华富收益增强债券型证券投资基金招募说明书更新（摘要）

（2011年第2号）

基金管理人：华富基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2008年3月2日证监许可［2008］320号文核准募集。本基金基金合同已于2008年5月28日生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负担。

投资有风险，投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。

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。

基金招募说明书自基金合同生效日起，每6个月更新一次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2011年11月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2011年9月30日。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：华富基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
邮政编码：200120
法定代表人：章宏韬
设立日期：2004年4月19日
核准设立机关：中国证监会
核准设立文号：中国证监会证监基金字［2004］47号
组织形式：有限责任公司
注册资本：1.2亿元人民币
存续期间：持续经营
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务
联系人：尤艳
电话：021-68886996
传真：021-68887997
股权结构：华安证券有限责任公司49%、安徽省信用担保集团有限公司27%、合肥兴泰控股集团有限公司24%

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

章宏韬先生，董事长，本科学历，工商管理硕士学位。历任安徽省农村经济管理干部学院政治处职员，安徽省农村经济委员会调查研究处秘书、副科秘书，安徽证券交易中心综合部（办公室）经理助理、副经理（副主任），安徽省证券公司肥东城路营业部总经理，华安证券有限责任公司总裁办副主任、总裁助理兼办公室主任、现任华安证券有限责任公司党委委员、副总裁，华安期货有限责任公司董事。

李工先生，董事，本科学历，香港浸会大学工商管理硕士学位。历任合肥市财政局副科长、科长、副局长，合肥市信托投资公司总经理兼党支部书记，合肥市政府副秘书长、合肥市财政局党组书记，合肥市商业银行董事长、党组书记、行长，合肥市政府副秘书长、党组副书记，合肥市政府办公厅主任，中共肥西县委书记、肥西县人大常委会主任，安徽省农村信用联合社副理事长、副主任。现任华安证券有限责任公司党委书记、董事长，华安期货有限责任公司董事。

杨新潮先生，董事，大学学历，高级经济师。历任安徽省经贸委综合处、财金处调研员，安徽省经贸投资集团总经理，安徽省中小企业担保公司董事长、总经理。现任安徽省信用担保集团副总经理、安徽省科技产业投资公司董事长。

刘庆年先生，董事，大学本科学历。历任解放军某基部排长、指导员，副营职干事，合肥市财政局任党组秘书，合肥高新技术开发区财政局副局长（主持工作），合肥市财政证券公司总经理（法人代表），国元证券寿春路第二营业部总经理、华富基金管理有限公司督察长。

刘瑞中先生，独立董事，研究生学历。历任安徽铜陵财专教师，中国经济体制改革研究所助理研究员、信息部主任，中国国际期货经纪有限公司任信息部经理，深圳公司副总经理，北京商品交易所常务副总裁，深圳特区证券公司《电子田证券》编辑顾问。现任北京华创投资管理有限公司总裁、中国社会科学院金融研究中心兼职研究员，深圳神华期货经纪有限公司独立董事。

陈庆平先生，独立董事，工商管理硕士。历任上海金融专科学校讲师、处长，中银证券公司哈尔滨营业部总经理，上海鑫兆投资管理咨询有限公司顾问，上海金融学院客座教授。现任宁波国际银行上海分行行长。

汪明华先生，独立董事，法律研究生学历。历任安徽省高级人民法院审判员、处长、主任，合肥市中级人民法院副院长，省高级法院经济庭、民二庭庭长等职。现任安徽承义应用法学研究所所长。

2、基金管理人监事会成员

王电道先生，监事会主席，本科学历。历任上海财经大学金融理论教研室助教、安徽省财政厅副主任科员、安徽信托投资公司部门经理、安徽省中小企业信用担保中心副主任、安徽省皖煤投资有限公司总经理。现任安徽省信用担保集团有限责任公司总经济师。

梅鹏军先生，监事，金融学博士。先后供职于安徽省国际经济技术合作公司，安徽省物资局（后更名为“安徽省徽商集团有限公司”），合肥兴泰控股集团有限公司。现任合肥兴泰控股集团有限公司金融研究所所长。

