

海富通收益增长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：中国银行股份有限公司

重要提示

海富通收益增长证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2004 年 1 月 18 日出具的《关于同意海富通收益增长证券投资基金设立的批复》（证监基金字【2004】8 号文）批准募集。本基金的基金合同于 2004 年 3 月 12 日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

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。

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。

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 2017 年 3 月 12 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 12 月 31 日。

第一节 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

法定地址：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

设立时间：2003 年 4 月 18 日经中国证监会批准设立

注册资本：人民币 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%。

电话：021-38650999

联系人：吴晨莺

（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。2017年2月起代行总经理职责。

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 独立董事长、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总经理。

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BCC 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。

周雪军先生，硕士。历任北京金融街控股股份有限公司职员、天治基金管理有限公司研究员，2012年6月至2015年2月任天治财富增长混合基金经理，2014年1月至2015年2月兼任天治趋势精选混合基金经理。2015年2月加入海富通基金管理有限公司，2015年6月起任海富通收益增长混合基金经理。2016年4月起兼任海富通改革驱动混合基金经理。

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。2016年7月起，担任海富通收益增长的基金经理助理。本基金历任基金经理分别为张炜先生，任职时间为2005年4月至2006年3月；陈洪先生，任职时间为2006年3月至2006年9月；陈绍胜先生，任职时间为2004年3月至2009年1月；蒋征先生，任职时间为2009年1月至2012年1月；牟永宁先生，任职时间为2009年1月至2011年4月及2012年1月至2013年10月；黄春雨先生，任职时间为2013年7月至2014年4月；丁俊先生，任职时间为2014年4月至2016年8月。

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：张文伟，董事长(代行总经理)；胡光涛，总经理助理；王智慧，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；王金祥，研究部副总监；陈甄璞，量化投资部总监；陈轶平，固定收益投资部副总监。投资决策委员会主席由董事长(代行总经理)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。

第二节 基金托管人

（一）基金托管人概况

本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司（简称“中国银行”），基本情况如下：

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

第三节 相关服务机构

（一）基金份额销售机构

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

成立时间：2003年4月18日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2003】48号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元

存续期间：持续经营

联系人：康旭

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

电话：021-38650797、38650799

传真：021-33830160、33830161

2、销售机构

（1）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

（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

网址：www.ccb.com

(3) 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

客户服务中心电话：95588

电话：010-66107900

传真：010-66107914

网址：www.icbc.com.cn

(4) 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

(5) 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

网址：www.cmbchina.com

(6) 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：刘士余

客户服务电话：95599

传真：010-85108557

网址：www.abchina.com

(7) 兴业银行股份有限公司

地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

客户服务电话：95561

网址：www.cib.com.cn

(8) 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

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：bank.pingan.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

网址：www.spdb.com.cn

(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：常振明

客户服务电话：95558

网址：<http://bank.ecitic.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

(12) 广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：董建岳

客户服务电话：4008308003

网址：<http://www.cgbchina.com.cn/>

(13) 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：沈仁康

客户服务电话：95527

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：96528/962528

网址：www.nccb.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

法定代表人：吴建

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

(16) 花旗银行（中国）有限公司

地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦主楼 28 楼 01A 单元、
02A 单元和 04 单元，29 楼 02 单元，30 楼 01 单元，32 楼 01 单元和 01B 单元，
33 楼 01 单元和 03 单元，34 楼 01 单元及 35 楼

法定代表人：欧兆伦（AU SIU LUEN）

联系人：陈莹

电话：021-28966000

传真：021-28963332

客户服务热线：800 8301 880

公司网站：www.citibank.com.cn

(17) 江苏江南农村商业银行

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：96005

公司网站：www.jnbank.com.cn

(18) 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

(19) 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

(20) 国泰君安证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区商城路 618 号

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) 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, 4008895523

联系人：黄莹

网址：www.swhysc.com

(22) 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

(23) 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

(24) 兴业证券股份有限公司

地址：福建省福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

(25) 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

电话：95579、4008888999

联系人：奚博宇

网址：www.95579.com

(26) 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

(27) 广发证券股份有限公司

法定代表人：孙树明

注册地址：广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州市天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：www.gf.com.cn

