

海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

2017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:交通银行股份有限公司

重要提示

本基金经2016年7月20日中国证监会证监许可【2016】1647号文准予注册募集。本基金的基金合同于2016年11月11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、承担责任。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。

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,投资人认购(或申购)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。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。

本基金投资相关股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”的),将承担汇率风险以及境外市场的风险。

本招募说明书所载内容截止日为2017年5月11日,有关财务数据和净值表现在此之后不再更新。

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:吴晨霞

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(原法国巴黎投资管理BE控股公司)49%。

(二)主要人员情况

张伟文先生,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、私人金融处主任,海通证券办公室主任,海通证券投资银行总部副经理,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。2017年2月起代行总经理职责。

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经济研究室经理、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。

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务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控有限公司董事,2013年7月至今任法国巴黎资产管理(原:法国巴黎投资管理)公司亚太区CEO。

黄金源(Alex NC Kim Guan)先生,董事,马来西亚国籍,文学学士,历任荷兰通用投资银行新加坡代表处客服主任,荷兰通用资本市场远东区域香港公司证券部经理,法国巴黎资产管理(原:法国巴黎投资管理)亚洲有限公司董事,现任法国巴黎资产管理(原:法国巴黎投资管理)亚洲有限公司亚太区投资总监。

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、商学院副院长及经济系讲授教授。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,Degroff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、上海大舅立股有限公司董事长。

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。

李瑞前先生,独立董事,高级经济师。历任安徽省政府厅企处主任科员,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、亚洲金融机构行业务负责人、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,2015年12月起兼任海富通基金管理有限公司总经理助理。

陈虹女士,监事,法学士。历任香港的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。2014年7月至2016年1月任海富通基金管理有限公司高级法务经理,现任海富通基金管理有限公司法务总监。

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,稽核稽核总监,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。2016年12月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。

陶雄伟先生,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。

(1)公司质地分析包括公司治理与管理层、公司的品牌和商誉、公司的盈利能力和平公司的现金流评估、公司战略等。

(2)增长前景分析包括定性分析公司的盈利增长和竞争优势的可持续性,定量分析EPS增长率、PEG等成长性指标等。

(3)估值水平分析既包括分析P/E(预期)、P/B、PCF、PFCF、相对于NAV的溢/折价、DDM、ROE等指标,也注重该指标与历史、行业和国际市场

(4)市场因素分析包括个股技术面分析、资金流向、国际和行业影响等,此外还包括该上市公司与A股上市公司相比的投资标的的稀缺性和独特性等。

(三)债券投资策略

债券投资采取“自上而下”的策略,深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以价值发现为基础,在市场创新和变化中寻找投资机会,采取利率预测、久期管理、收益率曲线策略、收益率差策略和套利等积极投资管理方式,确定和构造合理的债券组合。

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。

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。

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、收益率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。

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重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。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企业的基本面,所处行业、资产质量状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等因素,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。

(四)资产支持证券投资策略

对于资产负债率低的上市公司,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。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

1.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:牛锡明

住所:上海市浦东新区银城中路188号

办公地址:上海市浦东新区银城中路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

1.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.其他销售机构

(1)交通银行股份有限公司

地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路188号

法定代表人:牛锡明

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

(2)上海天天基金销售有限公司

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

2.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

3.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

4.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、都晓燕

电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联系人:都晓燕

五、基金的名称

本基金的名称:海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金

六、基金的类型

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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、港股通的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债券、地方政府债、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交债、短期融资券(含超短期融资券)、证券公司发行的短期公司债及其他经中国证监会允许的交易保证金后,应当保持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%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

(一)大类资产配置

本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心,将定性和定量的分析方法运用于资产配置,根据宏观预期判断经济周期所处的阶段,包括大类资产的历史回报、历史波动率等制定本基金在股票、债券、现金、衍生品等资产之间的初步配置;其次结合证券市场趋势指标,判断证券市场指数的大致风险收益比,再根据基本面、资金面、估值等具体因素,持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。

(二)股票投资策略

股票投资是充分实现基金资产增值的关键。本基金将遵循风险预算管理与收益最大化相结合的原则,充分挖掘上市公司股票价格与价值之间的差异,精选价值被低估,业绩具有成长性且具有高流动性的股票,构建分散化的股票投资组合。基金经理和分析师将不断地对上市公司进行跟踪分析,及时更新上市公司经营和财务数据,识别风险,对盈利预测和估价模型进行调整和修正,根据市场状况和资产配置策略的变化及时调整股票投资组合,保证组合的高流动性、稳定性和收益性。

此外,本基金将仅通过境内及香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将立足于香港股票市场的独有特征,分析香港和内地两地上市公司差异,注重上市公司的国际比较,重点从公司质地、增长前景、估值水平、市场价格四个方面判定上市公司的投资价值。

(1)公司质地分析包括公司治理与管理层、公司的品牌和商誉、公司的盈利能力和平公司的现金流评估、公司战略等。

(2)增长前景分析包括定性分析公司的盈利增长和竞争优势的可持续性,定量分析EPS增长率、PEG等成长性指标等。

(3)估值水平分析既包括分析P/E(预期)、P/B、PCF、PFCF、相对于NAV的溢/折价、DDM、ROE等指标,也注重该指标与历史、行业和国际市场

(4)市场因素分析包括个股技术面分析、资金流向、国际和行业影响等,此外还包括该上市公司与A股上市公司相比的投资标的的稀缺性和独特性等。

(三)债券投资策略

债券投资采取“自上而下”的策略,深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以价值发现为基础