海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要

（2018年第1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

本基金经2017年7月13日中国证券监督委员会证监许可【2017】1237号文准予注册募集。本基金的基金合同于2018年4月8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。

海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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。

本基金单一投资者(基金管理人或其高级管理人员、基金经理作为发起资金提供方的除外)持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本招募说明书所载内容截止日为2018年10月8日,有关财务数据和净值表现截止日为2018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:吴晨鸢

注册资本:15亿元人民币

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 Wemo(韦历山)先生, 董事,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,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。

俞海先生,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。

杜晓海先生, 硕士。历任Man-Drapeau Research金融工程师,American Bourses Corporation中国区总经理,海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监,现任海富通基金管理有限公司量化投资部总监。2016年6月起任海富通新内需混合和海富通安顺收益混合 (原海富通养老收益混合)基金经理。2016年9月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017年4月至2018年1月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017年5月起兼任海富通富睿混合基金经理。2018年3月起兼任海富通富祥混合基金经理。2018年4月至2018年7月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018年4月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强、海富通量化前锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合、海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。

朱斌全先生,理学硕士。历任上海涅柔斯投资管理有限公司美国股票交易员。2007年4月加入海富通基金管理有限公司,历任交易员,高级交易员,量化分析师,量化投资部投资经理。2018年5月起任海富通创业板增强的基金经理助理。

本基金历任基金经理为:陈甄璞先生,任职时间为2018年4月至2018年5月;

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。

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:易会满

注册资本:人民币35,640,625.71万元

联系电话:010-66105799

联系人:郭明

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:暴蕾蕾

电话:021-38650797

传真:021-33830160

2、其他销售机构

(1)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

法定代表人:易会满

办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

客户服务中心电话:95588

联系人:刘秀宇

网址:www.icbc.com.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)安信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人:王连志