(28) 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

(29) 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

(30) 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、4008-888-888

联系人：邓颜

网址：www.chinastock.com.cn

(31) 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

(32) 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

(33) 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 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 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

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

联系人：谭磊

网址：www.txsec.com

(35) 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

(36) 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

(37) 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：张佑君

电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

(38) 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：许刚

客户服务电话：400-6208-888, 021-61195566

联系人：王炜哲

网址：www.bocichina.com.cn

(39) 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.cscso.com.cn

(40) 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

(41) 恒泰证券股份有限公司

地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：庞介民

电话：4001966188

联系人：张同亮

网址：www.cnht.com.cn

(42) 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：400-887-8827

联系人：冯爽

网址：www.ubssecurities.com

(43) 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楼

法定代表人：王宜四

电话：4008895335, 95335

联系人：史江磊

网址：www.scstock.com

(44) 国元证券股份有限公司

地址：安徽省合肥市梅山路18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

(45) 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

(46) 中泰证券股份有限公司

地址：山东省济南市市中区经七路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

(47) 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: <http://www.firstcapital.com.cn>

(48) 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: 400-888-1551

联系人: 胡莹

网址: www.xcsc.com

(49) 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

(50) 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 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/>

(51) 中国国际金融股份有限公司

地址: 北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 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

(52) 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

(53) 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

(54) 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

(55) 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

(56) 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：何其聪

客户服务电话：95571

联系人：郭军瑞

网址：www.foundersec.com

(57) 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7-8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

(58) 东莞证券有限责任公司

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) 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: 400-651-5988

联系人: 王兆权

网址: www.ewww.com.cn

(60) 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西路5号广州国际金融中心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

(61) 上海证券有限责任公司

地址: 上海市四川中路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, 021-962518

联系人: 邵珍珍

网址: www.962518.com

(62) 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

(63) 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：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

（64）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：400-666-1618

联系人：张治国

网址：www.i618.com.cn

（65）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：400-818-8118

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

（66）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：4008-888-993

联系人：汤漫川

网址：www.dxzq.net

（67）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：95317、400-88-35316

联系人：郭磊

网址：www.cfzq.com

（68）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.msza.com/>

(69) 华龙证券有限责任公司

地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 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）、4006898888（全国）

联系人：范坤

网址：<http://www.hlzq.com>

(70) 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三十、三十一层

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

(71) 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

(72) 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：95358

联系人：虞哲维

网址：www.grzq.com

(73) 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

(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：贾绍君

客户服务电话：40088-11177

联系人：周艳琼

网址：<http://www.xzsec.com/>

(75) 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：<http://www.s10000.com/>

(76) 太平洋证券股份有限公司

地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

法定代表人：李长伟

客户服务电话：4006650999

联系人：谢兰

网址：<http://www.tpyzq.com/>

(77) 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

(78) 开源证券股份有限公司

地址：西安市锦业路 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

(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：4008-211-357

联系人：秦臻

网址：<http://www.huajinsc.cn/>

（80）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：韩志谦

户服务电话：4008000562

网址：www.hysec.com

（81）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：<http://www.citicsf.com/>

