

海富通强化回报混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

重要提示

海富通强化回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2006 年 3 月 31 日中国证券监督管理委员会证监基金字【2006】58 号文件核准募集。本基金的基金合同于 2006 年 5 月 25 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。

基金管理人承诺依照恪尽职守、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。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 11 月 25 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

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。

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月至2015年1月兼任海富通稳健添利债券基金经理，2010年11月至2015年1月兼任海富通稳固收益债券基金经理，2013年1月至2015年1月兼任海富通稳进增利债券（LOF）基金经理。

张炳炜先生，硕士。曾任交银施罗德基金管理有限公司数量分析师，2011年7月加入海富通基金管理有限公司，任股票分析师。2015年6月起任海富通强化回报混合基金经理。2016年2月起兼任海富通大中华混合（QDII）和海富通中国海外混合（QDII）基金经理。2016年11月起兼任海富通沪港深混合基金经理。

本基金的历任基金经理为郑拓先生，任职时间为2006年5月至2006年9月。蒋征先生，任职时间为2006年9月至2014年1月。谢志刚先生，任职时间为2014年1月至2015年6月。

李志女士，硕士。历任上海申银万国证券研究所有限公司助理分析师，汇丰晋信基金管理有限公司研究员，2015年12月加入海富通基金管理有限公司，任股票相对收益组合部分分析师。现任海富通精选混合、海富通收益增长混合、海富通股票混合、海富通强化回报混合、海富通风格优势混合、海富通精选贰号混合、海富通领先成长混合、海富通中小盘混合、海富通国策导向混合、海富通内需热点混合和海富通改革驱动混合的基金经理助理。

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：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

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、销售机构

（1）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

（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

(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

(5) 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

(6) 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

(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

(8) 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

(9) 广发银行股份有限公司

地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

客户服务电话：4008308003

网址：www.cgbchina.com.cn

(10) 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

(11) 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

(12) 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

(13) 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

(14) 宁波银行股份有限公司

地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：95574

联系人：胡技勋

网址：www.nbc.com.cn

(15) 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

(16) 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

(17) 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

(18) 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

(19) 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

(20) 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

(21) 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：400-8888-108

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

(22) 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

(23) 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

(24) 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

(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

(26) 广发证券股份有限公司

法定代表人：孙树明

地址：广东省广州市天河区天河北路 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

(27) 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

(28) 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

(29) 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

(30) 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

(31) 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

(32) 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

(33) 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

(34) 世纪证券有限责任公司

地址：广东省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

客户服务电话：4008323000

联系人：袁媛

网址：www.csco.com.cn

(35) 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

(36) 东北证券股份有限公司

地址：吉林省长春市生态大街 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

(37) 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：95336

联系人：夏吉慧

网址：www.ctsec.com

(38) 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

(39) 国海证券股份有限公司

地址：广西南宁市滨湖路 46 号国海大厦

法定代表人：何春梅

客户服务电话：95563

联系人：牛孟宇

网址：www.ghzq.com.cn

(40) 恒泰证券股份有限公司

地址：内蒙古呼和浩特市赛罕区勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 层

法定代表人：庞介民

电话：4001966188

联系人：张同亮

网址：www.cnht.com.cn

(41) 瑞银证券有限责任公司

地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人：程宜荪

客户服务电话：4008878827

联系人：冯爽

网址：www.ubs.com

(42) 中航证券有限公司

地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 层楼

法定代表人：王宜四

电话：4008895335, 95335

联系人：史江磊

网址：www.scstock.com

(43) 国元证券股份有限公司

地址：安徽省合肥市梅山路安徽国际金融中心 A 座

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

(44) 德邦证券股份有限公司

住所：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

(45) 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

客户服务电话：95538

联系人：孙豪志

网址：www.zts.com.cn

(46) 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

(47) 湘财证券股份有限公司

地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：林俊波

客户服务电话：4008881551

联系人：胡莹

网址：www.xcsc.com

(48) 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

(49) 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

(50) 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

公司总机：010-65051166（北京）；021-58796226（上海）

联系人：王少立

网址：www.cicc.com

(51) 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

(52) 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

(53) 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

(54) 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

(55) 方正证券股份有限公司

地址：湖南长沙芙蓉中路二段 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.foundersc.com