陈大毅先生，监事，研究生学历。先后供职于安徽省证券公司上海自忠路营业部、徐家汇路营业部，华安证券上海总部，华安证券网络经纪公司（筹）。现任华富基金管理有限公司总经理助理兼运作保障部总监。

3、基金高级管理人员及督察长

姚怀然先生，公司总经理，学学位，研究生学历。历任人民银行安徽省分行金融管理处主任科员，安徽省证券公司营业部经理、总办主任、总经理助理兼证券投资总部总经理，华安证券有限责任公司总裁助理兼证券投资总部总经理，华富基金管理有限公司董事长。

邹牧先生，公司副总经理，金融学博士。历任华夏证券公司投资银行部高级经理，首创证券董事会秘书兼总经理助理，大通证券北京营业部总经理，鹏华基金管理有限公司北京分公司副总、华富基金管理有限公司总经理助理兼市场总监、机构投资部总监等职。

满志红女士，公司督察长，管理学硕士，CPA。曾任道勤控股股份有限公司财务部总经理，华富基金管理有限公司监察稽核部副总监兼董事会秘书。

4、本基金基金经理简介

胡伟先生，中南财经政法大学经济学学士，曾在珠海市商业银行资金营运部从事债券研究及债券交易工作，2006年11月加入华富基金管理有限公司，历任债券交易员、华富货币市场基金基金经理助理，现任华富基金管理有限公司固定收益部副总监、投资决策委员会成员、华富货币市场基金基金经理，2011年10月10日起担任华富收益增强债券型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：

吴圣海先生，2008年5月28日至2009年9月15日担任华富收益增强债券型证券投资基金基金经理。

曾刚先生，2008年5月28日至2011年11月1日担任华富收益增强债券型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会是负责基金投资决策的最高权力机构，由公司分管投资业务的领导、涉及投资和研究的部门的业务负责人以及投资决策委员会认可的其他人员组成。投资决策委员会主席由公司分管投资业务的最高业务领导担任，负责投决会的召集和主持。

投资决策委员会成员姓名和职务如下：

程军先生	总经理助理兼首席投资官
姚怀然先生	总经理
陈茹女士	研究部总监
汪开振先生	非公募资产管理部筹备负责人
胡伟先生	固定收益部副总监

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）
住所：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：张建国（代行）
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字［1998］12号
联系人：尹　东
联系电话：（010）6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行《股票代码：939》于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为250,010,977,486股（包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股）。

截至2011年3月31日，中国建设银行资产总额113,125.16亿元，较上年末增加5,021.99亿元，增长4.65%。2011年一季度，中国建设银行实现净利润472.33亿元，较上年同期增长34.23%；年化平均资产回报率1.71%，年化加权平均净资产收益率26.19%；利息净收入716.30亿元，较上年同期增长25.27%；净利差为2.58%，净利息收益率为2.69%，分别较上年同期提高0.28和0.30个百分点；手续费及佣金净收入231.54亿元，较上年同期增长37.29%。其中，结算、理财、电子银行、贷记卡及保理等重点产品快速增长，收入结构日趋合理。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在英斯科设有代表处。设立了湖北横江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行、河北丰宁建信村镇银行、上海浦东建信村镇银行、苏州常熟建信村镇银行9家村镇银行，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、中德住房储蓄银行等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机（ATM）39,874台，拥有员工313,867人，为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，2010年共获得100多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的“全球商业银行品牌十强”列第二位，在“全球银行品牌500强”列第13位，并被评为2010年中国最佳银行；在美国《福布斯》杂志公布的“Interbrand2010年度最佳中国品牌价值排行榜”列第三位，银行业第一位；被《亚洲金融》杂志评为2010年度“中国最佳银行”；连续三年被香港《经济一周》杂志评为“中国杰出零售银行”；被中国红十字会总会授予“中国红十字杰出奉献奖章”。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队，涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：

名称：华富基金管理有限公司
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
联系人：李晔
咨询电话：400-700-8001，021-50619688
传真：021-68415680
网址：www.hffund.com

2、代销机构：

①中国建设银行股份有限公司
住所：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：张建国（代行）
联系人：王琳
客户服务电话：95533
传真：010-66275654
网址：www.ccb.com