办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

客户服务电话:4008001001

联系人:陈剑虹

网址:www.essence.com.cn

(4)渤海证券股份有限公司

注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

法定代表人:王春峰

办公地址:天津市南开区宾水西道8号

客户服务电话:4006515988

联系人:王星

网址:www.ewww.com.cn

(5)财富证券有限责任公司

注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层

法定代表人:蔡一兵

办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层

客户服务电话:95317或4008835316

联系人:郭磊

网址:www.cfzq.com

(6)长城证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17层

法定代表人:丁益

办公地址:广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

客户服务电话:4006666888

联系人:金夏

网址:www.cgws.com

(7)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

(8)第一创业证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

法定代表人:刘学民

办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

客户服务电话:95358

联系人:李晓伟

网址:www.firstcapital.com.cn

(9)东北证券股份有限公司

注册地址:长春市生态大街6666号

法定代表人:李福春

办公地址:长春市生态大街6666号

客户服务电话:95360

联系人:安岩岩

网址:www.nesc.cn

(10)光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:周健男

办公地址:上海市静安区新闸路1508号

客户服务电话:95525

联系人:姚巍

网址:www.ebscn.com

(11)广州证券股份有限公司

注册地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人:胡伏云

办公地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

客户服务电话:95396

联系人:林洁茹

网址:www.gzs.com.cn

(12)国都证券股份有限公司

注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

客户服务电话:4008188118

联系人:黄静

网址:www.guodu.com

(13)国金证券股份有限公司

注册地址:四川省成都市东城根上街95号

法定代表人:冉云

办公地址:四川省成都市东城根上街95号

客户服务电话:95310

联系人:刘婧漪、贾鹏

网址:www.gjzq.com.cn

(14)国联证券股份有限公司

注册地址:无锡市金融一街8号

法定代表人:姚志勇

办公地址:无锡市金融一街8号国联金融大厦

客户服务电话:95570

联系人:祁昊

网址:www.glsc.com.cn

(15)申万宏源西部证券有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人:韩志谦

办公地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

客户服务电话:4008000562

联系人:王怀春

网址:www.hysec.com

(16)华龙证券股份有限公司

注册地址:兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼

法定代表人:李晓安

办公地址:兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼

客户服务电话:95368

联系人:范坤

网址:www.hlzq.com

(17)平安证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人:刘世安

办公地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

客户服务电话:95511-8

联系人:周驰

网址:stock.pingan.com

(18)中泰证券股份有限公司

注册地址:济南市市中区经七路86号

法定代表人:李玮

办公地址:山东省济南市市中区经七路86号

客户服务电话:95538

联系人:许曼华

网址:www.zts.com.cn

(19)上海证券有限责任公司

注册地址:上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人:李俊杰

办公地址:上海市黄浦区四川中路213号7楼

客户服务电话:4008918918

联系人:邵珍珍

网址:www.shzq.com

(20)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

(21)世纪证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层

法定代表人:姜昧军

办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层

客户服务电话:4008323000

联系人:王雯

网址:www.csco.com.cn

(22)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

(23)中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层

法定代表人:陈共炎

办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

客户服务电话:4008888888或95551

联系人:辛国政

网址:www.chinastock.com.cn

(24)招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38至45层

法定代表人:霍达

办公地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

客户服务电话:95565

联系人:林生迎

网址:www.newone.com.cn

(25)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

(26)中信证券(山东)有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法定代表人:姜晓林

办公地址:青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

客户服务电话:95548

联系人:刘晓明

网址:www.zxwt.com.cn

(27)中信证券股份有限公司

注册地址: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:张佑君

办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

客户服务电话:95548

联系人:王一通

网址:www.cs.ecitic.com

(28)华西证券股份有限公司

注册地址:成都市高新区天府二街198号

法定代表人:杨炯洋

办公地址:成都市高新区天府二街198号

客户服务电话:95584

联系人:谢国梅

网址:www.hx168.com.cn

(29)中信期货有限公司

注册地址: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13层1301-1305、14层

法定代表人:张皓

办公地址: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13层1301-1305室、14层

客户服务电话:4009908826

联系人:刘宏莹

网址:www.citicsf.com

(30)天风证券股份有限公司

注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼

法定代表人:余磊

办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼

客户服务电话:93391或4008005000

联系人:岑妹妹

网址:www.tfzq.com

(31)大同证券有限责任公司

注册地址:山西省大同市城区迎宾街15号桐城中央21层

法定代表人:董祥

办公地址:山西省太原市小店区长治路世贸中心12层

客户服务电话:4007121212

联系人:薛津

网址:www.dtsbc.com.cn

(32)开源证券股份有限公司

注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

法定代表人:李刚

办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

客户服务电话:95325或4008608866

联系人:袁伟涛、曹欣

网址:www.kysec.cn

(33)中天证券股份有限公司

注册地址:沈阳市和平区光荣街23甲

法定代表人:马功勋

办公地址:沈阳市和平区光荣街23甲

客户服务电话:95346

联系人:孙丹华

网址:www.iztzq.com

(34)东海证券股份有限公司

注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

法定代表人:赵俊

办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

客户服务电话:95531或4008888588

联系人:王一彦

网址:www.longone.com.cn

(35)深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801

办公地址: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

(36)网址:www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com上海好买基金销售有限公司

注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

地址:上海浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦10层

法定代表人:杨文斌

客户服务电话:400-700-9665

联系人:陆敏

网址:www.howbuy.com

(37)诺亚正行基金销售有限公司

注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

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:余翼飞

网址:www.noah-fund.com

(38)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

(39)和讯信息科技有限公司

注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号1002室

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:刘洋

网址:licaike.hexun.com

(40)北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼32层3201内3212、3211单元

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:400-818-000

联系人:罗恒

网址:www.myfund.com

(41)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址:杭州市文二西路1号903室

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:董一峰

网址:www.5ifund.com

(42)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址:深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006室

法定代表人:陈操

客户服务电话:400-850-7771

联系人:文雯

网站:http://www.bdcgw.cn

(43)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

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:陈东

网址:www.66zichan.com

(44)上海基煜基金销售有限公司

注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)

地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)

法定代表人:王翔

客服电话:400-820-5369

联系人:李鑫

网址:www.jiyufund.com.cn

(45)珠海盈米财富管理有限公司

注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

法定代表人:肖雯

客服电话:020-89629066

联系人:吴煜浩

网址:www.yingmi.cn

(46)上海陆金所基金销售有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元

地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

法定代表人:郭坚

客服电话:4008 6666 18

联系人:程晨

网址:https://www.lu.com

(47)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

法定代表人:沈伟桦

客服电话:400-6099-200

联系人:刘梦轩

网址:http://www.yixinfund.com/

(48)中证金牛(北京)投资咨询有限公司

注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

法定代表人:彭运年

客服电话:4008-909-998

联系人:王莅晨

网址:http://www.jnlc.com/

(49)奕丰基金销售有限公司

注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)

地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)