（82）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：<http://www.tfzq.com>

（83）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号川信大厦10楼

法定代表人：吴玉明

客户服务电话：4008366366

联系人：张鋈

网址：<http://www.hxzq.cn>

（84）大同证券有限责任公司

地址：山西省太原市小店区长治路111号12、13层

法定代表人：董祥

客户服务电话：4007121212

联系人：薛津

网址：<http://www.dtsbc.com.cn>

(85) 首创证券有限责任公司

地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号

法定代表人：吴涛

客户服务电话：4006200620

联系人：刘宇

网址：www.sczq.com.cn

(86) 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

(87) 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

(88) 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

(89) 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：400-820-2899

公司网站：www.erichfund.com

(90) 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

(91) 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

(92) 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

(93) 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

(94) 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

(95) 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：付少帅

网址：www.wy-fund.com

(96) 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/>

(97) 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

(98) 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

客服电话：4000-466-788

联系人：陈东

网址：<http://www.66zichan.com/>

(99) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

法定代表人：罗细安

客服电话：400-001-8811

联系人：史丽丽

网址：<http://www.zcvc.com.cn/>

(100) 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

(101) 上海汇付金融服务有限公司

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：www.chinapnr.com

(102) 嘉实财富管理有限公司

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/>

(103) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

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>

(104) 上海利得基金销售有限公司

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>

(105) 珠海盈米财富管理有限公司

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

(106) 北京恒天明泽基金销售有限公司

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：王海焜

网址：www.chtfund.com

(107) 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：陈铭洲

网址：www.jimubox.com

(108) 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：www.dtfortune.com

(109) 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：程晨

网址：<https://www.lu.com>

(110) 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/>

(111) 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：王哲宇

网址：<http://www.vworks.com.cn>

(112) 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/>

(113) 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

(114) 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

(115) 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

(116) 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>

(117) 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/>

(118) 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

(119) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504

法定代表人：陈洪生

客服电话：400-918-0808

联系人：蔡之帆

网址：www.xds.com.cn

(120) 北京新浪仓石基金销售有限公司

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/>

(121) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

法定代表人：陈超

客服电话：95118 / 400-098-8511

联系人：赵德赛

网址：<http://fund.jd.com>

(122) 凤凰金信（银川）投资管理有限公司

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

(123) 深圳市金斧子投资咨询有限公司

地址：深圳市南山区南山街道科苑路 18 号东方科技大厦 18F

法人代表：陈姚坚

客服电话：400-9500-888

联系人：张烨

网址：www.jfzinv.com

(124) 上海华夏财富投资管理有限公司

地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

法人代表：李一梅

客服电话：400-817-5666

联系人：穆文燕

网址：www.amcfortune.com

(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) 律师事务所

名称：北京市金杜律师事务所

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）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

第四节 基金的名称

本基金名称：海富通收益增长证券投资基金

第五节 基金类型

基金类型：契约型开放式基金

第六节 基金的投资目标

本基金的投资目标为：建立随时间推移非负增长的收益增长线，运用优化组合保险机制实现风险预算管理，力争基金份额净值高于收益增长线水平。在此基础上，通过精选证券和适度主动地把握市场时机，将中国经济的高速成长转化为基金资产的长期稳定增值。

第七节 投资方向

本基金为混合型基金。本基金的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。在正常市场情况下，本基金投资组合的基本范围：股票资产 0—80%，债券资产 20—100%，权证投资 0—3%；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。可转换债券具有与本基金相似的风险收益特征，在条件成熟时将成为本基金的重点投资对象。

第八节 投资策略

本基金采用金融工程化投资管理策略。整体投资策略分为三个层次：第一层次，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

债券和股票间的配置比例，实现风险预算管理、降低系统性风险，保证基金投资目标的实现；第二层次，采用自上而下的策略，以久期管理为核心，从整体资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次进行积极主动的债券投资管理，保证基金份额净值超越收益增长线；第三层次，从定价指标、盈利预测指标和流动性指标三个方面，积极主动精选个股和构建分散化的股票组合，控制非系统性风险，充分获取股市上涨收益。

1. 资产配置策略

本基金将采用优化组合保险策略，在固定比例组合保险机制（CPPI）框架下适度把握市场时机，并辅以 VaR 控制仓位上界，合理配置基金资产，防止基金份额净值跌破收益增长线。

本基金的固定比例组合保险机制是指以收益增长线为保险目标，将基金资产净值超过收益增长线水平的固定倍数进行股票投资。公式如下：

其中，W 表示基金的股票投资额，M 表示 CPPI 乘数，NAV 表示基金份额净值，I 为收益增长线的数值。

本基金将对上述 CPPI 机制进行优化：一是在对中国证券市场进行实证分析的基础上，以基金份额净值不跌破收益增长线为前提，确定合理的 CPPI 乘数区间；二是运用多因素分析系统研判市场趋势，为选定具体的 CPPI 乘数值和组合保险策略的优化提供决策依据，同时，在实际操作过程中将周期调整和幅度调整有机结合，以更多参与股票市场上涨收益，更有效控制市场下跌风险。

