

# 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

## (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：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 2016 年 11 月 23 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 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。

刘颂(Patrick LIU)先生，董事、总经理，英国籍，工商管理硕士。历任英国伦敦洛希尔父子有限公司投资银行助理，路透伦敦资产管理战略企划部全球总监，路透香港亚太区资产管理及研究总监，香港景顺投资管理有限公司驻北京办事处首席代表，景顺长城基金管理有限公司常务副总裁，德意志资产管理大中华区董事总经理。2015 年 3 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。

黄正红先生，董事，国民经济学硕士，历任海通证券股份有限公司研究所分析员、总经理办公室秘书、主任助理、战略发展部副总经理、总经理，现任海通证券股份有限公司董事会秘书兼战略发展部总经理。

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。

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。黄金源(Alex NG 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，法国巴黎投资管理亚洲有限公司董事，现任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，先锋投资(米兰及都柏林)独立副董事长，Fundconnect 独立董事、Degroof 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，教授。1984年7月至今任职于厦门大学经济学院，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，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月起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。历任香港的近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律部负责人。

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。

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。2009年1月至2009年8月任Mariner Investment Group LLC分析师，2009年10月至2011年9月任瑞银企业管理（上海）有限公司副董事，2011年10月加入海富通基金管理有限公司，任债券投资经理，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月兼任海富通上证可质押城投债

ETF 基金经理。2015 年 12 月兼任海富通稳固收益债券和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 月起兼任海富通瑞益债券和海富通瑞丰一年定开债券基金经理。2016 年 11 月起兼任海富通美元债（QDII）基金经理。

本基金历任基金经理为邵佳民先生，任职时间为 2010 年 11 月至 2015 年 1 月。凌超先生，任职时间为 2014 年 12 月至 2016 年 1 月。

投资决策委员会常设委员有：刘颂，总经理；胡光涛，总经理助理；王智慧，总经理助理；邵佳民，总经理助理；杜晓海，多资产策略投资部总监；黄东升，机构权益投资部总监。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：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：洪渊

## 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：易会满

客户服务电话：95588

电话：010-66107900

传真：010-66107914

网址: [www.icbc.com.cn](http://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](http://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](http://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: 周慕冰

客户服务电话: 95599

传真: 010-85108557

网址: [www.abchina.com](http://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](http://www.bankcomm.com)

(6) 招商银行股份有限公司

地址: 广东省深圳市深南大道 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](http://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](http://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

联系人: 李伟

网址: [www.cebbank.com](http://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 号平安银行大厦

法定代表人: 谢永林

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](http://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 9 号

法定代表人: 李庆萍

客户服务电话: 95558

网址: [www.citicbank.com](http://www.citicbank.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: 洪崎

客户服务电话: 95568

网址: [www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(12) 浙商银行股份有限公司

地址: 浙江省杭州市下城区庆春路 288 号

法定代表人: 沈仁康

客户服务电话: 95527

联系人: 毛真海

网址: [www.czbank.com](http://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 号华夏银行大厦

法定代表人: 樊大志

客户服务电话: 95577

网址: [www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

(14) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

地址: 江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人: 陆向阳

客户服务电话: 0519-96005

公司网站: [www.jnbank.com.cn](http://www.jnbank.com.cn)

(15) 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: 周杰

客户服务电话: 95553 或 4008888001

联系人: 李笑鸣

网址: [www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(16) 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 号中信证券大厦

法定代表人: 张佑君

电话: 95548

联系人: 顾凌

网址: [www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(17) 光大证券股份有限公司

地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 郭新双

客户服务电话: 95525

联系人: 刘晨、李芳芳

网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(18) 国泰君安证券股份有限公司

地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29F

法定代表人: 杨德红

客户服务电话: 95521

联系人: 芮敏祺、吴倩

网址: [www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(19) 中信建投证券股份有限公司

地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人: 王常青

客户服务电话: 96687 或 4008888108

联系人: 权唐

网址: [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(20) 华泰证券股份有限公司

地址: 江苏省南京市中山东路 90 号

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](http://www.htsc.com.cn)

(21) 招商证券股份有限公司

地址：广东省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](http://www.newone.com.cn)

(22) 兴业证券股份有限公司

地址：福建省福州市湖东路 268 号证券大厦 17 楼

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](http://www.xyzq.com.cn)