(56) 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

(57) 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：王春峰

客户服务电话：400-651-5988

联系人：王兆权

网址：www.ewww.com.cn

(58) 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

(59) 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

(60) 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

(61) 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

(62) 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：周俊

客服电话：4006662288

网址：www.jhzq.com.cn

(63) 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

(64) 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：王少华

客户服务电话：4008188118

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

(65) 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

(66) 财富证券有限责任公司

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

法定代表人：蔡一兵

客户服务电话：95317 或 40-8835316

联系人：郭磊

网址：www.cfzq.com

(67) 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.msyzq.com

(68) 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：4006898888（全国）或 0931-95368（甘肃）

联系人：范坤

网址：www.hlzq.com

（69）英大证券有限责任公司

地址：广东省深圳市福田区深南中路华能大厦 30 楼

法定代表人：吴骏

客户服务电话：4000188688

联系人：李欣

网址：www.ydsc.com.cn

（70）红塔证券股份有限公司

地址：云南省昆明市北京路 155 号附一号红塔大厦 7-11 楼

法定代表人：况雨林

客户服务电话：4008718880

联系人：刘晓明

网址：www.hongtastock.com

（71）国融证券股份有限公司

地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道与呈祥路交汇处武川立农村镇银行股份有限公司四楼

法定代表人：侯守法

客户服务电话：95385

联系人：虞哲维

网址：www.grzq.com

（72）中山证券有限责任公司

地址：广东省深圳市南山区科技中一路华强高新大厦 7-8 楼

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

（73）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

（74）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：<http://www.xzsec.com/>

(75) 财达证券股份有限公司

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

(76) 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

(77) 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

联系人：袁伟涛

网址：www.kysec.cn

(78) 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

(79) 华金证券有限责任公司

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.huajinsec.com

(80) 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

(81) 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

(82) 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：张鋆

网址：www.hxzq.cn

(83) 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 及 www.jjmmw.com

(84) 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

(85) 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

(86) 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：单丙焱

客服电话：400-089-1289

公司网站：www.erichfund.com

(87) 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：李娟

网址：www.noah-fund.com

(88) 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

(89) 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：吴卫东

网址：licaike.hexun.com

(90) 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

(91) 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

(92) 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

(93) 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/>

(94) 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

(95) 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/>

(96) 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@zcv.com.cn

(97) 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

(98) 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/>

(99) 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/>

(100) 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路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>

(101) 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>

(102) 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

(103) 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

(104) 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>

(105) 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/>

(106) 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>

(107) 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/>

(108) 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：李晓明

网址：<http://www.vworks.com.cn>

(109) 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/>

(110) 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

(111) 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

(112) 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

(113) 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>

(114) 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/>

(115) 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

3、场内销售机构

具有开放式基金销售资格的、经中国结算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）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) 注册登记人

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：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心写字楼 A 座 40 层

负责人：王玲

电话：010-58785588

传真：010-58785599

联系人：靳庆军

联系电话：010-58785588

经办律师：靳庆军、宋萍萍

（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：海富通强化回报混合型证券投资基金

五、 基金类型

基金类型：契约型开放式

六、 基金的投资目标

本基金的投资目标为：每年超越三年期定期存款（税前）加权平均收益率。

七、 投资方向和范围

本基金投资范围限于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、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的资产配置：股票资产 0%—95%，权证投资 0—3%，债券 5%—95%；本基金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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他产品，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

八、 投资策略

本基金认为，灵活而有纪律的资产配置策略和精选证券是获得回报的主要来源，而收益管理和风险管理是保证回报的重要手段。因此，本基金将运用资产配置、精选证券和收益管理三个层次的投资策略，实现基金的投资目标。

1. 资产配置策略

资产配置策略以基金的投资目标为中心，在实现既定的投资目标同时将可能的损失最小化。因此，本基金将基于定量和定性相结合的宏观分析，形成对不同市场周期的预测和判断，通过灵活主动的又有纪律的资产配置，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，追求较高的收益，规避市场的系统性风险。

（1）宏观分析因素的主要内容：

经济周期和经济环境，包括宏观经济发展趋势，经济的景气周期研究等。本基金管理人将特别关注 GDP 增长、各种国民生产统计指标等，从而分析对股票市场的影响；

货币因素，主要包括利率水平及其变化、CPI、货币政策等。本基金管理人还将时刻关注利率以及人民币汇率水平的变化对中国经济及证券市场的影响；

市场估值，包括市场的相对定价水平、估值水平等。通过分析不同资产类别的长期风险收益特征，研究影响短中期各类资产估值的因素、市场出现的短期不均衡等情况，以定性定量的方法，

