海富通季季增利理财债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2018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:中国银行股份有限公司
重要提示

海富通季季增利理财债券型证券投资基金经2014年6月12日中国证券监督管理委员会【2014】582号文准予注册募集。本基金的基金合同于2014年8月19日正式生效。本基金为理财债券型证券投资基金(固定组合类),基金的运作方式为契约型开放式。本基金以“运作期滚动”方式运作。根据基金合同约定,经向中国证监会备案,基于对下一运作期的风险收益进行综合评估,本基金第一运作期于2014年12月23日到期后暂停下一运作期运作。

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。当投资人赎回时,所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

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,投资人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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为2018年8月19日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

第一部分基金管理人

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%、法国巴黎资产管理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。

任志强先生,董事,总经理,硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理,华宝信托投资有限责任公司研究发展中心总经理兼投资管理部总经理、华宝信托投资有限责任公司总裁助理兼董事会秘书,华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。华宝兴业基金管理有限公司基金经理、投资总监、副总经理,华宝兴业资产管理(香港)有限公司董事长。2017年6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。2018年3月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事长。

杨明先生,董事,管理学学士。历任中国人民银行新余支行科员,交通银行新余支行办公室科员、证券业务部负责人、证券业务部副主任、证券业务部主任,海通证券有限公司新余营业部总经理,海通证券股份有限公司江苏分公司筹备负责人、总经理、党委副书记,现任海通证券股份有限公司人力资源部总经理、党委组织部部长。

吴淑琨先生,董事,管理学博士。历任南京大学副教授,海通证券股份有限公司研究所宏观研究部经理、所长助理、机构业务部副总经理、企业及私人客户服务部副总主持、企业金融部总经理。现任海通证券股份有限公司战略发展部总经理。

Ligia Torres(陶乐斯)女士,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月至今任法国巴黎资产管理公司亚太区CEO。

AlexandreWerno(韦历山)先生, 董事,法国籍,金融硕士学位。2007年9月至2013年4月在法国兴业投资银行全球市场部任执行董事、中国业务开发负责人职务;2013年5月至2017年11月先后任华宝兴业基金管理有限公司总经理高级顾问、常务副总经理职务;2017年11月至今任法国巴黎资产管理亚洲有限公司亚太区战略合作总监。

郑国汉先生,独立董事,美国籍,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。

Marc Bayot(巴约特)先生,独立董事,比利时籍,布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学金融学荣誉教授,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,Degroof资产管理(布鲁塞尔) 独立董事, 现任 Pioneer投资公司(米兰, 都柏林, 卢森堡) 独立董事、Fundconnect独立董事长和法国巴黎银行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。

张馨先生,独立董事,博士。历任厦门大学经济学院财金系教授及博士生导师、副院长兼系主任、厦门大学经济学院院长。2011年1月至今退休。

杨仓兵先生,监事长,管理学学士。历任安徽省农业科学院计财科副科长,安徽示康药业有限公司财务部干部、经理,海通证券股份有限公司计划财务部干部、计划资金部资金科科长、计划资金部总经理助理、计划资金部副总经理,上海海振实业发展有限公司总经理,海通证券股份有限公司计划财务部副总经理。自2015年10月至今任海通证券股份有限公司资金管理总部总经理。

Bruno Weil(魏海诺)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月加入海富通基金管理有限公司,历任产品与创新总监。2015年12月起任海富通基金管理有限公司总经理助理。

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。2015年7月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司监事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

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。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

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。

陈轶平先生,博士,CFA。历任Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理(上海)有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事,2011年10月加入海富通基金管理有限公司,历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监,现任固定收益投资副总监。2013年8月起任海富通货币基金经理。2014年8月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014年11月起兼任海富通上证可质押城投债ETF基金经理。2015年12月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015年12月至2017年9月兼任海富通稳进增利债券(LOF)基金经理。2016年4月起兼任海富通一年定开债券基金经理。2016年7月起兼任海富通富祥混合基金经理。2016年8月起兼任海富通瑞丰一年定开债券基金经理。2016年8月至2017年11月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016年11月起兼任海富通美元债(QDII)基金经理。2017年1月起兼任海富通上证周期产业债ETF基金经理。2017年2月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017年3月至2018年6月兼任海富通富源债券基金经理。2017年3月起兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017年5月起兼任海富通富睿混合基金经理。2017年7月起兼任海富通欣悦混合、海富通瑞福一年定开债券、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018年4月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。

