海富通收益增长证券投资基金更新招募说明书摘要

（2011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2011年3月12日，有关财务数据和净值表现截止日为2010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：邵国有
设立时间：2003年4月1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：包瑾

（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、英国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，比利时富通基金管理公司董事总经理，法国巴黎投资管理公司亚太区行政总裁。

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（伦兰，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（哥本哈根）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基金经理，2005年7月至2006年9月任海富通股票基金基金经理，2006年3月至9月任海富通收益增长混合基金基金经理，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基金经理，2007年4月至2007年8月任海富通精选或弓混合基金基金经理，2008年6月至2011年2月任海富通中国海外股票（QDII）基金基金经理。

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。

蒋征先生，硕士。历任中国保险信托投资公司业务经理，嘉实基金管理有限公司丰和证券投资基金基金经理助理，2003年1月至2004年4月任泰和证券投资基金基金经理，2004年8月至2006年5月任华夏基金管理有限公司华夏大盘精选证券投资基金基金经理，2005年12月至2006年5月任基金兴安证券投资基金基金经理。2006年6月加入海富通基金管理有限公司，2006年9月起任海富通强化回报混合基金基金经理，2007年2月至2009年1月任海富通股票基金基金经理，2007年10月起任股票组合管理部总监，2009年1月起兼任海富通收益增长混合基金基金经理，2010年9月起兼任海富通上证周期ETF基金和海富通上证周期ETF联接基金基金经理。

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；牟永宁先生，任职时间为2009年1月至2011年4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：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。

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：
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
变更注册登记日期：2004年8月26日
注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元
法定代表人：肖钢
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管及投资者服务部总经理：董杰
托管部门联系人：唐州徽
电话：（010）66594855
传真：（010）66594942

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：邵国有
总经理：田仁灿
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：喻群
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

（2）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

（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（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

（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
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）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
联系人：梁曦
网址：www.cib.com.cn

（8）深圳发展银行股份有限公司
地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：肖遂宁
客户服务电话：95501
联系人：姜聃
网址：www.sdb.com.cn

（9）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

（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

（11）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
网址：www.cmbc.com.cn

（12）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：翁金鑫 张大奕
网址：www.gdb.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：张达洋
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：胡技勤
网址：www.nbcb.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）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）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

（18）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：021-962588、400-8888-666
联系人：韩星宇
网址：www.gtja.com

（19）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

（20）中信建投证券有限责任公司
地址：北京朝阳区安立路66号4号楼
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）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
电话：95579或4008-888-999
联系人：李良
网址：www.95579.com

（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：马昭明
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）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

（27）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16层到26层
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

（28）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

（29）平安证券有限责任公司
地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
客户服务电话：4008816168
联系人：郑舒丽
网址：www.pingan.com

（30）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

（31）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：史洁民
客户服务电话：电话：0532-96577
联系人：吴忠超
网址：www.zxwt.com.cn

（32）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

（33）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

（34）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

（35）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

（36）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

（37）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

（38）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

（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：021-4961259
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：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：杜航
电话：4008866567
联系人：余雅娜
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
注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路2号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：汤世生
客户服务电话：4008-000-562
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：孙蒙志
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：陈学荣
客户服务电话：400-888-1551
联系人：鲁雁兆
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.cnhhstock.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.founderse.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.ghhfzq.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：游锦辉
客户服务电话：961130
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：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
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）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
联系人：李昕田
客服电话：0931 4890208
公司网站：www.hlzqgs.com

（62）江海证券有限公司
办公地址：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：郭玲
客服电话：400-666-2288
公司网站：www.jhzq.com.cn

（63）财富证券有限责任公司
办公地址：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
联系人：朱友谊
客服电话：0731-4403360
公司网站：www.cfzq.com

（64）山西证券股份有限公司
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：张治国
客服电话：400-666-1618
公司网站：www.i618.com.cn

（65）民生证券有限责任公司
地址：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
联系人：赵明
客服电话：4006198888
公司网站：www.mszq.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）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
联系人：谢立军
客服电话：40089 18918，021-962518
公司网站：www.estock.com.cn

（68）上海证券有限责任公司
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

（69）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

（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9楼
法定代表人：况雨林
客户服务电话：0871 - 3577888
联系人：刘晓明
网址：www.hongtastock.com

（71）日信证券有限责任公司
地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人：孔伯杰
客户服务电话：010-88086830
联系人：陈韦杉
网址：http://www.rxzq.com.cn

（72）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

（73）中山证券有限责任公司
地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人：吴永良
客户服务电话：0755-82943750
联系人：李玲
网址：www.zszq.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：北京西城区金融大街27号投资广场22层
法定代表人：金颖
电话：010-59378835
传真：010-59378907
联系人：任瑞新

（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39号建外SOHU A座31层
负责人：王玲
电话：010-58785588
传真：010-58785599
联系人：宋萍萍
联系电话：0755-82125533
经办律师：靳庆军、宋萍萍

（四）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
法人代表：杨绍信
经办注册会计师：薛竞、金毅
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：金毅

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：

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：

[illegible]

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NAVt（T）@<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定量分析，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×40%+上证国债指数×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2011年4月7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2010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	3，114，021，549.55	75.00
	其中：股票	3，114，021，549.55	75.00
2	固定收益投资	862，560，759.40	20.77
	其中：债券	862，560，759.40	20.77
	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	143，293，529.65	3.45
6	其他各项资产	32，232，237.83	0.78
7	合计	4，152，108，076.43	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	81，738，712.90	2.01
B	采掘业	83，976，251.14	2.07
C	制造业	1，549，161，975.72	38.17
C0	食品、饮料	289，890，460.82	7.14
C1	纺织、服装、皮毛	75，442，605.44	1.86
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	21，290，528.48	0.52
C4	石油、化学、塑胶、塑料	261，221，692.90	6.44
C5	电子	127，774，023.53	3.15
C6	金属、非金属	133，407，652.05	3.29
C7	机械、设备、仪表	427，408，269.11	10.53
C8	医药、生物制品	212，726，743.39	5.24
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	20，353，778.70	0.50
F	交通运输、仓储业	37，161，546.90	0.92
G	信息技术业	389，118，878.97	9.59
H	批发和零售贸易	106，065，841.77	2.61
I	金融、保险业	432，124，655.83	10.65
J	房地产业	209，812，561.02	5.17
K	社会服务业	11，341，984.68	0.28
L	传播与文化产业	5，637，484.00	0.14
M	综合类	187，527，877.92	4.62
	合计	3，114，021，549.55	76.73

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	601989	中国重工	17，643，594	208，017，973.26	5.13
2	600406	国电南瑞	2，725，123	196，372，363.38	4.84
3	600415	小商品城	5，351，823	187，527，877.92	4.62
4	601318	中国平安	3，099，781	174，083，700.96	4.29
5	000002	万科A	17，799，886	146，315，062.92	3.61
6	000858	五粮液	3，299，713	114，269，061.19	2.82
7	600036	招商银行	7，689，705	98，505，121.05	2.43
8	002014	永新股份	3，910，548	92，836，409.52	2.29
9	600585	海螺水泥	2，959，775	87，846，122.00	2.16
10	000063	中兴通讯	3，089，847	84，352，823.10	2.08

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	7，630，759.40	0.19
2	央行票据	443，235，000.00	10.92
3	金融债券	411，695，000.00	10.14
	其中：政策性金融债	411，