②招商银行股份有限公司
住所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人：傅育宁
电话：0755-83198888
传真：0755-83195049
联系人：邓翔鹏
客服电话：95555
公司网址：http://www.cmbchina.com

③中国邮政储蓄银行有限责任公司
住所：北京市西城区宣武门西大街131号
办公地址：北京市西城区宣武门西大街131号
法定代表人：刘安东
联系人：陈春林
客服电话：11185
网址：www.psbc.com

④交通银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
客户服务热线：95559
联系人：林芳
传真：021-58408483
公司网址：www.bankcomm.com

⑤中国光大银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
办公地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人：唐双宁
联系人：李伟
客服电话：95595，或拨打各城市营业网点咨询电话。
网址：www.cebbank.com

⑥上海浦东发展银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
电话：021-61618888
传真：021-63604199
联系人：倪苏云、虞谷云
客户服务热线：95528
公司网址：www.spdb.com.cn

⑦中国民生银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
客户服务电话：95568
传真：010 87092611
联系电话：010 87092615
联系人：董云巍
网址：www.cmbc.com.cn

⑧中信银行股份有限公司
住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址：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：田国立
客服电话：95558
联系人：丰璐
电话：010-65557083
传真：010-65550827
网址：http://bank.ecitic.com

⑨北京银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址：北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人：闫冰竹
联系人：王澜
联系电话：010-66226045
客服电话：95526
公司网址：http://www.bankofbeijing.com.cn

⑩深圳发展银行股份有限公司
法定代表人：肖遂宁
地址：深圳市深南东路5047号
联系人：姜鹏
联系电话：0755-82088888
传真电话：0755-82080714
客户服务电话：95501
公司网址：www.sdb.com.cn

⑪中国农业银行股份有限公司
法定代表人：项俊波
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
联系人：李芳菲
电话：010-68424199
客服电话：95599
网址：www.abchina.com

⑫华夏银行股份有限公司
住所：北京市东城区建国门内大街22号
办公地址：北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人：吴建
传真：010-85238680
联系人：马旭
客服电话：95577
网址：http://www.hxb.com.cn

⑬渤海银行股份有限公司
住所：天津市河西区马场道201-205号
法定代表人：刘宝凤
电话：022-58316666
传真：022-58316259
联系人：王宏
客服电话：400-888-8811
网址：http://www.cbhb.com.cn/

⑭深圳农村商业银行股份有限公司
住所：深圳市罗湖区深南东路3038号合作金融大厦
法定代表人：李伟
联系人：陈聪
电话：0755-25188263
传真：0755-25188785
网站：www.4001961200.net
客户服务电话：400-196-1200

⑮上海农村商业银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区浦东大道981号
办公地址：上海市浦东新区银城中路8号中融碧玉蓝天大厦15至23楼?
法定代表人：胡平西
联系人：吴海平?
电话：021-38576666
传真：021-50105124
客服电话：021-962999，400-696-2999??
网址：www.srcb.com

⑯华安证券有限责任公司
住所：安徽省合肥市长江中路357号
法定代表人：李工
联系人：甘霖
电话：0551-5161821
传真：0551-5161672
客服电话：0551-96518，400-809-6518
公司网址：www.hazq.com.cn

⑰国泰君安证券股份有限公司
住所：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
联系人：芮敏祺
电话：021-38676666
传真：021-38670666
客户服务热线：4008-888-666
公司网站：http://www.gtja.com.cn

⑱海通证券股份有限公司
住所：上海市淮海中路98号
法定代表人：王开国
联系人：李笑鸣
电话：021-23219275
传真：021-53858549
客户服务热线：400-888-8001，95553
公司网站：http://www.htsec.com

⑲光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
联系人：刘晓、李芳芳
电话：021-22169999
传真：021-22169134
客户服务热线：10108998　4008888788
公司网站：http://www.ebscn.com

⑳广发证券股份有限公司
住所：广州市天河北路183号大都会广场36、38、41、42楼
法定代表人：王志伟
联系人：肖中梅
电话：020-87555888
传真：020-87557987
客服电话：020-961133
公司网站：www.gf.com.cn