谈云飞女士,硕士。2005年4月至2014年6月就职于宝兴业基金管理有限公司,曾任产品经理、研究员、专户投资经理 、基金经理助理,2014年6月加入海富通基金管理有限公司。2014年7月至2015年10月任海富通现金管理货币基金经理。2014年9月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2015年1月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015年4月起兼任海富通新内需混合基金经理。2016年2月起兼任海富通货币基金经理。2016年4月至2017年6月兼任海富通纯债债券、海富通双福债券(原海富通双福分级债券)、海富通双利债券基金经理。2016年4月起兼任海富通安颐收益混合(原海富通养老收益混合)基金经理。2016年9月起兼任海富通欣益混合、海富通聚利债券及海富通欣荣混合基金经理。2017年2月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2017年3月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017年3月至2018年1月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017年7月起兼任海富通季季通利理财债券基金经理。

投资决策委员会常设委员有:任志强,总经理;胡光涛,总经理助理;王智慧,总经理助理;孙海忠,总经理助理兼固定收益投资总监;杜晓海,量化投资部总监;王金祥,研究部总监;陈轶平,固定收益投资副总监;赵赫,年金权益投资总监。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。

第二部分基金托管人

一、基金托管人基本情况
名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人:陈四清
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管部门信息披露联系人:王永民
传真:(010)66594942
中国银行客服电话:95566

第三部分相关服务机构

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:暴潇菡
电话:021-38650797
传真:021-33830160
2、其他销售机构
(1) 中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1 号
法定代表人:陈四清
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
客户服务电话:95566
联系人:陈洪源
网址:www.boc.cn
(2) 海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人:周杰
办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦
客户服务电话:95553或4008888001
联系人:李笑鸣
网址:www.htsec.com
(3) 国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
法定代表人:杨德红
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29F
客户服务电话:95521
联系人:钟伟镇
网址:www.gtja.com
(4) 中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:王常青
办公地址:北京市东城区朝内大街188号
客户服务电话:95587或4008888108
联系人:许梦园
网址:www.csc108.com
(5) 天相投资顾问有限公司
注册地址: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
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座505
客户服务电话:010-66045678
联系人:谭磊
网址:jijin.txsec.com
(6) 长江证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市新华路特8号
法定代表人:尤习贵
办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
客户服务电话:95579或4008888999
联系人:奚博宇
网址:www.95579.com
(7) 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
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:单丙烨
客服电话:400-820-2899
公司网站: www.erichfund.com
二、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:010-50938782
传真:010-50938907
联系人:赵亦清
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:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:孙睿
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:薛竞、都晓燕
电话:(021) 23238888
传真:(021) 23238800
联系人:都晓燕

第四部分基金的名称

本基金名称:海富通季季增利理财债券型证券投资基金

第五部分 基金的类型

本基金类型:理财债券型证券投资基金(固定组合类)

第六部分 基金的投资目标

在力求基金资产安全性的基础上,通过合理的资产配置和个券选择,为投资者提供稳定的资产回报。

第七部分 基金的投资方向

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的固定收益类工具,具体包括现金,协议存款、通知存款、银行定期存款、大额存单,债券回购,短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、央行票据、金融债、地方政府债、次级债、中小企业私募债、中期票据、资产支持证券等,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,但需符合中国证监会的相关规定。

本基金不投资可转换债券,但可以投资分离交易可转债上市后分离出来的债券。未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单的,在履行适当程序后,本基金可参与同业存单的投资,不需召开基金份额持有人大会。

本基金将严格采用买入并持有策略,投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余运作期的固定收益类工具,并基本保持大类品种配置的比例恒定。

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,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

第八部分 基金的投资策略

本基金将以组合久期与运作期匹配作为基本原则,严格采用买入并持有策略,投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余运作期的固定收益类工具。