(23) 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：尤习贵

客户服务电话：95579 或 4008888999

联系人：奚博宇

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(24) 申万宏源证券有限公司

地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

客户服务电话：95523 或 4008895523

联系人：黄莹

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(25) 华泰联合证券有限责任公司

地址：广东省深圳市深南东路 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](http://www.lhzq.com)

(26) 广发证券股份有限公司

法定代表人：孙树明

地址：广东省广州天河区天河北路 183 号大都会广场 42 楼

联系人：黄岚

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

公司网站：[new.gf.com.cn](http://new.gf.com.cn)

(27) 东方证券股份有限公司

地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层

法定代表人：潘鑫军



客户服务电话：95503

联系人：胡月茹

网址：www.dfzq.com.cn

(28) 国信证券股份有限公司

地址：广东省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：周杨

网址：www.guosen.com.cn

(29) 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：陈共炎

客户服务电话：95551 或 4008888888

联系人：邓颜

网址：www.chinastock.com.cn

(30) 平安证券股份有限公司

地址：广东省深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人：詹露阳

客户服务电话：95511 转 8

联系人：周一涵

网址：stock.pingan.com

(31) 中信证券(山东)有限责任公司

地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：95548

联系人：赵艳青

网址：www.citicssd.com

(32) 东北证券股份有限公司

地址：吉林省长春市生态大路6666号

法定代表人：李福春

客户服务电话：95360

联系人：安岩岩

网址：www.nesc.cn

(33) 德邦证券股份有限公司

地址：上海市福山路500号城建国际中心29层

法定代表人：姚文平

客户服务电话：4008888128

联系人：朱磊

网址: [www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

(34) 中泰证券股份有限公司

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.zst.com.cn](http://www.zst.com.cn)

(35) 第一创业证券股份有限公司

地址: 广东省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

客户服务电话: 95358 联系人: 毛诗莉

网址: [www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

(36) 中国中投证券有限责任公司

地址: 广东省深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座 4 层、18 层至 21 层

法定代表人: 胡长生 客户服务电话: 95532 或 4006008008

联系人: 刘毅

网址: [www.china-invs.cn](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: 4008895618

联系人: 李微

网址: [www.e5618.com](http://www.e5618.com)

(38) 华福证券有限责任公司

地址: 福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-10 层

法定代表人: 黄金琳

客户服务电话: 0591-96326 (福建) 或 4008896326 (全国)

联系人: 张腾

网址: [www.gfhfzq.com.cn](http://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: 张志刚

客户服务电话: 95321

联系人: 尹旭航

网址: [www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

(40) 渤海证券股份有限公司

地址: 天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人: 王春峰

客户服务电话：4006515988

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：宁敏

客户服务电话：4006208888 或 021-61195566

联系人：王炜哲

网址：www.bocichina.com.cn

(42) 长城证券股份有限公司

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

法定代表人：丁益

客户服务电话：4006666888

联系人：郑舒丽

网址：www.cgws.com

(43) 方正证券股份有限公司

地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 200 号华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：何其聪

客户服务电话：95571

联系人：郭军瑞

网址：www.foundersec.com

(44) 东莞证券股份有限公司

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：95328

联系人：梁建伟

网址：www.dgzq.com.cn

(45) 广州证券股份有限公司

地址：广东省广州市天河区珠江新城珠江江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：刘东

客户服务电话：95396

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：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

客户服务电话：4008918918 或 021-962518

联系人：邵珍珍

网址: [www.962518.com](http://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 号大连期货大厦 39 层

法定代表人: 赵玺

客户服务电话: 4008169169

联系人: 谢立军

网址: [www.daton.com.cn](http://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: 孙名扬

客服电话: 4006662288

网址: [www.jhzq.com.cn](http://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: 95573

联系人: 张治国

网址: [www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(50) 国都证券股份有限公司

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: 王少华

客户服务电话: 4008188118

联系人: 黄静

网址: [www.guodu.com](http://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: 4008888993

联系人: 汤漫川

网址: [www.dxzq.net](http://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 26-28 层

法定代表人: 蔡一兵

客户服务电话: 95317 或 4008835316

联系人: 郭磊

网址: [www.cfzq.com](http://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 18 层