侧重于研究证券市场的定价指标如 PE、债券收益率等，以及证券类资产与商品类资产如石油、黄金、房地产等价格趋势比较及其影响；

政策影响因素，不同政策发布对不同资产类别的影响分析等。本基金管理人相信政策对中国证券市场的影响将在相当长的一段时间内发挥非常重要的作用，因此我们将总结历史，密切关注及预测政策发生对证券市场产生的影响；

利润预测分析因素，通过对商品价格、货币价格变化的分析，形成对行业利润趋势的意见；

量化模型分析因素，通过市场价值中枢模型，从量化的角度衡量资产类别的估值水平，并发现市场趋势；

市场气氛，通过对不同技术指标以及信心等对证券市场的气氛进行评估。通过对信心指标如分析师指数、市场特殊效应、人气指标、成交量指标、换手率指标进行分析，帮助基金确定和调整资产类别间的配置。

（2）市场价值中枢评估模型（AVM）

市场价值中枢评估模型主要用来衡量证券市场定价水平，其核心思想是通过分析不同资产类别的长中期风险收益特征和相关性，发现市场未来趋势，并依据股票市场与其他市场投资产品的收益率来判断股票市场平均价格水平是否被高估的理论方法。

综上，如果结合量化模型分析与定性判断发现股票市场价值被高估，在资产配置决策中，将不再扩大或控制股票投资比例。如果股票市场价值高估程度较高，将选择降低股票持仓比例，实现收益。

2. 股票投资策略

本基金从投资目标出发，运用海富通 定价选股策略，选择稳定收益型、高安全边际型股票，作为基金持有的核心股票。同时，利用均值反转策略主动管理事件驱动型股票，把握有利的投资机会，追求收益的最大化。另外，还将运用 IPO 或金融衍生工具等各种套利策略进行套利，提高基金收益水平。

（1）海富通定价选股策略

海富通 定价选股策略运用海富通定价分析系统研究发掘具有稳定收益或具有高安全边际的兼具价值成长特征的核心资产和稳健资产型股票，主要有以下二类：

稳定收益型

对于稳定收益型股票，本基金将以较高预期股息收益率为核心，同时结合以下几方面进行选择：

公司进入稳定发展阶段，预期主营业务收入及净利润保持稳定增长；

公司现金流状况良好；

公司有现金分红历史记录，同时具有继续进行现金分红的潜力；

预期股息收益率处于市场平均水平之上。

根据以上标准，选择出重点目标公司，在周密的案头研究基础上，通过实地调研，最终精选一批具备投资价值的收益型股票。

高安全边际型

高安全边际型股票主要是指股票价格与价值之间的差异高过某一安全边际的股票。本基金对于高安全边际股票投资价值的判断，主要依赖于两方面的基础工作：一是以行业专家和财务专家的角度对公司发展、经营和财务状况进行深入调查研究，二是运用 DDM、DCF 或 DFCF 等模型，

选择股价具有较大升值空间的价值成长兼有型公司，主要包括两类：

一类是企业在过去经营中累积的核心竞争优势，包括由于公司具有强有力的管理团队、先进的技术、独占的专利、持续的创新能力和严格规范的管理、独到的企业文化、雄厚的品牌商誉、庞大的市场网络等因素带给企业持续发展的能力；

另一类是由于政策垄断、资源独占、进入壁垒高等因素所带给企业的持续发展能力，并且这些因素在可预见的将来不会改变或消失。

具有持续发展能力的上市公司一般具有以下特点：

公司主营业务清晰突出，经营业绩稳定成长，业绩真实、可靠；

财务状况良好，具备良好的盈利记录，有一定的现金分红能力；

有强有力的管理团队，重视股东价值增加，诚实信用；

公司在成本、技术、研究开发、市场营销、管理创新等方面具有一定优势，在行业内处于领先的地位，并且在竞争中积累了对手难以模仿的资源或能力；

公司股票具备一定规模的流通市值，具备良好的流动性。

本基金通过投资于具有高安全边际和持续发展能力的价值成长兼有的上市公司，可以在较长的时期分享中国经济增长的成果，获取资本的中长期平稳增长。

（2）股票均值反转策略

股票均值反转策略主要用于具有价值回归潜能的股票。均值反转策略注重运用股价的均值反转规律，强调“先行价值发现、提前控制风险”，简单讲，就是在市场取得一致认识之前，超前发现和介入价值被低估的行业和个股，并在市场存在下跌风险时，通过资产配置比例的调整，提前控制下跌风险。例如，当公司经营过程中发生重大事件，基金管理人评估上市公司的投资价值，发掘可能存在的被低估的现象，把握比较有利的投资机会；或者，进行资产重组，基金管理人上市公司进行深入的研究与调研，如上市公司的质地将发生显著变化，本基金管理人可以通过购入股票获取未来公司步入正轨后产生的高回报。运用均值反转策略所选的股票类型如下：