1、资产配置
本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析,对各类资产的利差水平进行判断,从而决定资产配置比例。
2、银行存款投资策略
在对银行存款利率深入分析的基础上,将对银行的信用等级等因素进行研究,在严控风险的前提下决定各银行存款的投资比例。
3、短期信用债投资策略
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,挑选期限适当的信用债券进行投资。
4、中小企业私募债的投资策略
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。
5、投资决策和程序
(1)决策依据
1)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。
2)宏观经济、微观经济运行状况,货币政策和财政政策执行状况,货币市场和证券市场运行状况;
3)分析师各自独立完成相应的研究报告,为投资策略提供依据。
(2)决策程序
1)投资决策委员会定期和不定期召开会议,根据基金投资目标和对市场的判断决定基金的总体投资策略,审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。
2)相关研究部门或岗位对宏观经济主要是利率走势等进行分析,提出分析报告。
3)基金经理根据投资决策委员会的决议,参考研究部门提出的报告,并依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险,制定具体资产配置和调整计划,进行投资组合的构建和日常管理。
4)交易部门依据基金经理的指令,制定交易策略并执行交易。
5)监察稽核部门负责监控基金的运作管理是否符合法律、法规及基金合同和公司相关管理制度的规定;风险管理部门运用风险监测模型以及各种风险监控指标,对市场预期风险进行风险测算,对基金组合的风险进行评估,提交风险监控报告;风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估与监控。

第九部分 基金的风险收益特征

本基金为理财债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益低于混合型基金和股票型基金。

第十部分 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。

基金托管人中国银行根据本基金合同规定,于2018年9月14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2018年6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	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	-	-
4	其他各项资产	-	-
5	合计	-	-

2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。
3 基金投资组合平均剩余期限
3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	-
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	-
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	-

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明
本报告期本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	-	-

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
6“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	-
报告期内偏离度的最低值	-
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	-

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。
8投资组合报告附注
8.1基金计价方法说明
2007 年7 月1 日基金实施新会计准则后,本基金所持有的债券(包括票据)采用摊余成本法进行估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。
8.2本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。
8.3本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。
8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	-

第十一部分基金的业绩

基金业绩截止日为2018年6月30日。

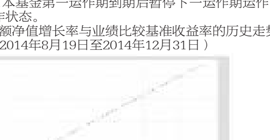
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本报告期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
自基金合同生效起至2014年12月31日	1.2829%	0.0027%	-	-	-	-

注:2014年12月23日,本基金第一运作期到期后暂停下一运作期运作。截至报告期末,本基金仍处于暂停运作状态。

(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:
(2014年8月19日至2014年12月31日)



注:1、本基金合同于2014年8月19日生效,按基金合同规定,本基金已在第一个运作期开始后的10个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二部分 (二)投资范围、(四)投资限制的有关规定。

2、2014年12月23日,本基金第一运作期到期后暂停下一运作期运作。截至报告期末,本基金仍处于暂停运作状态。

第十二部分基金的费用和税收

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、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、基金的开户费用、账户维护费用;
10、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0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×0.33%÷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
基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后, 由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.10%÷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
基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后, 由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。
3、基金份额的销售服务费
本基金基金份额的销售服务费按前一日基金份额基金资产净值的0.37%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.37%÷当年天数
H 为基金份额每日应计提的销售服务费
E 为基金份额前一日基金资产净值
基金销售服务费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构, 由登记机构代付给销售机构。
基金份额销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

上述“一、基金费用的种类中第4-10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、基金管理费、基金托管费、基金销售服务费的调整
基金管理人和基金托管人可协商一致,调低基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率,无须召开基金份额持有人大会。
五、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。

第十三部分 对招募说明书更新部分的说明

海富通季季增利理财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、“第三部分 基金管理人”:
1.更新了任志强先生、Marc Bayot(巴约特)先生、张馨先生、俞涛先生、奚万荣先生、陶网雄先生、陈轶平先生、谈云飞女士的简历。
2.增加了杨仓兵先生的简历。
3.删除了李础前先生、陈虹女士、章明女士的简历。
4.更新了投资决策委员会的相关信息。
5.更新了基金管理人的内部控制制度的相关信息。
二、“第四部分基金托管人”:更新了基金托管人的相关信息。
三、“第五部分 相关服务机构”:对基金份额其他销售机构的相关信息进行了更新。
四、“第十部分 基金的投资”,根据2018年第二季度报告,更新了基金投资组合报告的内容,相关数据截止日期为2018年6月30日。
五、“第十一部分 基金的业绩”,根据2018年第二季度报告,更新了基金业绩的内容,相关数据截止日期为2018年6月30日。