法定代表人：余政

客户服务电话：4006198888

联系人：赵明

网址：www.msza.com

(54) 华龙证券股份有限公司

地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富中心

法定代表人：李晓安

客户服务电话：0931-95368（甘肃）或 4006898888（全国）

联系人：范坤

网址：www.hlzq.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：刘闻川

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：010-66045555 或 010-66045777 或 010-66045678（基金）

联系人：谭磊

网址：www.txsec.com

(57) 安信证券股份有限公司

地址：广东省深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

客户服务电话：95517

联系人：陈剑虹

网址：www.essence.com.cn

(58) 华西证券股份有限公司

地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

客户服务电话：95584

联系人：周志茹

网址：www.hx168.com.cn

(59) 西藏东方财富证券股份有限公司

地址：上海市闸北区永和路 118 弄 24 号

法定代表人：陈宏

客户服务电话：95357

联系人：周艳琼

网址：www.xzsec.com

(60) 财达证券有限责任公司

地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23-26 层

法定代表人：翟建强

客户服务电话：4006128888

联系人：李卓颖

网址：www.s10000.com

(61) 太平洋证券股份有限公司

地址：云南省昆明市北京路 926 号同德广场写字楼 31 楼

法定代表人：李长伟

客户服务电话：4006650999

联系人：唐昌田

网址：www.tpyzq.com

(62) 开源证券股份有限公司

地址：西安市雁塔区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

客户服务电话：4008608866

网址：www.kysec.cn

(63) 申万宏源西部证券有限公司

住所：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：李季

客户服务电话：4008000562

联系人：王怀春

网址：www.hysec.com

(64) 中国国际金融股份有限公司

地址：北京市建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 28 层

法定代表人：丁学东

电话：010-65051166（北京）、021-58796226（上海）

传真：010-65051156

联系人：王少立

网址：www.cicc.com

(65) 华西证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 30 层

法定代表人：宋卫东

客户服务电话：4008211357

联系人：秦臻

网址: [www.huajinsc.cn](http://www.huajinsc.cn)

(66) 中信期货有限公司

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13层1301-1305室、14层

法定代表人: 张皓

客户服务电话: 4009908826

联系人: 韩钰

网址: [www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

(67) 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

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

法定代表人: 余磊

客户服务电话: 4008005000

联系人: 杨晨

官网: [www.tfzq.com](http://www.tfzq.com)

(68) 宏信证券有限责任公司

地址: 四川省成都市人民南路二段18川信大厦10楼

法定代表人: 吴玉明

客户服务电话: 4008366366

联系人: 张鋈

网址: [www.hxzq.cn](http://www.hxzq.cn)

(69) 深圳众禄金融控股股份有限公司

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](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(70) 蚂蚁(杭州)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: 李雁雯

网址: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(71) 上海好买基金销售有限公司

地址: 上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

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.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(72) 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：单丙焯

客服电话：400-089-1289

公司网站： [www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(73) 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 7 6 5 0 号 2 0 5 室

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

联系人：李娟

网址： [www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(74) 上海天天基金销售有限公司

地址：徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 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](http://www.1234567.com.cn)

(75) 和讯信息科技有限公司

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](http://licaike.hexun.com)

(76) 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：马林

网址： [www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(77) 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：董一峰

网址： [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(78) 众升财富（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：王斐

客户服务电话：400-081-6655

联系人：顾欣

网址：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

(79) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

法定代表人：陈操

地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 室

联系人：文雯

客户服务电话：400-850-7771

网站：<https://t.jrj.com/>

(80) 一路财富（北京）信息科技有限公司

法定代表人：吴雪秀

地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702

联系人：徐越

客服电话：400-001-1566

网址：[www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

(81) 上海联泰资产管理有限公司

法定代表人：燕斌

地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

联系人：陈东

客服电话：4000-466-788

网址：<http://www.66zichan.com/>

(82) 北京增财基金销售有限公司

法定代表人：罗细安

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

联系人：史丽丽

客服电话：400-001-8811

网址：[shill@zcvc.com.cn](mailto:shill@zcvc.com.cn)

(83) 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服电话：400-893-6885

联系人：高静

网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(84) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