运用均值反转策略精选事件驱动型股票具有以下特征：

由某一重大事件造成股票价格非理性大幅下跌，而公司的基本面并未发生实质性的变化；

由于经济、行业、市场周期，不符合某一时期市场热点，被投资者遗弃的行业或公司，特别是那些相对于近两、三年价格高点，股价处于相对低位的股票。

通过对其所处行业、公司基本面的分析，寻找价值未能被市场充分认识的股票作为投资对象，利用市场的均值反转规律，在其价值回归过程中获益。

（3）套利策略

套利策略主要是利用信息和研究股票市场间或不同股本类金融产品价格失衡带来的投资机会，以较低成本、较快的速度把握各种市场机会。主要包括：新股 IPO 套利策略、增发套利策略和 ETF 套利策略等。

（4）衍生金融工具套利策略

本基金的权证投资将以保值为主要投资策略，以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；在个股层面上，充分发掘可能的套利机会，以达到增值的目的。

本基金可以持有在股权分置改革中被动获得的权证，并可以根据证券交易所的有关规定卖出该部分权证或行权。

本基金将根据权证投资策略主动投资于在股权分置改革中发行的权证。

随着我国权证市场的发展，在以后法律法规允许的情况下，本基金将运用认沽权证或认购权证控制风险，增加收益。

3. 债券投资策略

本基金采用“总收益”管理方法来管理债券，债券投资的原则是为基金组合提供稳定收益和降低波动风险。

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，采取以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略、收益率利差策略等，确定和构造能够提供稳定收益、流动性较高的债券和货币市场工具组合。

另外，本基金在债券投资过程中将密切关注市场创新和变化中带来的投资机会，以及把握债券套利和可转债套利的投资机会，提高债券投资的收益水平。

债券套利策略(Fixed-income arbitrage)：通过分析收益率曲线变动趋势及不同债券品种的各种要素，挖掘因收益率曲线变动和不同固定收益市场、品种和期限结构的利差变动而产生的套利机会。

可转债套利(Convertible arbitrage)：由于可转债价格变动对于基础股票价格波动敏感性的非线性特征，使得可转债具有上涨和下跌的不对称性。转债在基础股票上涨时候参与程度高，下跌时候参与度小，同时充分利用转股价格修正和回售条款等博弈条款产生的套利机会。

在市场创新和变化中寻找投资机会：在新兴的中国债券市场，存在广阔的产品创新空间 and 变化，为基金提供了较为丰富的获利空间。

4. 收益管理策略

根据投资目标，本基金强调收益管理策略，及时锁定已实现的收益和控制下跌风险，将相对收益转化为实现收益。

本基金运用期间收益率(PERIODIC RETURN)和滚动收益率(ROLLING RETURN)等严格纪律的收益管理方法，实现锁定收益和控制风险的目标。对于资产配置，收益管理策略主要是根据定量定性分析，在市场趋势发生变化时，及时调整大类资产配置，及时提高或降低风险类资产比重；对于股票投资，主要是策略性地持有股票，而不片面强调中长线静态持有。本基金将根据对股票收益率动态变化的分析预测，兼顾当时的市场趋势和个股的市场表现，通过对股票价格与价值相对波动和偏离程度的分析来掌握买卖时机，在股价的波动中适时实现收益或控制损失。另外，在未来法律法规允许的情况下，本基金将运用权证作为收益风险管理工具，有效的控制下跌风险和锁定已实现利润，将相对收益转化为实现收益，实现基金净值的增长。

5. 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的进行分析，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，在股票分析师设定的股票池内，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

三年期银行定期存款(税前)加权平均收益率。

其理由：

1. 为投资者广为熟悉的存款利率；
2. 直观、极易为投资者了解；
3. 容易得到的收益定量指标；

由于定期存款利率存在变动，因此本基金选择三年期定期存款加权利率。

十、 风险收益特征

追求每年高于一定正回报的投资品种。属于适度风险、适中收益的混合型基金，其长期的预期收益和风险高于债券基金，低于股票基金。

十一、 基金投资组合报告

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。

基金托管人招商银行根据本基金合同规定，于2016年12月16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 347,156,206.26 65.05