海富通基金管理有限公司
2018年9月29日

海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告

为满足广大投资者的理财需求, 经海富通基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)协商一致,决定于2018年10月1日00:00至2019年3月31日24:00期间,本公司旗下部分开放式基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动。

一、适用投资者范围
通过交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资指定开放式基金的个人投资者。
二、适用基金

序号	基金名称	基金代码
1	海富通中证100指数证券投资基金(LOF)(场内简称:海富100)	162307
2	海富通收益增长证券投资基金	519003
3	海富通股票混合型证券投资基金	519005
4	海富通强化回报混合型证券投资基金	519007
5	海富通精选证券投资基金	519011
6	海富通风格优势混合型证券投资基金	519013
7	海富通精选贰号混合型证券投资基金	519015
8	海富通稳健添利债券型证券投资基金A类份额	519024
9	海富通领先成长混合型证券投资基金	519025
10	海富通中小盘混合型证券投资基金	519026
11	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	519027
12	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	519032
13	海富通国策导向混合型证券投资基金	519033
14	海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金	519034
15	海富通安颐收益混合型证券投资基金A类份额	519050
16	海富通一年定期开放债券型证券投资基金A类份额	519051
17	海富通内需热点混合型证券投资基金	519056
18	海富通纯债债券型证券投资基金A类份额	519061
19	海富通富祥混合型证券投资基金	519134
20	海富通中国海外精选混合型证券投资基金	519601
21	海富通大中华精选混合型证券投资基金	519602
22	海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金	519139
23	海富通聚利纯债债券型证券投资基金	519220
24	海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金A类份额	519222
25	海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金A类份额	519224
26	海富通集利纯债债券型证券投资基金	519225
27	海富通瑞利纯债债券型证券投资基金	519226
28	海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金A类份额	519229
29	海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)	005220

三、活动内容
1、自2018年10月1日00:00至2019年3月31日24:00费率优惠活动期间,凡通过交通银行手机银行渠道申购上述开放式基金的个人投资者,享受基金申购手续费率1折优惠。
2、 通过交通银行手机银行渠道签约定期定额投资, 并于2018年10月1日00:00至2019年3月31日24:00期间成功扣款的定期定额交易,享受定期定额投资1折费率优惠。
3、原基金申购费率按笔收取固定费用的不再享有上述费率优惠。
4、上述开放式基金的原申购费率参见各基金的相关法律文件及本公司发布的最新相关公告。
四、重要提示
1、海富通稳健添利债券型证券投资基金A类份额、海富通一年定期开放债券型证券投资基金A类份额、海富通纯债债券型证券投资基金A类份额、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合证券投资基金A类份额、海富通欣荣灵活配置混合证券投资基金A类份额、海富通集利纯债债券型证券投资基金和海富通瑞利纯债债券型证券投资基金暂未开通定期定额投资业务。如有变化,请关注本公司最新业务公告。
2、海富通一年定期开放债券型证券投资基金A类份额的开放申购赎回安排和海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金的恢复申购安排请见本公司最新业务公告。
3、交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠仅针对处于正常申购期的指定开放式基金(前端模式)申购及定期定额投资手续费,不包括后端收费模式基金的申购及定期定额投资、处于基金募集期的开放式基金认购手续费。
客户通过柜面、网银等非手机银行渠道签约的定期定额投资在手机银行渠道费率优惠活动期间内的扣款不享受1折费率优惠。
4、如本公司新增通过交通银行销售的基金产品,其申购业务将同时享有上述费率优惠。
5、有关上述费率优惠活动的具体费率折扣及活动起止时间如有变化,敬请投资者留意交通银行的有关公告。
6、本活动的解释权归交通银行所有。
五、联系咨询
1、交通银行
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com
2、海富通基金管理有限公司
客户服务电话:40088-40099(免长途话费)
网站:www.hftfund.com
本公告的解释权归海富通基金管理有限公司。
特此公告。

海富通基金管理有限公司
2018年9月29日

海富通瑞利纯债债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2018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:交通银行股份有限公司
重要提示