客服电话：400-820-2819

联系人：李栋

网址：<http://www.chinapnr.com/>

(85) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号国金中心办公楼二期46层4609-10单元

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

联系人：余永键

网址：<http://www.harvestwm.cn/>

(86) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人：林卓

客服电话：400-6411-999

联系人：张晓辉

网址：<http://www.taichengcaifu.com>

(87) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

法定代表人：盛大

客服电话：400-858-0298

联系人：徐鹏

网址：<http://www.leadbank.com.cn>

(88) 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路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济展发区）

法定代表人：王翔

客服电话：021-65370077

联系人：陈蕊洁

网址：<http://www.fofund.com.cn>

(89) 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

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

联系人：吴煜浩

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(90) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层

法定代表人：梁越

客服电话：4008-980-618

联系人：王海焯

网址: [www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

(91) 北京乐融多源投资咨询有限公司

地址: 北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603

法定代表人: 董浩

客服电话: 400-068-1176

联系人: 于婷婷

网址: <https://www.jimubox.com>

(92) 大泰金石基金销售有限公司

地址: 南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室

法定代表人: 袁顾明

客服电话: 021-22267982

联系人: 朱真卿

网址: <http://www.dtfortune.com/>

(93) 上海陆金所资产管理有限公司

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: 何雪

网址: <https://www.lu.com>

(94) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

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/>

(95) 上海凯石财富基金销售有限公司

地址: 上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

法定代表人: 陈继武

客服电话: 4000-178-000

联系人: 葛佳蕊

网址: <http://www.vworks.com.cn>

(96) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

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/>

(97) 深圳富济财富管理有限公司

地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

法定代表人：齐小贺

客服电话：0755-83999907

联系人：马利佳

网址：[www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

(98) 奕丰金融服务（深圳）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](http://www.ifastps.com.cn)

(99) 浙江金观诚财富管理有限公司

地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

法定代表人：徐黎云

客服电话：400-068-0058

联系人：孙成岩

网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

(100) 上海大智慧财富管理有限公司

地址：上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11楼

法定代表人：申健

客服电话：021-20219931

联系人：施燕华

网址：<https://8.gw.com.cn>

(101) 北京广源达信投资管理有限公司

地址：北京市朝阳区望京东园四区13楼浦项中心B座19层

法定代表人：齐剑辉

客服电话：400-623-6060

联系人：崔丁元

网址：<https://www.niuniufund.com/>

(102) 北京汇成基金销售有限公司

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.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

### 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](http://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：010-50938782  
传真：010-50938907  
联系人：赵亦清

(三) 出具法律意见书的律师事务所

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：俞卫锋  
电话：021-31358666  
传真：021-31358600  
联系人：黎明  
联系电话：021-31358666-8716  
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、傅琛慧  
电话：(021) 23238888  
传真：(021) 23238800  
联系人：傅琛慧

四、基金的名称

本基金名称：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、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2016年12月20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2016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 92,755,534.59 7.06

其中：股票 92,755,534.59 7.06

2 固定收益投资 1,043,293,162.49 79.36

其中：债券 1,043,293,162.49 79.36

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	149,980,424.97 11.41
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	24,327,740.01 1.85
7 其他资产	4,291,041.79 0.33
8 合计	1,314,647,903.85 100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

A 农、林、牧、渔业	--
B 采矿业	11,782,416.99 0.91
C 制造业	49,472,060.93 3.80
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	--
E 建筑业	11,318,026.89 0.87
F 批发和零售业	4,787,275.54 0.37
G 交通运输、仓储和邮政业	--
H 住宿和餐饮业	--
I 信息传输、软件和信息技术服务业	--
J 金融业	2,345,682.24 0.18
K 房地产业	13,050,072.00 1.00
L 租赁和商务服务业	--
M 科学研究和技术服务业	--
N 水利、环境和公共设施管理业	--
O 居民服务、修理和其他服务业	--
P 教育	--
Q 卫生和社会工作	--
R 文化、体育和娱乐业	--
S 综合	--
合计	92,755,534.59 7.13

## 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300408	三环集团	845,834	15,673,304.02	1.20
2	600208	新湖中宝	2,959,200	13,050,072.00	1.00
3	600547	山东黄金	308,521	11,782,416.99	0.91

