海富通稳健添利债券型证券投资基金

更新招募说明书摘要

（2010年第2号）

基金管理人：海富通基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

重要提示

海富通稳健添利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2008年7月28日中国证券监督管理委员会证监许可【2008】【985】号文核准募集。本基金的基金合同于2008年10月24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。

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，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书和基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2010年10月24日，有关财务数据和净值表现截止日为2010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：邵国有
成立时间：2003年4月18日
电话：021-38650999
联系人：包瑾
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（原名：富通基金管理公司”。与外方股东更名相关的变更程序目前正在办理之中。下同）49%。

（二）主要人员情况

邵国有先生，董事长、副教授。历任吉林大学校党委副书记、长春师范学院校党委书记、长春新世纪广场有限公司副董事长兼总经理、海通证券股份有限公司宣传培训中心总经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事长。

吉宇光先生，董事，硕士，高级经济师。历任交通银行北京分行办公室副主任、交通银行北京分行证券部经理、海通证券北京朗家园营业部总经理等职。1997年至今任海通证券股份有限公司副总裁。

艾德加（Stewart Edgar）先生，董事，英国籍，学士。历任英国Ivory & Sime公共有限公司基金经理、美国Fiduciary国际信托公司研究部主任、高级副总裁、美国HD国际有限公司高级基金经理、董事、美国F&C管理公司高级基金经理、董事。1997年至今任法国巴黎投资管理BE控股公司董事总经理。

田仁灿先生，董事、总经理，比利时籍，工商管理硕士。历任法国金融租赁Euroequipement S.A.公司总裁助理、富通银行区域经理、大中华地区主管、富通基金管理亚洲有限公司投资经理、业务发展部总经理、首席执行官。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

张文伟先生，董事、副总经理，硕士，高级经济师。历任交通银行郑州分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长、海通证券办公室主任、海通证券投资银行总部副总经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、副总经理。

董文标先生，独立董事，硕士。历任交通银行郑州分行党委书记、行长，中国民生银行党委委员、副行长，中国民生银行党委书记、行长，现任中国民生银行董事长、党委书记。

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，现任商学院院长。

巴约特（Marc Bayot）先生，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授，EFAMA（欧洲基金和资产管理协会）和比利时基金公会名誉主席，INVESTPROTECT公司（布鲁塞尔）董事总经理、Pionner投资公司（米兰，都柏林，卢森堡）和Degroof资产管理（布鲁塞尔）独立董事、基金联合公会（纽本哈根）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，现任上海大众交通（集团）股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用（集团）股份有限公司董事长。

李础前先生，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省社联所属省新科技发展公司副总经理、海通证券计划财务部总经理、海通证券财务总监。

余毓繁先生，监事，英国籍，工商管理荣誉学士。历任比利时通用银行香港分行资金部司库、富通银行亚洲区环球金融市场业务主管、富通银行亚洲区商人银行董事总经理。现任富通银行香港分行行政总裁。

奚万荣先生，监事，经济学硕士。中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管、海通证券股份有限公司监察稽核部稽核员。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司稽核经理，监察稽核总监。

章明女士，督察长，硕士。历任加拿大BBCC Tech & Trade Int’l Inc公司高级财务经理、加拿大Future Electronics公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司督察长。

陈洪先生，副总经理兼投资总监，硕士。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司投资总监兼海富通精选混合基金经理，2005年7月至2006年9月任海富通股票基金经理，2006年3月至9月任海富通收益增长混合基金经理，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理，2007年2月至2007年8月任海富通风格优势股票基金经理，2007年4月至2007年8月任海富通精选贰号混合基金经理，2008年6月起任海富通中国海外股票（QDII）基金经理。

阎小庆先生，副总经理，硕士。历任中国人民银行上海分行经济师、富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部市场经理、法国农业信贷银行上海华东区首席代表、富通基金管理公司上海代表处首席代表、海富通基金管理有限公司市场总监，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

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月任海富通基金管理有限公司固定收益分析师，2005年1月至2008年2月担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，2007年10月起任固定收益组合管理部总监，2008年10月起任海富通稳健添利债券基金经理。

投资决策委员会常设委员有：田仁灿，总经理；陈洪，副总经理兼投资总监；蒋征，股票组合管理部总监；郭杰，股票组合管理部总监；邵佳民，固定收益组合管理部总监；戴德舜，研究总监；杜晓海，定量及风险管理总监。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

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：姜建清
注册资本：人民币334，018，850，026元
联系电话：010-66105799
联系人：蒋松云