本基金经2016年7月13日中国证券监督委员会证监许可【2016】1601号文准予注册募集。本基金的基金合同于2017年2月16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,并经中国证监会注册。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财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资者应充分考虑自身的风险承受能力,并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现, 基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,投资人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等信息披露文件, 自主判断基金的投资价值, 自主做出投资决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

本招募说明书所载内容截止日为2018年8月16日, 有关财务数据和净值表现截止日为2018年6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%、法国巴黎资产管理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。

任志强先生,董事,总经理,硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理,华宝信托投资有限责任公司研究发展中心总经理兼投资管理部总经理、华宝信托投资有限责任公司总裁助理兼董事会秘书,华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。华宝兴业基金管理有限公司基金经理、投资总监、副总经理,华宝兴业资产管理(香港)有限公司董事长。2017年6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。2018年3月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事长。

杨明先生,董事,管理学学士。历任中国人民银行新余支行科员,交通银行新余支行办公室科员、证券业务部负责人、证券业务部副主任、证券业务部主任,海通证券有限公司新余营业部总经理,海通证券股份有限公司江苏分公司筹备负责人、总经理、党委副书记,现任海通证券股份有限公司人力资源部总经理、党委组织部部长。

吴淑琨先生,董事,管理学博士。历任南京大学副教授,海通证券股份有限公司研究所宏观研究部经理、所长助理、机构业务部副总经理、企业及私人客户服务部副总主持、企业金融部总经理。现任海通证券股份有限公司战略发展部总经理。

Ligia Torres(陶乐斯)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月至今任法国巴黎资产管理公司亚太区CEO。

Alexandre Werno(韦历山)先生, 董事,法国籍 ,金融硕士学位。2007年9月至2013年4月在法国兴业投资银行全球市场部任执行董事、中国业务开发负责人职务;2013年5月至2017年11月先后任华宝兴业基金管理有限公司总经理高级顾问、常务副总经理职务;2017年11月至今任法国巴黎资产管理亚洲有限公司亚太区战略合作总监。

郑国汉先生,独立董事,美国籍,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。

Marc Bayot(巴约特)先生,独立董事,比利时籍,布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学金融学荣誉教授,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,Degroof资产管理(布鲁塞尔) 独立董事, 现任 Pioneer投资公司(米兰, 都柏林, 卢森堡) 独立董事、Fundconnect独立董事长和法国巴黎银行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。

张馨先生,独立董事,博士。历任厦门大学经济学院财金系教授及博士生导师、副院长兼系主任、厦门大学经济学院院长。2011年1月至今退休。

杨仓兵先生,监事长,管理学学士。历任安徽省农业科学院计财科副科长,安徽示康药业有限公司财务部干部、经理,海通证券股份有限公司计划财务部干部、计划资金部资金科科长、计划资金部总经理助理、计划资金部副总经理,上海海振实业发展有限公司总经理,海通证券股份有限公司计划财务部副总经理。自2015年10月至今任海通证券股份有限公司资金管理总部总经理。

Bruno Weil(魏海诺)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月加入海富通基金管理有限公司,历任产品与创新总监。2015年12月起任海富通基金管理有限公司总经理助理。

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。2015年7月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司监事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

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。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

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。

陈轶平先生,博士,CFA。历任Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理(上海)有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事,2011年10月加入海富通基金管理有限公司,历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监,现任固定收益投资副总监。2013年8月起任海富通货币基金经理。2014年8月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014年11月起兼任海富通上证可质押城投债ETF基金经理。2015年12月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015年12月至2017年9月兼任海富通稳进增利债券(LOF)基金经理。2016年4月起兼任海富通一年定开债券基金经理。2016年7月起兼任海富通富祥混合基金经理。2016年8月起兼任海富通瑞丰一年定开债券基金经理。2016年8月至2017年11月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016年11月起兼任海富通美元债(QDII)基金经理。2017年1月起兼任海富通上证周期产业债ETF基金经理。2017年2月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017年3月至2018年6月兼任海富通富源债券基金经理。2017年3月起兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017年5月起兼任海富通富睿混合基金经理。2017年7月起兼任海富通欣悦混合、海富通瑞福一年定开债券、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018年4月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。