本基金原则上在市场趋势明确的情况下把握市场时机，在纪律的基础上融合投资管理团队的能动性。此外，将运用不同期限 VaR，控制基金的股票投资仓位上界，严格控制风险。

2. 债券投资策略

本基金的债券投资对象包括国债、金融债、企业债（包括可转换债）和债券回购等。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，采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利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。

3. 精选股票策略

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和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特征的股票，构建分散化的股票投资组合。

基金经理和分析师将不间断地对上市公司进行跟踪分析，及时更新上市公司的经营和财务数据，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。

4. 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，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。

（一）收益增长线

本基金管理人将采用风险预算管理和组合保险策略，建立一条随时间推移呈现非负增长的安全收益增长曲线，即收益增长线。

1. 收益增长线的确定

收益增长线按日历计算的每 180 天进行调整。当期收益增长线的提升幅度按照上期基金份额净值增长率的 60% 和上期期末日收益增长线的绝对水平来确定，当期任何一天的收益增长线水平为上期期末和当期期末的收益增长线水平的线性插值。如果上期基金份额净值为零或负增长，则当期收益增长线保持上期期末水平。如果当期基金分红，则分红除权日之后（含分红除权日），收益增长线水平扣除分红额向下调整。收益增长线自本基金开放之日起计算，在起始期内 180 天的水平固定为 0.92。收益增长线在 $t+1$ 期第 T 日的水平为：

其中， t ：收益增长线的调整期（ $t \geq 1$ ）；

T ： $t+1$ 期的第 T 日（ $0 \leq T \leq 180$ ）；

TD： $t+1$ 期的分红除权日；

$I_{t+1}(T)$ ：收益增长线在 $t+1$ 期第 T 日的水平；

$NAV_1(0)=1$; $I_1(T)=0.92$; $I_{t+1}(0)=I_t(180)$;

$NAV_t(T)$: t 期第 T 日的复权基金份额净值。

如果 $T < TD$, $=0$

如果 $T \geq TD$, 为 t+1 期内第 n 次单位分红

2. 收益增长线的非正常调整

如果发生不可抗力导致基金份额净值下降, 则收益增长线根据该不可抗力的影响相应向下调整。不可抗力对基金份额净值的影响由基金管理人估算, 经基金托管人复核后确定, 收益增长线根据该不可抗力的影响向下调整须报持有人大会批准。

3. 收益增长线的披露

在经过基金托管人核对无误后, 本基金管理人将收益增长线水平和基金份额净值同时向公众披露。

(二) 风险收益特征

本基金属于证券投资基金中风险较低的产品, 追求风险预算目标下基金资产增值的最大化。鉴于中国资本市场的局限性, 本基金管理人力争将基金份额净值跌破收益增长线的情况控制为小概率事件, 并承诺:

经基金管理人、基金托管人确认后, 如果基金份额净值低于收益增长线, 则基金管理人将从基金份额净值低于收益增长线的下一日开始直至基金份额净值不低于收益增长线的当日止期间暂停收取管理费, 在此期间如遇法定节假日, 将同样暂停收取管理费。基金份额净值低于收益增长线指计算公式中的 $NAV_t(T) < I_t(T)$;

(三) 投资管理程序

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。具体的投资管理程序如下:

1. 投资部策略分析师、股票分析师、定息产品分析师、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. 投资策略月会根据策略分析师、股票分析师、债券分析师和定量分析师对宏观经济、行业发展和投资组合的风险程度确定优化组合保险策略的相关参数值;
3. 投资每周例会根据定量分析师按照组合保险策略计算出资产配置比例, 结合策略分析师、股票分析师和债券分析师对市场和公司基本面的分析, 决定具体的资产配置方案;
4. 基金经理依据策略分析师的宏观经济分析和策略建议、股票分析师的行业分