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：邵国有
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、代销机构

（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（100032）
法定代表人：姜建清
客户服务中心电话：95588
电话：010-66107900
传真：010-66107914
联系人：刘业伟
网址：www.icbc.com.cn

（2）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：肖钢
电话：010-66596688
传真：010-66593777
客户服务电话：95566
网址：www.boc.cn

（3）中国建设银行股份有限公司
地址：北京市西城区金融大街25号
法定代表人：郭树清
客户服务电话：95533
联系人：张静
网址：www.ccb.com

（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：胡怀邦
客户服务电话：95559
联系人：曹榕
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：傅育宁
客户服务电话：95555
联系人：邓炯鹏
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：项俊波
客户服务电话：95599
传真：010-85109219
网址：www.abchina.com

（7）中国邮政储蓄银行有限责任公司
地址：北京市西城区宣武门西大街131号
法定代表人：陶礼明
客户服务电话：11185
传真：010-66415194
联系人：陈春林
网址：www.epsrb.com

（8）上海浦东发展银行股份有限公司
地址：上海市浦东新区浦东南路500号
法定代表人：吉晓辉
客户服务电话：95528
联系人：徐伟、汤嘉惠
网址：www.spdb.com.cn

（9）中信银行股份有限公司
地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：孔丹
客户服务电话：95558
联系人：王巍、李博
网址：www.ecitic.com/bank

（10）中国民生银行股份有限公司
地址：北京市东城区正义路4号
法定代表人：董文标
客户服务电话：95568
联系人：董云巍、吴海鹏
网址：www.cmbc.com.cn

（11）广东发展银行股份有限公司
地址：广州市农林下路83号
法定代表人：董建岳
客户服务电话：95508
联系人：俞全鑫 张大奕
网址：www.gdb.com.cn

（12）中国光大银行股份有限公司
地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人：王明权
客户服务电话：95595（全国）
联系人：李伟
网址：www.cebbank.com

（13）兴业银行股份有限公司
地址：福州市五一中路元洪大厦25层
法定代表人：高建平
客户服务电话：95561
联系人：梁曦
网址：www.cib.com.cn

（14）宁波银行股份有限公司
地址：宁波市江东区中山东路294号
法定代表人：陆华裕
客户服务电话：96528
联系人：胡技勋
网址：www.nbcb.com.cn

（15）浙商银行股份有限公司
地址：中国杭州市庆春路288号
法定代表人：张达洋
客户服务电话：95527
联系人：吴军阳
网址：www.czbank.com

（16）海通证券股份有限公司
地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：王开国
客户服务电话：021-95553或4008888001
联系人：李笑鸣
网址：www.htsec.com

（17）中信证券股份有限公司
地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人：王东明
电话：010-84588266
联系人：陈忠
网址：www.ecitic.com

（18）光大证券股份有限公司
地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
客户服务电话：400-8888-788
联系人：刘晨、李芳芳
网址：www.ebscn.com

（19）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：祝幼一
客户服务电话：400-8888-666
联系人：韩星宇
网址：www.gtja.com

（20）中信建投证券有限责任公司
地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
客户服务电话：400-8888-108
联系人：权唐
网址：www.csc108.com

（21）招商证券股份有限公司
地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：宫少林
客户服务电话：400-8888-111或95565
联系人：林生迎
网址：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99号标力大厦
法定代表人：兰荣
客户服务电话：400-8888-123
联系人：谢高得
网址：www.xyzq.com.cn

（23）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：万鸣
网址：www.htsc.com.cn

（24）华泰联合证券有限责任公司
地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦25、24、10层
法定代表人：马晓明
客户服务电话：400-8888-555、95513
联系人：盛宗凌
网址：www.lhzq.com

（25）广发证券股份有限公司
地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼
法定代表人：王志伟
客户服务电话：95575或致电各地营业网点
联系人：黄岚
网址：www.gf.com.cn

（26）长江证券股份有限公司
地址：武汉市新华下路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
客户服务电话：：4008-888-999或027-85808318
联系人：李良
长江证券客户服务网站：www.95579.com

（27）申银万国证券股份有限公司
地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
客户服务电话：962505
联系人：邓寒冰
网址：www.sywg.com.cn

（28）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：唐新宇
客户服务电话：400-6208-888
联系人：张静
网址：www.bocichina.com.cn

（29）东方证券股份有限公司
地址：上海市浦东大道720号20楼
法定代表人：潘鑫军
客户服务电话：95503
联系人：吴宇
网址：www.dfzq.com.cn