刘田女士,管理学学士,曾任上海银行同业客户经理,2016年4月加入海富通基金管理有限公司,2017年2月起任海富通瑞利债券的基金经理助理。

投资决策委员会常设委员有:任志强,总经理;胡光涛,总经理助理;王智慧,总经理助理;孙海忠,总经理助理兼固定收益投资总监;杜晓海,量化投资部总监;王金祥,研究部总监;陈轶平,固定收益投资副总监;赵赫,年金权益投资总监。投资决策委员会主席由总经理担任。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
(一)基金托管人概况
公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人:彭纯
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
邮政编码:200120
注册时间:1987年3月30日
注册资本:742.62亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号
联系人:陆志俊
电话:95559

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:暴潇菡
电话:021-38650797
传真:021-33830160
2、其他销售机构
(1) 交通银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:彭纯
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
客户服务电话:95559
联系人:王菁
网址:www.bankcomm.com
(2) 申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
客户服务电话:95523或4008895523
联系人:陈飙
网址:www.swhysc.com
(3) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层
地址:上海市徐汇区徐家汇街道宛平南路88号金座26楼
法定代表人:其实
客户服务电话:400-1818-188
联系人:王超
网址: www.1234567.com.cn
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:010-50938782
传真:010-50938907
联系人:赵亦清
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:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:陈颖华
经办律师:孙睿、陈颖华
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:薛竞、都晓燕
电话:(021) 23238888
传真:(021) 23238800
联系人:都晓燕

四、基金的名称

本基金的名称:海富通瑞利纯债债券型证券投资基金

五、基金的类型

基金类型:契约型、开放式

六、基金的投资目标

在严格控制风险的基础上,追求基金资产长期稳定增值,力争实现高于业绩比较基准的投资收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款等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的相关规定)。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

八、基金的投资策略

一、投资策略
1、资产配置策略
本基金为债券型基金,对债券的投资比例不低于基金资产的80%。 在此约束下,本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析,对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪,从而决定其配置比例。
2、债券类属资产配置
类属配置包括国债、金融债、企业债等固定收益品种之间的配置。本基金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。类属配置主要根据各部分的利差的扩大及收窄分析,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。
3、债券投资组合策略
债券投资主要采取利率策略、信用策略、收益率曲线策略以及杠杆策略,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。
(1)利率策略
利率策略主要是根据对宏观经济环境判断,预测市场利率水平变动趋势,以及收益率曲线变化趋势,从而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)信用策略
信用策略主要是根据不同信用等级资产的相对价值, 确定资产在不同债券类属之间的配置,并通过对债券的信用分析,确定信用债的投资策略。本基金将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)收益率曲线策略
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。
(4)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。
4、中小企业私募债券投资策略
与传统的信用债相比,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,本基金会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。
5、资产支持证券投资策略
对于包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等在内的资产支持证券,本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等因素,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。
二、投资决策和程序
1、决策依据
(1)投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定;
(2)投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比;
(3)投资部策略分析师、股票分析师、固定收益分析师各自独立完成相应的研究报告,为投资策略提供依据。
2、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管理模式。投资决策委员会定期或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)投资部门负责人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)定期不定期召开部门例会,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)基金经理在投资部门负责人授权下,根据部门例会所确定的资产/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的基础上,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)风险管理部负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。
(8)风险管理部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、基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率。

中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成, 中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标,为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价, 能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

本基金选择上述业绩比较基准的原因为本基金是通过债券等固定收益资产来获取的收益,力争获取相对稳健的绝对回报,追求委托财产的保值增值。

若未来法律法规发生变化,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,或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则, 在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后,适当调整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, 预期收益和预期风险高于货币市场基金, 但低于混合型基金、股票型基金,属于较低风险/收益的产品。

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年9月14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2018年6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	3,430,203,166.30	96.21
	其中:债券	3,160,023,166.30	88.63
	资产支持证券	270,180,000.00	7.58
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	71,730,547.60	2.01
	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	13,946,530.17	0.39
7	其他资产	49,402,235.71	1.39
8	合计	3,565,282,479.78	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股通股票。
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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	348,894,000.00	10.69
	其中:政策性金融债	348,894,000.00	10.69
4	企业债券	625,158,166.30	19.16
5	企业短期融资券	641,771,000.00	19.67
6	中期票据	1,139,304,000.00	34.91
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	404,896,000.00	12.41
9	其他	-	-
10	合计	3,160,023,166.30	96.83