㉑中信建投证券有限责任公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人：王常青
联系人：权唐
电话：010-65183888
传真：010-65182261
客服电话：400-8888-108
公司网址：www.csc108.com

㉒湘财证券有限责任公司
住所：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心11楼
法定代表人：林俊波
联系人：钟康莺
电话：021-68634518
传真：021-68865680
客户服务热线：400-888-1551
公司网址：www.xcsc.com

㉓中国银河证券股份有限公司
住所：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：陈亡国
联系人：田薇
电话：010-66568430
传真：010-66568116
客户服务热线：4008888888
公司网址：http://www.chinastock.com.cn

㉔东海证券有限责任公司
住所：常州延陵西路59号常信大厦18、19楼
法定代表人：朱科敏
联系人：霍晓飞
电话：021-50586660
传真：021-50586660-8881
客户服务热线：021-52574550
公司网址：http://www.longone.com.cn

㉕兴业证券股份有限公司
住所：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
法定代表人：兰荣
联系人：谢高得
电话：021-38565785
客服电话：95562
公司网站：http://www.xyzq.com.cn

㉖华泰联合证券有限责任公司
住所：深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层
法定代表人：马昭明
联系人：盛宗凌
电话：0755-82492000
传真：0755-82492062
客户服务热线：4008888555
公司网址：www.lhzq.com

㉗东方证券股份有限公司
住所：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人：王益民
电话：021-63325888
传真：021-63326173
联系人：吴宇
客服热线：95503　或　40088-88506
网址：www.dfzq.com.cn

㉘中银万国证券股份有限公司
住所：常熟路171号
法定代表人：丁国荣
联系人：李清怡
电话：021-54033888
传真：021-54038844
客户服务电话：400-889-5523，95523
网址：www.sywg.com

㉙中信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
法定代表人：王东明
电话：010-60833799
传真：010-60833739
联系人：陈忠
网址：www.cs.ecitic.com

㉚中信金通证券有限责任公司
住所：杭州市中河南路11号万凯商务庭院楼A座
法定代表人：刘军
联系人：俞会尧
电话：0571-85776115
传真：0571）85783771
客服电话：0571）96598
网址：www.bigsun.com.cn

㉛中信万通证券有限责任公司
住所：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（0507-1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人：张智河
联系人：吴忠超
电话：0532）85022326
传真：0532）85022605
网址：www.zxwt.com.cn

㉜国信证券股份有限公司
住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-20层
法定代表人：何如
电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
联系人：齐晓燕
客户服务热线：95536
公司网站：www.guosen.com.cn

㉝长城证券有限责任公司
住所：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
联系人：李春芳
电话：0755-83516222
传真：0755-83516189
客户服务热线：400-666-6888，0755-33680000
公司网站：www.cgws.com

㉞廊坊代证券有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街1号A座8层
法定代表人：马金声
电话：010-68083578
传真：010-68084986
联系人：孙恺
客户服务电话：400-698-9898
网址：www.xsdzq.cn

㉟longtop证券股份有限公司
住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：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
电话：0755-82825551
联系人：陈剑虹
客户服务电话：4008001001
公司网址：www.essencess.com.cn

㊱瑞泰证券有限责任公司
住所：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
联系人：王旭华
电话：0471-4972343
传真：0471-4961259
客户服务电话：0471-4961259
公司网址：www.cnht.com.cn

㊲平安证券有限责任公司
住所：广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8层
法定代表人：杨宇翔
联系人：郑舒丽
电话：0755-22626391
传真：0755-82492193
客户服务热线：95511-8
公司网址：www.pingan.com

㊳招商证券股份有限公司
住所：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
联系人：林生迎
联系电话：0755-82943666
网站：www.newone.com.cn
客户服务电话：95565，4008888111

㊴厦门证券有限公司
住所：厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼
法定代表人：傅毅辉
联系人：卢金文
电话：0592-5161642
传真：0592-5161140
客户服务电话：0592-5163588
网址：www.xmzq.cn