（30）国信证券股份有限公司
地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦
法定代表人：何如
客户服务电话：95536
联系人：齐晓燕
网址：www.guosen.com.cn

（31）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：顾伟国
客户服务电话：4008-888-888
联系人：田薇
网址：www.chinastock.com.cn

（32）平安证券有限责任公司
地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法定代表人：杨宇翔
客户服务电话：95511
联系人：袁月
网址：www.pal8.com

（33）世纪证券有限责任公司
地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人：卢长才
电话：0755-83199511
联系人：张婷
网址：www.csco.com.cn

（34）中信金通证券有限责任公司
地址：浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人：刘军
客户服务电话：0571-96598
联系人：俞会亮
网址：www.bigsun.com.cn

（35）中信万通证券有限责任公司
地址：青岛市市南区东海路28号
法定代表人：史浩民
客户服务电话：0532-96577
联系人：吴忠超
网址：www.zxwt.com.cn

（36）东北证券股份有限公司
地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：矫正中
客户服务电话：0431-96688
联系人：潘锴
网址：www.nesc.cn

（37）财通证券有限责任公司
地址：杭州市解放路111号财通证券
法定代表人：沈继宁
客户服务电话：0571-96336（上海地区962336）
联系人：乔俊
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
法定代表人：林义相
客户服务电话：400-887-8827
联系人：莫晓丽
网址：www.txsec.com

（39）国海证券有限责任公司
地址：广西南宁市滨湖路46号
法定代表人：张雅峰
客户服务电话：96100（广西）、4008888100（全国）
联系人：武斌
网址：www.ghzq.com.cn

（40）恒泰证券股份有限公司
地址：内蒙古呼和浩特市新城区东风路111号
法定代表人：刘汝军
电话：0471-4961259
联系人：张同兆
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：刘弘
客户服务电话：400-887-8827
联系人：谢亚凡
网址：www.ubssecurities.com

（42）中航证券有限责任公司
地址：江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人：姚江涛
电话：0791-6768763
联系人：戴蕾
网址：www.scstock.com

（43）国元证券股份有限公司
地址：安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人：凤良志
客户服务电话：0551-96888
联系人：陈琳琳
网址：www.gyzq.com.cn

（44）德邦证券有限责任公司
住所：上海市福山路500号城建大厦26层
法定代表人：方加春
客户服务电话：4008888128
联系人：罗芳
网址：www.tebon.com.cn

（45）宏源证券股份有限公司
公司注册地址：新疆乌鲁木齐市建设路2号
住所：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源证券
法定代表人：冯戎
客户服务电话：4008000562
联系人：李巍
网址：www.hysec.com

（46）齐鲁证券有限公司
地址：山东省济南市经十路128号
法定代表人：李玮
客户服务电话：95538
联系人：孙豪志
网址：www.qlzq.com.cn

（47）第一创业证券有限责任公司
地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人：刘学民
客户服务电话：4008881888
联系人：魏颖
网址：www.firstcapital.com.cn

（48）湘财证券有限责任公司
地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人：林俊波
客户服务电话：400-888-1551
联系人：鲁雁先
网址：www.xcsc.com

（49）安信证券股份有限公司
地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴
客户服务电话：400-800-1001
联系人：陈剑虹
网址：www.essence.com.cn

（50）中国建银投资证券有限责任公司
地址：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层
法定代表人：杨小阳
客户服务电话：400-600-8008
联系人：刘权
网址：www.cjis.cn

（51）中国国际金融有限公司
地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：李剑阁
公司总机：010-65051166（北京）；021-58796226（上海）
联系人：易建军
网址：www.cicc.com.cn

（52）中国民族证券有限责任公司
地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层-9层
法定代表人：赵大建
客户服务电话：400-889-5618
联系人：李薇
网址：www.e5618.com

（53）华宝证券有限责任公司
地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层
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：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
法定代表人：张志刚
客户服务电话：400-800-8899
联系人：唐静
网址：www.cindasc.com

（55）长城证券有限责任公司
地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
客户服务电话：400666888
联系人：匡婷
网址：www.cgws.com

（56）方正证券有限责任公司
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：张志刚
客户服务电话：95571
联系人：彭博
网址：www.foundersc.com

（57）广发华福证券有限责任公司
地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人：黄金琳
客户服务电话：96326
联系人：张腾
网址：www.gfhfzq.com.cn

（58）渤海证券股份有限公司
地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人：张志军
客户服务电话：400-651-5988
联系人：王兆权
网址：www.ewww.com.cn