其中：股票 347,156,206.26 65.05

2 固定收益投资 124,811,796.90 23.39

其中：债券 124,811,796.90 23.39

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 40,000,000.00 7.49

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 19,379,947.29 3.63

7 其他资产 2,356,929.47 0.44

8 合计 533,704,879.92 100.00

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 1,048,815.00 0.20

B 采矿业 8,409,574.04 1.59

C 制造业 234,005,300.50 44.26

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 39,077,688.72 7.39

F 批发和零售业 14,392,749.00 2.72

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

9,924,696.00 1.88

J 金融业 --

K 房地产业 40,297,383.00 7.62

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 347,156,206.26 65.66

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 000952 广济药业 1,159,189 24,702,317.59 4.67

2 601636 旗滨集团 6,064,900 22,500,779.00 4.26

3 300408 三环集团 1,150,966 21,327,399.98 4.03

4 002501 利源精制 1,826,798 20,953,373.06 3.96

5 000666 经纬纺机 907,300 19,688,410.00 3.72

6 002643 万润股份 468,500 18,402,680.00 3.48

7 000965 天保基建 2,289,900 16,349,886.00 3.09

8 600208 新潮中宝 3,636,900 16,038,729.00 3.03

9	600463 空港股份	1,039,797	15,815,312.37	2.99
10	600068 葛洲坝	1,969,200	15,576,372.00	2.95

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	15,745,500.00	2.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,220,000.00	9.50
其中：政策性金融债 50,220,000.00 9.50			
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	58,846,296.90	11.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	124,811,796.90	23.61

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	150302	15 进出 02	500,000	50,220,000.00	9.50
2	110031	航信转债	181,890	20,382,593.40	3.86
3	110030	格力转债	139,050	17,168,503.50	3.25
4	010303	03 国债(3)	150,000	15,745,500.00	2.98
5	132006	16 皖新 EB	120,000	13,728,000.00	2.60

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 本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 705,760.51

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 1,650,971.33

5 应收申购款 197.63

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 2,356,929.47

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 110031 航信转债 20,382,593.40 3.86

2 110030 格力转债 17,168,503.50 3.25

3 110033 国贸转债 7,567,200.00 1.43

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中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) 业绩比较基准标准
差 (4) (1) - (3) (2) - (4)

2006.5.25 (基金合同生效日) -2006.12.31 34.36% 0.68% 2.10% 0.01% 32.26% 0.67%

2007.1.1-2007.12.31 112.73% 1.78% 4.49% 0.01% 108.24% 1.77%

2008.1.1-2008.12.31 -52.27% 2.20% 5.17% 0.01% -57.44% 2.19%

2009.1.1-2009.12.31 45.87% 1.05% 3.33% 0.01% 42.54% 1.04%

2010.1.1-2010.12.31 12.32% 1.12% 3.44% 0.01% 8.88% 1.11%

2011.1.1-2011.12.31 -21.82% 1.06% 4.77% 0.01% -26.59% 1.05%

2012.1.1-2012.12.31 -1.45% 1.03% 4.62% 0.01% -6.07% 1.02%

2013.1.1-2013.12.31 11.95% 1.00% 4.25% 0.01% 7.70% 0.99%

2014.1.1-2014.12.31 18.13% 0.81% 4.22% 0.01% 13.91% 0.80%

2015.1.1-2015.12.31 12.50% 2.26% 3.37% 0.01% 9.13% 2.25%

2016.1.1-2016.6.30 -11.77% 1.53% 1.36% 0.01% -13.13% 1.52%

2006.5.25 (基金合同生效日) -2016.9.30 132.55% 1.43% 50.66% 0.01% 81.89% 1.42%

(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：

(2006年5月25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。建仓期满至今，本基
金投资组合均达到本基金合同第十二条（二）、（七）规定的比例限制及本基金投资组合的比
例范围。

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. 基金财产划拨支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定
时从其规定。

(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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 1.50%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.25%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、上述（一）中 3 到 8 项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

（四）基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前三个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

（五）税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

海富通强化回报混合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、李志女士的简历。
2. 更新了张炳炜先生、章明女士的简历。
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. 对部分销售机构的相关信息进行了更新。
2. 更新了注册登记人的相关信息。

3. 更新了审计基金财产的会计师事务所的相关信息。

四、“第六节 基金的募集”和“第八节 基金份额的申购与赎回”部分，对基金认购份额和申购份额计算的相关信息进行了更新。

五、“第十一节 基金的投资”和“第十二节 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7日