㊵中国建银投资证券有限责任公司
住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层
法定代表人：杨明辉
联系人：刘毅
电话：0755-82023442
传真：0755-82026539
客户服务电话：4006008008
网址：www.cjis.cn

㊶江海证券有限公司
住所：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：孙宇宏
电话：0451-82336863
传真：0451-82287211
客户服务热线：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn

㊷爱建证券有限责任公司
住所：上海市南京西路758号24楼
法定代表人：郑林
联系人：陈威
电话：021-32229888
传真：021-62878701
网站：www.ajzq.com
客户服务电话：021-63340678

㊸万联证券有限责任公司
住所：广州市中山二路18号广东电信广场36-37层
法定代表人：张建军
联系人：罗剑武
联系电话：020-37865070
传真：020-37865008
网站：www.wlzq.com.cn
客服电话：400-8888-133

㊹长江证券股份有限公司
住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
联系人：李良
电话：027-65799999
传真：027-85481900
客户服务热线：4008-888-999或95579
客户服务网站：www.95579.com

㊺红塔证券股份有限公司
住所：云南省昆明市北京路155号红塔大厦9楼
法定代表人：况雨林
电话：0871-3577930
传真：0871-3578827
客服热线：0871-3577930
网址：www.hongtastock.com

㊻东达证券有限公司
住所（办公地址）：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：高冠江
联系人：唐静
电话：010--63081000
传真：010-63080978
客服热线：400-800-8899
网址：www.cindasc.com

㊼广发华福证券有限责任公司
住所：福州市五四路157号新天地大厦7-10层
法定代表人：黄金琳
电　话：0591-87383623
传　真：0591-87383610
网站：www.ghfzq.com.cn
客户服务电话：96326（福建省外请加拨0591）

㊽大通证券股份有限公司
住所：大连市中山区人民路24号
法定代表人：董永成
联系人：谢立军
电话：0411-39673202
客服电话：4008-169-169
网址：www.datonsecurities.com.cn

㊾民生证券有限责任公司
住所：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
法定代表人：岳献春
联系人：赵明
电话：010-85127622
客服电话：4006198888
公司网址：www.mszq.com

㊿世纪证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦41/42层
法定代表人：方文
联系人：张婷
电话：0755-83199599
传真：0755-83199545
网址：www.csco.com.cn

(51)齐鲁证券有限公司
住所：山东省济南市经十路128号
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
联系电话：0531-82093669
传真：0531-81283900
客户服务电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

(52)天风证券有限责任公司
住所：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人：余磊
电话：027-87618882
传真：027-87618863
联系人：翟璎
客户服务电话：027-87618882.028-86711410
网址：www.tfzq.com

(53)山西证券股份有限公司
住所：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
电话：0351-8686659
传真：0351-8686619
联系人：郭熠
客户服务电话：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn

(54)国联证券股份有限公司
法定代表人：雷建辉
住所：无锡市县前东街168号
电话：0510-82831662
传真：0510-82830162
联系人：徐欣
客户服务电话：95570
网址：www.glsc.com.cn

(55)国都证券有限责任公司
住所：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
联系人：黄静
电话：010-84183333
客服电话：400-818-8118
网址：http://www.guodu.com

(56)华泰证券股份有限公司
住所：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址：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
联系人：万鸣
电话：025-83290979
客服电话：95597
网址：www.htsc.com.cn

(57)中山证券有限责任公司
住所：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
办公地址：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
联系人：李玲
电话：0755-82570586
客服电话：400-102-2011
网址：www.zszq.com.cn

(58)中国民族证券有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
法定代表人：赵大建
联系人：姜建平
电话：010-59355543
客服电话：400-889-5618
网址：www.e5618.com

(59)华龙证券有限责任公司
办公地址：兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人：李晓安
联系人：李昕田
电话：0931-8784656
客服电话：96668
网址：www.hlzqgs.com

(60)中国民族证券有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
法定代表人：赵大建
联系人：姜建平
电话：010-59355543
客服电话：400-889-5618
网址：www.e5618.com

(61)招信证券有限责任公司
注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西座11层
法定代表人：孔伯杰
联系人：陈韦彩
电话：010-88086830
传真：010-66412537
公司网站：www.rxzq.com.cn