析和个股研究、定息产品分析师的债券市场研究和券种选择、定量分析师对资产配置的数量分析，结合本基金产品定位及风险控制的要求，在权限范围内制定具体的投资组合方案；

5. 基金经理根据基金投资组合方案，向集中交易室下达交易指令；
6. 集中交易室执行基金经理的交易指令，对交易情况及时反馈，对投资指令进行监督；
7. 基金经理对基金投资组合及资金运用情况进行跟踪，并根据市场变化、实际交易情况及各分析师的追踪研究和建议，在权限范围内及时调整投资组合；
8. 定量分析师负责在优化投资组合保险模型的基础上对投资组合进行每日的跟踪与风险评估，同时开发和完善内部风险控制系统，并完成有关投资风险监控报告；
9. 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。
10. 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作出调整。

第九节 业绩比较基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准是 MSCI China A 指数, 债券投资部分的业绩比较基准是上证国债指数。基金业绩比较基准参照 MSCI China A 指数 \times 40%+上证国债指数 \times 60%。

本基金管理人认为，本基金的业绩比较基准所引述 MSCI China A 指数和上证国债指数符合下列条件：

- 1、合理、透明，为广大投资者所接受；
- 2、有一定市场覆盖率，并且不易被操纵；
- 3、业绩基准的编制和发布有一定的历史；
- 4、业绩基准有较高的知名度和市场影响力。

第十节 风险收益特征

本基金属于证券投资基金中风险较低的产品，追求在风险预算目标下基金资产增值的最大化。

第十一节 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年4月5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12月31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 1,696,072,771.52 73.93

其中：股票 1,696,072,771.52 73.93

2 固定收益投资 437,408,640.00 19.07

其中：债券 437,408,640.00 19.07

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 --

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 30,850,041.85 1.34

7 其他资产 129,793,140.66 5.66

8 合计 2,294,124,594.03 100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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 26,993,892.00 1.19

B 采矿业 112,106,062.20 4.94

C 制造业 1,084,004,352.59 47.81

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 310,982,523.10 13.71

F 批发和零售业 102,866.50 0.00

G 交通运输、仓储和邮政业 61,786,538.64 2.72

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业

4,394,500.00 0.19

J 金融业 80,632,198.30 3.56
 K 房地产业 --
 L 租赁和商务服务业 --
 M 科学研究和技术服务业 3,344,019.00 0.15
 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 11,725,819.19 0.52
 S 综合 --
 合计 1,696,072,771.52 74.80

2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
 本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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

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	000018	神州长城	18,200,320	194,743,424.00	8.59
2	601233	桐昆股份	6,811,700	97,816,012.00	4.31
3	002053	云南能投	3,500,387	67,172,426.53	2.96
4	002245	澳洋顺昌	6,926,742	61,786,538.64	2.72
5	002323	雅百特	3,929,101	59,486,589.14	2.62
6	002311	海大集团	3,862,849	58,135,877.45	2.56
7	601818	光大银行	14,567,530	56,959,042.30	2.51
8	002051	中工国际	2,476,113	56,752,509.96	2.50
9	000550	江铃汽车	1,842,879	49,757,733.00	2.19
10	600742	一汽富维	3,013,799	48,612,577.87	2.14

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	146,533,640.00	6.46
---	------	----------------	------

2	央行票据	--
3	金融债券	290,875,000.00 12.83
	其中：政策性金融债	290,875,000.00 12.83
4	企业债券	--
5	企业短期融资券	--
6	中期票据	--
7	可转债	--
8	同业存单	--
9	其他	--
10	合计	437,408,640.00 19.29

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	019533	16 国债 05	990,000	99,000,000.00	4.37
2	150207	15 国开 07	600,000	60,546,000.00	2.67
3	160204	16 国开 04	600,000	59,982,000.00	2.65
4	150401	15 农发 01	500,000	50,260,000.00	2.22
5	150418	15 农发 18	500,000	50,005,000.00	2.21