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	136510	16华电01	1,674,990	164,768,766.30	5.05
2	136459	16上港02	1,480,000	145,750,400.00	4.47
3	111809076	18浦发银行CD076	1,500,000	145,245,000.00	4.45
4	101551061	15中石油MTN001	1,300,000	130,156,000.00	3.99
5	170410	17农发10	1,200,000	120,036,000.00	3.68

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1889074	18建元7A1_bc	3,000,000	270,180,000.00	8.28

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18浦发银行CD076(111809076)的发行人于2018年1月19日公告称,因公司成都分行内控管理严重失效,授信管理违规,违规办理信贷业务等行为严重违反审慎经营规则,收到四川银监局的行政处罚决定书,被执行罚款46,175万元人民币,同时相关责任领导受到禁止终身从事银行业工作、取消高级管理人员任职资格、警告及罚款等处罚。
对该证券的投资决策程序的说明:2017年以来同业存单收益处于较高水平,信用风险很低,剩余期限较短,是理想的配置资产。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程,该证券被纳入本基金的实际投资组合。
其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
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	53,613.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	49,348,621.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,402,235.71

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
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

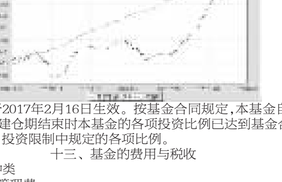
基金业绩截止日为2018年6月30日。

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
2017年2月16日(基金合同生效日)-2017年12月31日	3.17%	0.02%	0.47%	0.06%	2.70%	-0.04%
2018年1月1日-2018年6月30日	2.48%	0.03%	4.35%	0.08%	-1.87%	-0.05%
2017年2月16日(基金合同生效日)-2018年6月30日	5.72%	0.02%	4.84%	0.07%	0.88%	-0.05%

二、本基金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
(2017年2月16日至2018年6月30日)



注:本基金合同于2017年2月16日生效。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。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分(二)投资范围、(四)投资限制中规定的各项比例。

十三、基金的费用与税收

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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金的账户开户费用、账户维护费用;
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0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×0.3%÷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,由基金管理人与基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5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、公休假或不可抗力等,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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.10%÷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,由基金管理人与基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等,支付日期顺延。
上述“一、基金费用的种类”中第3-9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。
3、证券账户开户费用:证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后,自产品成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付, 如基金财产余额不足支付该开户费用,由基金管理人于产品成立一个月后的5个工作日内进行垫付,基金托管人不承担垫付开户费用义务。
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

海富通瑞利纯债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》、《公开募集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、“一、绪言”部分,增加了《流动性规定》的相关信息;
二、“二、释义”,增加了对部分词语或简称的解释;
三、“三、基金管理人”部分:
1.更新了任志强先生、Marc Bayot(巴约特)先生、张馨先生、俞涛先生、奚万荣先生、陶网雄先生、陈轶平先生的简历。
2.增加杨仓兵先生的简历。
3.删除了李础前先生、陈虹女士、章明女士的简历。
4.更新了投资决策委员会的相关信息。
5.更新了基金管理人内部控制制度相关信息。
四、“四、基金托管人”部分,更新了基金托管人的相关信息。
五、“五、相关服务机构”部分,对基金份额发售机构的相关信息进行了更新。
六、“八、基金份额的申购与赎回”部分,更新了申购和赎回的数量限制、申购费用和赎回费用、拒绝或暂停申购的情形、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形、巨额赎回的情形及处理方式的相关信息。
七、“九、基金的投资”部分,更新了投资范围、投资限制的相关信息,并根据2018年第二季度报告, 更新了基金投资组合报告的内容, 相关数据截止日期为2018年6月30日。
八、“十、基金的业绩”部分,根据2018年第二季度报告,更新了基金业绩的内容,相关数据截止期为2018年6月30日。
九、“十二、基金资产的估值”部分,更新了估值方法、暂停估值的情形的相关信息。
十、“十六、基金的信息披露”部分,更新了公开披露的基金信息的相关信息。
十一、“十七、风险提示”部分,增加了流动性风险评估方面的相关内容。
十二、“二十、基金托管协议的内容摘要”部分,更新了“二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查”中的相关信息。

海富通基金管理有限公司
2018年9月29日