(62)华证证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路166号27层
法定代表人：陈林
联系人：赵洁?
电话：021-50122131
客服电话：400-820-9898，020-38929908
网址：www.cnhbstock.com

(63)东吴证券有限责任公司
住所：苏州工业园区翠园路181号
办公地址：苏州工业园区翠园路181号
法定代表人：吴永敏
联系人：方晓丹
联系电话：0512-65581136
客服电话：0512-33396288
电话委托：0512-96288
公司网站：www.dwjq.com.cn

(64)海证券股份有限公司
住所：广西桂林市辅星路13号
办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3楼
法定代表人：张雅锋
联系人：牛孟宇
电话：0755-83709350
传真：0755-83700205
客服电话：95563

（二）登记结算机构

名称：华富基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
法定代表人：章宏韬
联系人：陈大毅
电话：021-68886996
传真：021-68887997

（三）相关法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：韩炯
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：黎明
经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：天健正信会计师事务所有限公司
住所：北京市西城区月坛北街26号恒华国际商务中心4层401??
负责人：梁青民
电话：021-61264626
传真：021-61264624
联系人：曹小勤
经办注册会计师：曹小勤、张建华

四、基金的名称

华富收益增强债券型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金主要投资于固定收益类产品，在维持资产较高流动性、严格控制投资风险、获得债券稳定收益的基础上，积极利用各种稳健的金融工具和投资渠道，力争基金资产的持续增值。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券、货币市场工具等固定收益类金融工具，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。上述资产投资比例不低于基金资产的80%。

本基金不直接在二级市场买入股票等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购和新股增发，并持有因在一级市场申购所形成的股票以及因可转债转股所形成的股票。本基金还可以持有股票所派发的权证、可分离债券产生的权证。上述资产的投资比例不超过基金资产的20%。

本基金投资于现金或者剩期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

1、策略概述

本基金以系统化研究为基础通过对固定收益类资产的主动配置获得稳定的债券总收益，并通过新股申购、转债投资等品种的主动投资提升基金资产的增值效率。投资策略主要包括纯固定收益、新股申购、转债投资等。

2、纯固定收益投资策略

本基金纯固定收益类资产（不含可转债）投资策略主要基于华富宏观利率检测体系的观测指标和结果，通过久期控制、期限结构管理、类属资产选择实施组合战略管理，同时利用个券选择、跨市场套利、骑乘策略、息差策略等战术性策略提升组合的收益率水平。

①华富宏观利率监测体系

华富宏观利率监测体系主要是通过对影响债券市场收益率变化的诸多因素进行跟踪，逐一评价各相应指标的影响程度并据此判断未来市场利率的趋势及收益率曲线形态变化。具体执行中将结合定性的预测和定量的因子分析法、时间序列回归等诸多统计手段来增强预测的科学性和准确性。

②久期合战略管理

组合战略管理是在华富宏观利率检测体系对基础利率、债券收益率变化趋势及收益率曲线变化对固定收益组合实施久期控制、期限结构管理、类属资产选择，以实现组合主要收益的稳定。

久期控制。久期控制是根据华富宏观利率检测体系对利率水平的预期对组合的久期进行积极的管理，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期（包括买入浮动利率债券），以规避债券价格下降的风险。为避免组合资产因利率波动而产生净值波动幅度过大，组合平均久期上限不超过7年。

本基金针对不同的债券产品也将会对最大的剩余期限予以限制，对不同品种的剩余期限调整或目前剩余期限进行较严格的管理，以充分控制利率风险，维持高流动性。

期限结构管理。期限结构管理是通过对债券收益率曲线形状变化（即不同期限的债券品种受到利率变化影响不一样大）的预期，选择相应的投资策略如子弹型、哑铃型或梯形的不同期限债券的组合形式，获取因收益率曲线的形变所带来的投资收益。