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,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 | 863,405.59 |
| 2 | 应收证券清算款 | 18,415,103.55 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 10,513,953.15 |
| 5 | 应收申购款 | 100,000,678.37 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 129,793,140.66 |

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金期末未持有处于转股期的可转换债券。

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。

第十二节 基金的业绩

基金业绩截止日为 2016 年 12 月 31 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。

1、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)	业绩比较基准收益率标准差 (4)	(1) - (3)	(2) - (4)
2004 年 3 月 12 日至 2004 年 12 月 31 日	-5.50%	0.41%	-11.85%	0.56%	6.35%	-0.15%
2005 年 1 月 1 日至 2005 年 12 月 31 日	1.38%	0.70%	5.10%	0.55%	-3.72%	0.15%
2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日	79.70%	0.93%	43.45%	0.56%	36.25%	0.37%
2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日	109.04%	1.79%	49.02%	0.96%	60.02%	0.83%
2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	-52.00%	1.97%	-28.00%	1.16%	-24.00%	0.81%
2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	52.04%	1.37%	34.03%	0.81%	18.01%	0.56%
2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	7.54%	1.14%	-0.90%	0.62%	8.44%	0.52%
2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	-20.43%	0.96%	-9.35%	0.52%	-11.08%	0.44%
2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	-3.28%	0.95%	5.37%	0.52%	-8.65%	0.43%
2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	7.87%	1.19%	0.58%	0.54%	7.29%	0.65%
2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	3.58%	0.97%	20.49%	0.47%	-16.91%	

0.50%

2015年1月1日至2015年12月31日 37.15% 2.40% 9.42% 0.98% 27.73% 1.42%

2016年1月1日至2016年12月31日 -1.51% 1.56% -3.17% 0.60% 1.66% 0.96%

自基金合同生效起至2016年12月31日 227.99% 1.38% 132.29% 0.72% 95.70%

0.66%

2、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：

（2004年3月12日至2016年12月31日）

注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期。本基金自2007年8月7日至2007年11月1日为持续营销后建仓期。建仓期满至今本基金的各项投资比例已达到基金合同有关投资范围的规定，即股票资产0—80%、债券资产20—100%，同时满足第18章（七）有关投资组合限制的各项比例要求。

第十三节 基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、与基金运作有关的费用

1) 基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数};$$

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，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一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数};$$

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，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一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

3) 与基金运作有关的其他费用

主要包括证券交易费用、基金合同生效后的基金信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费。该等费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

2、与基金销售有关的费用

1) 申购费

本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金的申购与赎回”一章。

2) 赎回费

本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金的申购与赎回”一章。

3) 转换费

本基金转换费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金的转换”一章。

4) 销售服务费

基金管理人可以根据中国证监会的有关规定从基金财产中计提销售服务费，用于基金的持续销售和服务基金份额持有人。

3、其他费用

按照国家有关规定可以列入的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

(二) 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资产的损失，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。

(三) 基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费，经中国证监会核准后公告；此项调整无须召开基金份额持有人大会。

(四) 基金的税收

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。

第十四节 对招募说明书更新部分的说明

海富通收益增长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，对本基金原更新招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

一、“三、基金管理人”部分：

1. 更新了张文伟先生、陈虹女士、章明女士、李志女士的简历。
2. 删除了刘颂先生、阎小庆先生的简历。
3. 更新了投资决策委员会的相关信息。

二、“四、基金托管人”部分：对基金托管人的相关内容进行了更新。

三、“五、相关服务机构”部分：

- 1、基金份额销售机构：对部分销售机构的相关信息进行了更新。
- 2、注册登记人：对注册登记人的相关信息进行了更新。
- 3、会计师事务所：对会计师事务所的相关信息进行了更新。

四、“六、基金份额的申购与赎回”部分，对“（五）申购和赎回的数额和价格”进行了更新。

五、“九、基金的投资”和“十、基金的业绩”部分，根据2016年第四季度报告，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12月31日。

海富通基金管理有限公司

2017年4月25日