法定代表人:TAN YIK KUAN

客服电话:400-684-0500

联系人:叶健

网址:www.ifastps.com.cn

(50)北京汇成基金销售有限公司

注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108号

地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人:王伟刚

客服电话:400-619-9059

联系人:丁向坤

网址:www.hcjijin.com

(51)北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

法定代表人:李昭琛

客服电话:010-62675369

联系人:吴翠

网址:http://finance.sina.com.cn/fund/

(52)北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

法定代表人:江卉

客服电话:95118 / 400-098-8511

联系人:韩锦星

网址:京东金融APP

(53)凤凰金信(银川)投资管理有限公司

注册地址:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公用房

地址:北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园18号楼

法定代表人:程刚

客服电话:400-810-5919

联系人:王鹤敏

网址:www.fengfd.com

(54)南京苏宁基金销售有限公司

注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号

地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号

法人代表:钱燕飞

客服电话:95177

联系人:喻明明

网址:www.snjijin.com

(55)北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法人代表:钟斐斐

客服电话:4000-618-518

联系人:候芳芳

网址:www.danjuanapp.com

(56)中民财富基金销售(上海)有限公司

注册地址:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元

地址:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元

法人代表:弭洪军

客服电话:400-876-5716

联系人:黄鹏

网址:www.cmiwm.com

(57)上海万得基金销售有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座

地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座

法人代表:王廷富

客服电话:400-821-0203

联系人:徐亚丹

网址:www.520fund.com.cn

(58)北京植信基金销售有限公司

注册地址:北京市密云县盛南路8号院2号楼106室

地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号

法人代表:于龙

客服电话:4006-802-123

联系人:吴鹏

网址:www.zhixin-inv.com

(59)上海挖财基金销售有限公司

注册地址:杭州华星路96号互联网金融大厦19楼

地址:上海陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼5楼

法人代表:冷飞

客服电话:400-711-8718

联系人:孙琦

网址:挖财宝APP

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:黎明、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:海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金

五、基金的类型

基金类型:契约型、开放式

六、基金的投资目标

本基金为增强型股票指数基金,通过数量化的投资策略模型精选创业板优质股票,力争将本基金净值增长率与业绩基准涨跌幅的日均偏离度控制在0.5%以内、年化跟踪误差控制在7.5%以内,同时力求使基金的业绩超越创业板综合指数表现。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,股票资产投资比例不低于基金资产的90%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%;本基金在每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

如以后法律法规及中国证监会允许基金投资上述品种之外的其他金融工具,本基金可以依照法律法规或监管机构的规定,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

一、投资策略

本基金为增强型指数基金,对指数投资部分将采用抽样复制标的指数投资方法,利用成熟的量化技术模型实现对创业板综合指数的紧密跟踪。本基金对主动投资部分采取积极配置策略,力争在跟踪误差控制范围内,使基金的业绩超越创业板综合指数表现。

当成份股发生分红、配股、增发等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1、资产配置

股票资产投资比例不低于基金资产的90%, 投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%;基金管理人将综合考虑股票市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。

本基金将根据市场的实际情况, 在基金合同规定的范围内适当调整主动投资部分基金资产的配置比例,以争取实现对标的指数的超越。

2、股票组合构建

对指数投资部分,结合指数的特点,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素,运用成熟的量化技术模型,采用抽样复制的方法,在创业板综指成份股内从长期和短期两个维度动态刻画指数风格特征,构建风格中性和行业中性的投资组合,从而实现对指数的紧密跟踪。但是当以下情况发生时,基金管理人将对投资组合进行适当调整,以实现本基金对业绩比较基准的紧密跟踪:(1)基金管理人预期指数成份股或权重发生变化;(2)由于市场因素影响、法律法规限制等原因,本基金无法根据指数构建组合;(3)基金发生申购赎回、成份股派发现金股息等可能影响跟踪效果的情形。

对主动投资部分,本基金采用动量多因子选股模型监控市场风格,从风格动量延续的角度构建组合,实现相对创业板综指的收益增强。

3、股票组合调整

在基金运作过程中,当发生以下情况时,基金管理人将对投资组合进行调整,以降低跟踪误差,实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

(1)指数编制方法发生变更。基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股及权重的影响,适时进行投资组合调整。

(2)指数成份股定期或临时调整。基金管理人将预测指数成份股调整方案,并判断指数成份股调整对投资组合的影响,在此基础上确定组合调整策略。

(3)指数成份股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等情形。基金管理人将密切关注这些情形对指数的影响,并据此确定相应的投资组合调整策略。

(4)基金发生申购赎回、参与新股申购等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪效果的影响,据此对投资组合进行相应调整。

(5)法律法规限制、股票流动性不足、股票停牌等因素导致基金无法根据指数建立组合。基金管理人将根据市场情况,以跟踪误差最小化为原则对投资组合进行调整。

(6)根据主动增强策略,对增强部分头寸进行主动性的调整,在控制跟踪误差原则下,增强组合收益。

4、债券投资策略

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。另外,本基金债券投资将适当运用杠杆策略,通过债券回购融入资金,然后买入收益率更高的债券以获得收益。

5、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。

6、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征,选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

7、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,本基金将在控制风险的前提下,以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上适当参与。

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、固定收益分析师、定量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、定量分析师量化模型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证券配置。

(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、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:

创业板综合指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率×5%(税后)

创业板综合指数反映了在深圳证券交易所创业板上市的全部股票的价格综合变动情况以及市场总体走势,为市场提供了全面而客观的业绩衡量基准和投资参考工具。由于本基金投资标的指数为创业板综合指数,且每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,投资于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5%,因此,本基金将业绩比较基准定为创业板综合指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率×5%(税后)。

本基金的标的指数是创业板综合指数。

本基金标的指数变更的,相应更换基金名称和业绩比较基准,并在报中国证监会备案后及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年11月6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