类属资产选择。主要通过提高相对收益率较高类属，降低相对收益率较低的类属以取得较高的总回报。由于信用差异、流动性差异、税收差异等诸多因素导致固定收益品种中同一期限的国债、金融债、企业债、资产支持证券等收益率之间价差在不同的时点价差出现波动。通过把握经济周期变化、不同投资主体投资需求变化等，分析不同固定收益类资产之间相对收益率价差的变化趋势，选择相对低估、收益率相对较高的类属资产进行配置，择机减持相对高估、收益率相对较低的类属资产。

③组合战术性策略

本基金纯固定收益组合在战略管理基础上，利用个券选择、跨市场套利、骑乘策略、息差策略等战术性策略提升组合的收益率水平。

个券选择。由于各发债主体信用等级、发行规模、担保人等因素导致同一类属资产的收益率水平存在差异，本基金在符合组合战略管理的条件下，综合考虑流动性、信用风险、收益率水平等因素后优先选择综合价值低估的品种。

跨市场套利。由于国内债券市场被分割为交易所市场和银行间市场，不同市场投资主体差异化、市场资金面的供求关系导致现券、回购等相同获相近的交易中存在显著的套利，本基金将充分利用市场的套利机会，积极进行跨市场回购套利、跨市场债券套利等。

骑乘策略。主要是利用收益率曲线陡峭特征，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券持有一段时间后获得因期限缩短而导致的收益下滑进而带来的资本利得。中国债券市场收益率曲线在不同时期不同期限表现出来的陡峭程度不一，为本基金实施骑乘策略提供了有利的市场环境。

息差策略。息差策略是通过正回购融资放大交易策略，其主要目标是获得票息大于回购成本而产生的收益。一般而言市场回购利率普遍低于中长期债券的收益率，为息差交易提供了机会，不过由于可能导致的资本利差损，因此本基金将根据对市场回购利率走势的判断，适当地选择杠杆比率，谨慎地实施息差策略，提高投资组合的收益水平。

3、新股申购策略

在股票发行市场中，由于新股信息披露未必完全能为投资者所接受而导致其发行价格存在一定折让，而国内市场的供求关系不平衡更是加剧了股票发行价格和二级市场之间的价差，从而使得的新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金将严格根据新股基本面、股票定价、市场供求关系去决定新股申购策略。

品种选择：针对每次新股发行，公司研究部都将就针对发行公司基本面进行评估和标的选择，策略上选择优质投资品种进行申购，规避质量较差的公司，同时针对优质品种投入较大的资金进行申购。

申购渠道选择：综合考虑新股中签率、上市首日涨幅、股价长期表现和锁定期因素，选择网上或网下进行申购。

上市交易选择：由于本基金的股票投资限于新股申购，不主动进行二级市场投资。所中签的新股上市后原则上采取择机抛售的策略。

4、可转债投资策略

可转换债券（含可分离转债）同时具有债券与权益类证券的双重特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将利用可转换债券定价模型进行估值分析，重点结合公司投资价值、可转换债券条款、可转债的转换价值溢价水平、债券价值溢价水平选择债性股性相对均衡的转债品种，获得一定超额回报。

一级市场申购，结合转债公司基本面、转债上市定价、中签率、市场环境、资金成本等因素综合制定申购策略。

二级市场投资，重点结合公司基本面，选择相对价值低估的成长型公司的转债品种，分享成长性带来的股价上涨，最后进而进行转股获利或二级市场抛售。同时结合转股价值溢价率、债券价值溢价率对具体时点进行选择，结合转债的赎回、回售、修正转股价等条款对转债进行配置，以降低转债的投资风险。

套利交易，在可转债进入转股期后，由于市场的非完全有效性、转债转股次日方能卖出、市场流动性等因素，导致转债出现折价交易的时机，本基金将充分利用套利机会选择合适的交易策略实施无风险套利。

5、权证投资策略

本基金将因持有股票或可分离债而获得权证进行有效管理，通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主要考虑权证资产的收益性、隐含波动度、流动性及风险性特征，结合未来标的证券的定价谨慎进行投资，选择合适的卖出获持有策略以获得适当的收益。

九、业绩比较基准

中信标普全债指数。

十、风险收益特征

本基金属于债券型证券投资基金，预期其长期平均风险和收益高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人——华富基金管理有限公司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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现、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