（59）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：游锦辉
客户服务电话：961130
联系人：梁建伟
网址：www.dgzq.com.cn

（60）广州证券有限责任公司
地址：广州市越秀区先烈中路69号东山广场主楼17楼
法定代表人：吴志明
客户服务电话：020-961303
联系人：林洁茹
网址：www.gzs.com.cn

（61）上海证券股份有限公司
地址：上海市黄浦区西藏中路336号
法定代表人：郁忠民
客户服务电话：4008 169 169
联系人：陈翔
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
法定代表人：于宏民
客户服务电话：40089 18918，021-962518
联系人：谢立军
网址：www.daton.com.cn

（63）江海证券股份有限公司
地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
客户服务电话：400-666-2288
联系人：郭玲
网址：www.jhzq.com.cn

（64）山西证券股份有限公司
地址：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：张志国
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：常喆
客户服务电话：400-818-8118
联系人：黄静
网址：www.guodu.com

（66）东兴证券有限责任公司
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：崔海涛
客户服务电话：4008-888-993
联系人：黄英
网址：www.dxzq.net

（67）财富证券有限责任公司
地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人：周晖
电话：0731-84403360
传真：0731-84403330
联系人：朱友谊
网址：www.cfzq.com

（68）民生证券有限责任公司
地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A层
法定代表人：岳献春
客户服务电话：4006198888
联系人：赵明
网址：http://www.mszq.com/

（69）华龙证券有限责任公司
地址：甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人：李晓安
客户服务电话：0931 4890208
联系人：李昕田
网址：http://www.hlzqgs.com

（70）英大证券有限责任公司
地址：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：赵文安
客户服务电话：0755-26982993
联系人：王睿
网址：http://www.ydsc.com.cn

3、场内销售机构

具有开放式基金代销资格的、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）登载。

基金管理人可以根据需要，增加其他符合要求的机构代理销售本基金，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：北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人：金颖
电话：010-58598835
传真：010-58598907
联系人：任瑞新

（三）出具法律意见书的律师事务所

通力律师事务所
地址：上海市浦东南路528号证券大厦南塔21楼
负责人：韩炯
电话：021-68818100
传真：021-68816880
联系人：秦悦民
联系电话：021-68816880-6612
经办律师：秦悦民、傅轶

（四）审计基金财产的会计师事务所

普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦16楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法人代表：杨绍信
经办注册会计师：薛竞、徐振晨
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：徐振晨

四、基金的名称

本基金的名称：海富通稳健添利债券型证券投资基金

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：在强调本金安全的基础上，积极追求资产长期稳健的增值。

七、投资方向和范围

本基金投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具；依法公开发行、上市的债券，包括国债，金融债，公司债券，可转换债券等；资产支持证券；中央银行票据；债券回购；银行定期存款，大额存单；以及中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的80%。

为了提高收益水平，本基金还可以投资于新股申购、持有可转债转股所得股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但上述非固定收益类金融工具的投资比例不超过基金资产的20%，本基金不直接从二级市场买入股票。本基金持有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、投资策略

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、久期管理策略是根据对利率水平的预期，确定组合的平均剩余期限。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的平均剩余期限，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的剩余期限。

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，即确定债券、存款、回购以及现金等资产的比例。类属配置主要根据各部分的相对投资价值确定，增持相对低估、价格将上升的类属，减持相对高估、价格将下降的类属，借以取得较高的总回报。

4、采取现金流管理策略，在动态分析、规划、测算组合的生现金流、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、债券市场的无风险套利策略

债券市场的无风险套利策略包括跨市场套利策略、跨品种套利策略和回购杠杆策略，以实现在同等风险程度下的更高收益。

6、创新产品价差收益

随着公司债等固定收益创新产品的发行启动，不仅为我国企业的直接融资提供了新的工具，也为基金产品提供了创新发展的机遇。以公司债为例，从理论上讲，公司债与国债之间的利差是产生超额收益的来源，这种利差主要用于补偿公司债的违约损失，历史数据也表明公司债利差和公司违约率之间存在非常明显的正相关关系，除此之外，税收、风险溢价和流动性溢价是公司债利差的主要组成部分。本基金将通过相关研究和分析，积极把握该类产品存在的超额收益和套利机会。

