:95548
联系人:俞会亮
网址:www.bigsun.com.cn
(59)华西证券有限责任公司
地址:四川省成都市青羊区陕西街239号
法定代表人:杨炯洋
客户服务电话:400-888-8818 95584
联系人:李慧灵
网址:www.hx168.com.cn
(60)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 及 www.jmmw.com
(61)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:周嫣旻
网址:www.fund123.cn
(62)上海好买基金销售有限公司
地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
法定代表人:杨文斌
客户服务电话:400-700-9665
联系人:蒋丹丹
网址:www.ehowbuy.com
(63)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:敖玲
电话:021-58788678-8201
传真:021—58787698
客服电话:400-089-1289
公司网站: www.erichfund.com
(64)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
法定代表人:汪静波
客户服务电话:400-821-5399
联系人:魏可妤
网址: www.noah-fund.com
(65)上海天天基金销售有限公司
地址:徐汇区龙田路190号2楼2层
法定代表人:其实
客户服务电话:400-1818-188
联系人:张国勤
网址: www.1234567.com.cn
(66)和讯信息科技有限公司
地址:上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦25楼C区
法定代表人: 王莉
客户服务电话:400-920-0022
联系人:周轶
网址: licaike.hexun.com
(67)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:焦琳
网址: www.myfund.com

3、场内销售机构

具有开放式基金销售资格的、经中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员可成为本基金的场内销售机构,相关信息同时通过上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)登载。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)注册登记机构
名称: 中国证券登记结算有限责任公司
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:010-59378835
传真:010-59378907
联系人:任瑞新

(三)出具法律意见书的律师事务所
通力律师事务所
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:黎明
联系电话:021-31358666-8663
经办律师:吕红、黎明

(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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人:杨绍信
经办注册会计师:薛竞、叶尔甸
电话:(021) 23238888
传真:(021) 23238800
联系人:刘莉

四、基金的名称

本基金的名称:海富通稳固收益债券型证券投资基金

五、基金的类型

基金类型:债券型、契约型开放式

六、基金的投资目标

通过合理运用投资组合优化策略,力争实现基金收益随着时间增长的逐步提升。

七、基金的投资方向和范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 主要投资于国内依法发行上市的固定收益类品种,包括公司债券、企业债券、可转换债券、短期融资券、金融债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购等,同时投资于股票、权证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%,本基金可以参与一级市场新股申购以及在二级市场上投资股票、权证等权益类证券,投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的20%,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%。

如果法律法规或监管机构允许基金投资于其它品种,本基金在履行适当的程序后,可以将其纳入到基金的投资范围。

八、基金的投资策略

一、本基金的整体投资策略分为三个层次:

第一层次,即资产配置策略,将以优化投资组合保险策略为核心,并结合把握市场时机,确定和调整基金资产在风险资产和低风险资产的配置比例,实现风险预算管理、降低系统性风险,实现基金投资目标;

第二层次,即债券投资策略,将采用自上而下的策略,以久期管理为核心,从整体资产配置、类属资产配置等方面进行积极主动的债券投资管理,实现基金份额净值的稳步提升;

第三层次,即股票投资策略,包括新股申购策略和积极的精选个股策略。新股申购策略着眼于把握其中可能的超额收益机会;积极的精选个股策略将兼顾个股的成长性和估值水平,寻找具有较强的持续成长能力,同时价值又没有被高估的股票主动买进持有。

围绕着这三个层次的投资策略,基金管理人还将充分运用市场上各种金融投资工具,结合投资策略的需要,利用权证等金融衍生工具,通过合理有效的金融模型分析,积极发掘低风险投资机会和锁定套利收益。

1. 资产配置策略

第一层次的资产配置策略属于传统意义上的大类资产配置, 本基金将采用优化的投资组合保险策略,根据基金收益的增长曲线,来计算股票资产的投资市值,适度把握市场时机,合理配置基金资产。投资组合保险策略的实施是实现本基金投资目标的关键环节。

本基金将综合运用固定比例组合保险策略(CPPI)和时间不变性投资组合保险策略(TIPP)来实现基金的投资目标。这两种策略都属于投资组合保险策略,两者差别在于,CPPI策略主要通过定量化的资产配置来确保本金的安全,TIPP是在CPPI策略上的改进,能够反映投资成本的变化,实现对当期收益的锁定。

在运用固定比例组合保险策略(CPPI)时,首先需要设定一个保险底线,保险底线为一个目标价值,基金管理人将力争基金资产价值不低于该目标。在投资运作过程中,基金管理人通过定量分析,以已经实现的超过保险底线的收益为基础,对此乘以一定的放大倍数(即乘数),形成风险资产(股票、权证等资产)的配置比例。

本基金的资产配置是一个动态过程,基金管理人在运作过程中将不断根据投资组合保险策略的原则调整风险资产(股票、权证等资产)与低风险资产(债券等资产)的比例,确保投资组合的价值不低于设定的保险底线目标。

时间不变性组合保险策略(TIPP)是在CPPI策略上的改进。TIPP在操作上大致与CPPI相同,唯一不同的是保险底线的设定与调整。在TIPP策略下,保险底线会根据投资组合价值变动进行动态调整。一般情况下,TIPP策略将重新计算后的保险底线和原保险底线进行比较, 取较大者为最新的保险底线。换而言之,当运用TIPP策略时,如果基金单位资产净值处于不断变化的过程,则保险底线也可能随着基金单位资产价值的变化而调整。