4	600068	葛洲坝	1,284,992	10,164,286.72	0.78
5	600273	嘉化能源	975,098	9,058,660.42	0.70
6	002501	利源精制	644,565	7,393,160.55	0.57
7	600487	亨通光电	318,800	6,286,736.00	0.48
8	600755	厦门国贸	408,181	3,579,747.37	0.27
9	600155	宝硕股份	228,096	3,421,440.00	0.26
10	600562	国睿科技	80,432	2,765,252.16	0.21

#### 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 20,008,398.40 1.54

2 央行票据 --

3 金融债券 852,515,000.00 65.49

其中：政策性金融债 852,515,000.00 65.49

4 企业债券 --

5 企业短期融资券 --

6 中期票据 --

7 可转债 170,769,764.09 13.12

8 同业存单 --

9 其他 --

10 合计 1,043,293,162.49 80.15

#### 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 160419 16农发19 8,000,000 800,320,000.00 61.48

2 150218 15国开18 500,000 52,195,000.00 4.01

3 110032 三一转债 225,430 24,887,472.00 1.91

4 128009 歌尔转债 182,926 24,142,573.48 1.85

5 113008 电气转债 206,830 23,667,556.90 1.82

#### 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

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，本基金暂未参与股指期货交易。

## 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，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

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 162,453.43

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 4,125,798.36

5 应收申购款 2,790.00

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 4,291,041.79

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 110032 三一转债 24,887,472.00 1.91

2 128009 歌尔转债 24,142,573.48 1.85

3	113008	电气转债	23,667,556.90	1.82
4	110033	国贸转债	21,121,316.40	1.62
5	110035	白云转债	13,360,098.00	1.03
6	110031	航信转债	3,195,951.20	0.25
7	110034	九州转债	541,491.60	0.04

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

## 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2016年9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) 本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

阶段 份额净值增长率① 份额净值增长率标准差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

2010年11月23日（基金合同生效日）-2010年12月31日 0.50% 0.11% 0.41% 0.01% 0.09%  
0.10%

2011年1月1日-2011年12月31日 -2.99% 0.19% 4.77% 0.01% -7.76% 0.18%

2012年1月1日-2012年12月31日 8.41% 0.11% 4.62% 0.01% 3.79% 0.10%

2013年1月1日-2013年12月31日 3.97% 0.22% 4.25% 0.01% -0.28% 0.21%

2014年1月1日-2014年12月31日 24.75% 0.58% 4.22% 0.01% 20.53% 0.57%

2015年1月1日-2015年12月31日 19.18% 1.38% 3.37% 0.01% 15.81% 1.37%

2016年1月1日-2016年6月30日 -7.34% 0.54% 1.36% 0.01% -8.70% 0.53%

2010年11月23日（基金合同生效日）-2016年9月30日 56.00% 0.66% 26.15% 0.01% 29.85%  
0.65%

(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：

(2010年11月23日至2016年9月30日)

注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分（二）投资范围、（五）投资限制中规定的各项比例。

## 十三、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、基金销售服务费；
- 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事务所、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、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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

## （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0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2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0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、基金销售服务费

本基金的销售服务费年费率为0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金资产中划出，由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。

4、上述“一、基金费用的种类”中第4—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。

### （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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 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）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况，按法律法规规定及本合同约定的程序调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，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

海富通稳固收益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、“第三节 基金管理人”部分：

1. 增加了杨明先生的简历。
2. 更新了章明女士、陈轶平先生的简历。
3. 删除了阎小庆先生的简历。
4. 更新了投资决策委员会的相关信息。

### 二、“第四节 基金托管人”部分：更新了基金托管人的相关信息。

### 三、“第五节 相关服务机构”部分：

1. 对部分场外销售机构的相关信息进行了更新。
2. 更新了注册登记机构的相关信息。
3. 更新了审计基金财产的会计师事务所的相关信息。

### 四、“第八节 基金份额的申购与赎回”部分，更新了基金的申购份额的计算的相关信息。

五、“第九节 基金的投资”和“第十节 基金的业绩”部分，根据 2016 年第三季度报告，更新了基金投资组合报告和基金业绩的内容，相关数据截止期为 2016 年 9 月 30 日。

海富通基金管理有限公司

2017 年 1 月 6 日

