海富通稳进增利债券型证券投资基金（LOF）
（由海富通稳进增利分级债券型证券投资基金封闭期届满转换而来）更新招募说明书摘要

（2014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：中国建设银行股份有限公司

重要提示

海富通稳进增利分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2011年6月9日中国证券监督管理委员会证监许可【2011】907号文核准募集。本基金的基金合同于2011年9月1日正式生效。本基金类型为契约型。根据基金合同的有关规定，海富通稳进增利分级债券型证券投资基金的基金合同生效后三年期届满，无需召开基金份额持有人大会，已转换为上市开放式基金（LOF），基金名称已变更为“海富通稳进增利债券型证券投资基金（LOF）”，基金代码为：“162308”，基金简称为“海富通稳进增利债券（LOF）”，增利A、增利B的基金份额已转换为上市开放式基金（LOF）份额。

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。

本基金主要投资于债券等固定收益类证券，还可以投资于股票等权益类证券，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。本基金为债券型基金，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高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。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2014年9月1日，有关财务数据和净值表现截止日为2014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
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
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。

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，现任南京银行副行长。

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内部审计。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任稽核经理、监察稽核总监，现任总经理助理兼上海富诚海富通资产管理有限公司监事。

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月起任海富通基金管理有限公司基金运营总监，现任总经理助理兼上海富诚海富通资产管理有限公司中后台运营总监。

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。

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月加入海富通基金管理有限公司，历任固定收益分析师、基金经理、固定收益组合管理部总监、投资副总监，现任总经理助理。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，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。

本基金历任基金经理为张丽洁女士，任职时间为2011年9月至2013年1月。

投资决策委员会常设委员有：田仁灿，总经理；戴德舜，投资总监；邵佳民，总经理助理；丁俊，投资副总监；杜晓海，定量及风险管理总监，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、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
住所：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
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号
联系人：田青
联系电话：(010) 6759 5096

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
传真：021-33830160

2、场外销售机构

（1）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

（2）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

（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：李建红
客户服务电话：95555
联系人：邓炯鹏
网址：www.cmbchina.com

（7）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

（8）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/

（9）上海浦东发展银行股份有限公司
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

（10）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

（11）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：95553或4008888001
联系人：李笑鸣
网址：www.htsec.com

（12）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

（13）财通证券股份有限公司
地址：杭州杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人：沈继宁
客户服务电话：96336（浙江），40086-96336（全国）
联系人：夏吉慧
网址：www.ctsec.com

（14）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

（15）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：杨泽柱
客户服务电话：95579
联系人：李良
网址：www.95579.com

（16）德邦证券有限责任公司
住所：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

（17）第一创业证券股份有限公司
地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人：刘学民
客户服务电话：4008881888
联系人：毛诗莉
网址：http://www.fcsc.com

（18）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

（19）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

（20）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：薛峰
客户服务电话：95525
联系人：刘晨、李芳芳
网址：www.ebscn.com

（21）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

（22）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

（23）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

（24）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：万建华
客户服务电话：95521
联系人：李良
网址：www.gtja.com

（25）宏源证券股份有限公司
注册地址：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：400-800-0562
联系人：李巍
网址：www.hysec.com

（26）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：刘闻川
网址：www.cnhbstock.com

（27）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：http://www.hlzqgs.com

（28）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

（29）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：张背北
客服电话：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn

（30）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：http://stock.pingan.com/

（31）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
客户服务电话：95538
联系人：孙蒙志
网址：www.qlzq.com.cn

（32）日信证券有限责任公司
地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人：孔佑杰
客户服务电话：010-88086830
联系人：陈文彬
网址：www.rxzq.com.cn

（33）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

（34）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

（35）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：宋明
网址：www.chinastock.com.cn

（36）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

（37）中航证券有限公司
地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人：王宜四
客服电话：4008866567
联系人：戴蕾
网址：www.scstock.com

（38）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

（39）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/

（40）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

（41）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：http://www.cs.ecitic.com/

（42）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：姚锋
网址：www.bigsun.com.cn

（43）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

（44）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26－28层
法定代表人：蔡一兵
电话：0731－84403360
传真：0731－84403330
联系人：郭磊
网址：www.cfzq.com

（45）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：杨树财
客户服务电话：4006000686
联系人：潘锴
网址：www.nesc.cn

（46）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

（47）国元证券股份有限公司
地址：安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人：蔡咏
客户服务电话：95578
联系人：李蔡
网址：www.gyzq.com.cn

（48）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

（49）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：黄莹
网址：www.sywg.com

（50）世纪证券有限责任公司
地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人：姜昧军
电话：0755-83199599
联系人：张婷
网址：www.csco.com.cn