7、股票投资策略

本基金的股票部分投资将以参与新股申购为主。实证研究表明，长期参与新股投资，存在较显著的低风险超额收益机会。特别是在国内A股市场，新股发行还是稀缺资源的背景下，新股申购和增发是降低投资组合风险，增强收益的良好渠道。因此，本基金将运用精选策略，积极参与新股申购来取得较高的低风险收益。

8、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。

未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，在相关法律法规的允许前提下，本基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。

9、投资决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作，又责任明确，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的决策流程如下：

（1）投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规，决定公司针对市场环境重大变化所采取的对策；决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整；对旗下基金重大投资的批准与授权等。

（2）投资总监在公司有关规章制度授权范围内，对重大投资进行审查批准；并且根据基金合同的有关规定，在组合业绩比较基准的基础上，制定各组合资产和行业配置的偏差度指标。

（3）分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本面等进行分析，提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。

（4）定期不定期召开基金经理例会，基金经理们在充分听取各分析师意见的基础上，确立公司对市场、资产和行业的投资观点，该投资观点是指导各基金进行资产和行业配置的依据。

（5）基金经理在投资总监授权下，根据基金经理例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标，在充分听取策略分析师宏观配置意见、股票分析师行业配置意见及固定收益分析师的债券配置意见，进行投资组合的资产及行业配置；之后，在债券分析师设定的债券池内，根据所管理组合的风险收益特征和流动性特征，构建基金组合。

（6）基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

（7）定量分析师负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。

（8）定量分析师负责完成内部基金业绩评估，并完成有关评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要，对上述投资管理程序做出调整。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中证全债指数。

中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标，为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。

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股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、风险收益特征

本基金为债券型基金，属于中低风险品种。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2010年11月22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2010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	89,662,470.94	5.30
	其中：股票	89,662,470.94	5.30
2	固定收益投资	1,400,149,145.88	82.77
	其中：债券	1,400,149,145.88	82.77
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	56,568,165.18	3.34
6	其他各项资产	145,302,293.05	8.59
7	合计	1,691,682,075.05	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	3,241,688.10	0.19
B	采掘业	4,100,400.00	0.24
C	制造业	34,310,373.94	2.04
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	9,110,576.64	0.54
C5	电子	9,159,168.24	0.54
C6	金属、非金属	1,999,970.10	0.12
C7	机械、设备、仪表	12,719,166.67	0.76
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	1,321,492.29	0.08
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,649,120.90	0.34
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	20,105.00	0.00
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	1,673,433.90	0.10
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	40,667,349.10	2.42
	合计	89,662,470.94	5.33

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	601718	际华集团	8,299,459	40,667,349.10	2.42
2	601717	郑煤机	287,179	9,140,907.57	0.54
3	002455	百川股份	323,529	9,110,576.64	0.54
4	300111	向日葵	277,626	6,313,215.24	0.38
5	002482	广田股份	85,515	5,649,120.90	0.34
6	601101	昊华能源	120,000	4,100,400.00	0.24
7	300105	龙源技术	28,786	2,331,666.00	0.14
8	002460	赣锋锂业	34,170	1,999,970.10	0.12
9	002477	雏鹰农牧	34,932	1,804,237.80	0.11
10	002469	三维工程	37,437	1,673,433.90	0.10

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	317,433,315.00	18.88
2	央行票据	392,200,000.00	23.33
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	536,922,389.40	31.93
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	153,593,441.48	9.14
7	其他	-	-
8	合计	1,400,149,145.88	83.28

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1001019	10央行票据19	2,000,000	196,100,000.00	11.66
	1001015	10央行票据15	2,000,000	196,100,000.00	11.66
3	019001	10国债01	1,000,000	99,960,000.00	5.95
	019021	10国债21	1,000,000	99,960,000.00	5.95
5	126011	08石化债	1,000,000	90,730,000.00	5.40

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

（1）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

（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。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	171,065.59
2	应收证券清算款	132,730,841.80
3	应收股利	-
4	应收利息	12,118,446.48
5	应收申购款	281,939.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	145,302,293.05

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601718	际华集团	40,667,349.10	2.42	新股流通受限
2	601717	郑煤机	9,140,907.57	0.54	新股流通受限
3	002455	百川股份	9,110,576.64	0.54	新股流通受限
4	300111	向日葵	6,313,215.24	0.38	新股流通受限
5	002482	广田股份	5,649,120.90	0.34	新股流通受限
6	300105	龙源技术	2,331,666.00	0.14	新股流通受限
7	002460	赣锋锂业	1,999,970.10	0.12	新股流通受限
8	002477	雏鹰农牧	1,804,237.80	0.11	新股流通受限
9