本基金运用的优化组合保险策略中的参数设定是以实证分析为基础,运用多因素分析系统研判市场趋势,确定具体参数值,为优化组合保险策略提供决策依据。本基金期初将以CPPI策略为主,在动态判断和评估市场环境及市场趋势、风险资产估值水平、基金资产的整体风险水平等因素的基础上,如果对市场预期判断发生变化,则转为更保守的TIPP策略。从整体上看,CPPI策略的运用是为了避免基金的初始资产遭受本金损失,而TIPP策略的运用主要是力争对基金已实现收益的保护。两者的综合使用,将有助于实现基金的投资目标,即力争实现基金收益随着时间增长的逐步提升。

2. 债券投资策略

债券投资是本基金的投资重点,是实现组合收益的主要来源。本基金通过价值分析,采用自上而下确定投资策略,采取久期管理、类属配置和现金流管理策略等积极投资策略,发现、确认并利用细分市场失衡,实现组合增值。

1)久期管理策略。根据优化投资组合保险投资策略的需要,适当兼顾收益性和流动性,并根据对利率水平的预期,确定组合的平均剩余期限。

2)结合收益率曲线策略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,保持组合较高的流动性,既能满足投资者的流动性需求,又能避免组合规模的变化对投资策略实施的影响。

3)类属配置包括现金、各市场及各品种间的配置。在确定组合剩余期限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,即确定不同市场、不同期限及不同品种的债券之间的比例。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。

4)采取现金流管理策略,在动态分析、规划、测算组合内生现金流、申购赎回净现金流的基础上,合理配置和动态调整组合现金流。在满足日常流动性要求的基础上,最大限度减少冲击成本,实现组合流动性要求和收益率期望的合理配置。

5)债券市场的套利策略

债券市场的套利策略包括跨市场套利策略、跨品种套利策略等策略,以实现在同等风险程度下的更高收益。跨市场套利策略是指由于不同市场上债券价格存在差异,根据债券在各市场上的流动性和收益特征,进行跨市场操作而套利;跨品种套利策略是指根据各细分市场中不同品种的风险参数、流动性补偿和收益特征,进行跨品种操作而套利。

3. 股票投资策略

本基金的股票投资策略包括了新股申购策略和积极的精选个股两个方面。

(1)新股申购策略

实证研究表明,长期参与新股投资,存在一定的超额收益机会。特别是在国内A股市场,新股申购和增发是增强收益的良好渠道。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。并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。

(2)个股精选策略

除了新股申购以外,本基金通过个股精选策略,兼顾个股的成长性和估值水平,寻找具有较强的持续成长能力,同时价值又没有被高估的股票主动买进持有。

价值分析分为两部分,公司的品质分析及估值水平分析。本基金对上市公司的价值分析首先将分析公司的品质,着重进行财务分析,考察每股收益率(EPS)、净资产收益率(ROE)等指标,另外将根据上市公司所处行业景气度及其在行业中的竞争地位等多方面的因素进行综合评估, 挖掘上市公司的投资价值。本基金对股票的估值分析,将关注PE、PB、PS等指标。对于这些指标,除了静态分析以外,本管理人还将根据对公司的深入研究及盈利预测,进行动态分析。

对于成长性分析,本基金管理人将重点关注企业的内涵式增长。内涵式增长主要是来自企业的管理技能的可复制、企业的创新能力、产品的竞争优势及公司抵抗风险持续生存的能力等。本基金将从定量分析及定性分析两方面分析企业的成长能力。定量分析将通过成长性指标分析公司的经营状况,成长性指标主要包括:PEG、每股收益增长率、净利润预测增长率、主营业务增长率等等。定性分析将以宏观分析和行业分析作为评估的基础,对公司内部因素进行深刻理解和分析,挖掘上市公司保持高成长性和业绩增长的驱动因素,深入分析这些驱动因素是否具有可持续性,从而优选出品质优良、成长潜力高于平均水平的上市公司。定性分析包括行业前景分析等外部因素分析及公司商业模式、公司治理、管理层素质、产品竞争力、企业创新能力等内部因素分析。

本基金股票投资强调将定量的股票筛选和定性的公司研究有机结合,并实时应用风险控制手段进行组合调整。

4. 金融衍生工具的投资策略

在本基金存续期内,如果市场出现新的金融衍生工具或新的投资方式,本基金将从投资策略角度出发,本着审慎的原则,在法律法规允许的范围内有选择地加以使用。

5. 权证投资策略

本基金的权证投资将以保值为主要投资策略,在控制风险的前提下,充分利用权证来达到控制下跌风险、实现保值和锁定收益的目的;此外,还将充分发掘可能的套利机会,以达到增值的目的。

二、投资决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资模式。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

本基金业绩比较基准:三年期银行定期存款利率(税后)。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,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。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,属于中低风险品种。其预期收益和风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定,于2013年12月16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2013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	238,837,100.00	89.63
	其中:债券	238,837,100.00	89.63
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	19,000,000.00	7.13
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	3,167,482.41	1.19
6	其他各项资产	5,480,004.82	2.06
7	合计	266,484,587.23	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