（51）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

（52）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：http://www.mszq.com/

（53）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：周志茹
网址：www.hx168.com.cn

（54）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.jjmmw.com

（55）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

（56）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：阚迪
网址：www.ehowbuy.com

（57）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：王艳萍
客服电话：400-089-1289
公司网站：www.erichfund.com

（58）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

（59）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：纳小丹
网址：www.1234567.com.cn

（60）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：于杨
网址：licaike.hexun.com

（61）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：宋丽冉
网址：www.myfund.com

（62）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

（63）万银财富（北京）基金销售有限公司
地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内
法定代表人：李招弟
客户服务电话：400-808-0069
联系人：高晓芳
网址：www.wy-fund.com

3、场内销售机构

场内销售机构：本基金办理场内认购、申购和赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

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
住所：北京西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
电话：010-50938835
传真：010-50938907
联系人：任瑞新

（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：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

本基金名称：海富通稳进增利分级债券型证券投资基金（三年封闭期届满转换为上市开放式基金（LOF）后，基金名称变更为：海富通稳进增利债券型证券投资基金（LOF））

五、基金的类型

基金类型：上市契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金在控制风险和保持资产适当流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。

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，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、货币市场工具、权证、资产支持证券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（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金封闭期内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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类证券，投资于股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）等权益类证券的比例不超过基金资产的20%，且权证投资不超过基金资产净值的3%。本基金封闭期结束转换为上市开放式基金（LOF）后，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%，投资于股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）等权益类证券的比例不超过基金资产的20%、权证投资不超过基金资产净值的3%，且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

1、资产配置策略

本基金为债券型基金，对债券类资产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、金融货币政策和利率趋势的判断，对固定收益类资产、权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。固定收益类资产中，本基金将采取久期管理、收益率曲线策略、类属配置等积极投资策略，在不同券种之间进行配置。

2、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、套利策略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、中、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。

（4）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。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、信用类债券投资策略

信用类债券投资策略是一种自上而下的利率风险管理与自下而上的信用风险管理相结合的策略，是本基金的重要投资策略。

本基金将通过定性与定量相结合的信用评级体系，评估企业及企业所属行业的发展前景、企业现金流状况及偿债能力、企业在不同经济周期收益率及违约率变化情况等，对信用债券进行信用评级，以决定不同行业或企业信用类债券的投资比例。同时，根据信用评价体系，将对债券发行人的信用风险进行评估。

4、可转债投资策略

本基金的可转债的投资将基于三个方面的分析：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。

5、股票投资策略

股票投资将积极参与新股申购，同时通过灵活的仓位控制，精选个股进行二级市场投资。

（1）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。

（2）个股精选策略

本基金通过个股精选策略，从定量分析及定性分析两方面分析股票的价值及成长能力，综合考虑公司所在行业景气度、公司发展战略、公司竞争优势、公司治理等因素，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进行投资。

6、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。

7、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、业绩比较基准

本基金业绩比较基准=中证全债指数×90%＋沪深300 指数×10%

本基金债券部分的业绩比较基准为中证全债指数，该指数是中证指数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，也是中证指数公司编制并发布的首只债券类指数。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。该指数于2007年12月17日正式发布，基日为2002年12月31日，基点为100点。

本基金股票部分的业绩比较基准为沪深300指数，沪深300指数由中证指数有限公司编制和发布，是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。该指数以成份股的自由流通市值进行加权，指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性和市场影响力。

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、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较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

从本基金的两类基金份额来看，由于本基金资产及收益的分配安排，增利A 份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征；增利B份额则表现出较高风险、收益相对较高的特征。

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年9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2014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	255,935,723.22	92.19
	其中：债券	255,935,723.22	92.19
	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	10,000,000.00	3.60
	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	1,351,070.54	0.49
7	其他资产	10,336,479.86	3.72
8	合计	277,623,273.62	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. 报告期末按券种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	3,024,000.00	1.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	179,328,373.22	66.07
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	73,583,350.00	27.11
8	其他	-	-
9	合计	255,935,723.22	94.29

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	124351	13京州债	240,000	23,373,600.00	8.61
2	111051	09怀化债	199,720	21,250,208.00	7.83
3	1280030	12丹投债	200,000	20,922,000.00	7.71
4	122661	12怀化债	198,540	20,846,700.00	7.68
5	122840	11临汾债	200,000	20,700,000.00	7.63

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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合约。

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 本基金投资国债期货的投资政策

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 本基金投资国债期货的投资评价

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石化转债（110015）于2014年1月13日公告，国务院对山东省青岛市“11.22”中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告作出批复，同意国务院事故调查组的调查处理结果，认定是一起特别重大责任事故；公司及