海富通双利分级债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2014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：中国工商银行股份有限公司

重要提示

海富通双利分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2013年8月16日中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1084号文注册募集。本基金的基金合同于2013年12月4日正式生效。本基金类型为契约型。

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。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

投资有风险，投资者在认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

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2014年6月4日，有关财务数据和净值表现截止日为2014年3月31日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

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

住所：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、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。

邵国有先生，董事，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、海富通基金管理有限公司董事长。2013年5月起转任海富通基金管理有限公司董事。

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。2011年4月至今任海通国际证券集团有限公司董事会主席。

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。

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。

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，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）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 Flexible 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。

李疆前先生，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。

谷若鸿（Laurent Couraudon）先生，监事，法国籍，斯特拉斯堡的罗伯特舒曼大学的国际贸易硕士学位。历任法国外贸银行莫斯科分行董事及企业金融部主管、法国巴黎银行俄罗斯分行商务拓展主管及法国巴黎银行莫斯科分行首席执行官兼俄罗斯地区总裁等职。2011年至今任法国巴黎银行（中国）有限公司董事会主席兼中国区总裁。

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。

高勇前先生，监事，经济学学士。历任宁波进出口公司财务部会计主管、上海科源医学高科技实业公司财务部财务主管、华安基金管理有限公司财务核算部副总监。2008年4月至今任海富通基金管理有限公司基金运营总监。

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。

阎小庆先生，副总经理，硕士。历任中国人民银行上海分行助理经济师、富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部副经理、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。

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。

赵恒毅先生，金融学硕士。2005年7月至2008年3月任通用技术集团投资管理有限公司研究员，2008年4月至2011年5月任富国基金管理有限公司研究员，2011年5月至2013年7月任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理，2012年5月至2013年7月任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理，2012年6月至2013年7月任富国可转换债券证券投资基金基金经理，2013年11月加入海富通基金管理有限公司。2013年12月起任海富通养老收益混合和海富通双利分级债券基金经理，2014年5月起兼任海富通双福分级债券基金经理。

本基金历任基金经理为位健，任职时间为2013年12月至2014年3月。

投资决策委员会常设委员有：田仁灿，总经理；戴德舜，投资总监；邵佳民，投资副总监；丁俊，投资副总监；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349,018,545,827元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

第三节 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

住所：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）

联系人：陈瑞瑞

电话：021-38650797

传真：021-33830160

2.其他销售机构

（1）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

法定代表人：姜建清

电话：010-66107900

传真：010-66107914

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（2）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

（3）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

（4）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：万建华

客户服务电话：95521

联系人：芮敏祺、吴倩

网址：www.gtja.com

（5）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：储晓明

客户服务电话：95523，4008895523

联系人：高夫

网址：www.sywg.com

（6）中信建投证券股份有限公司

地址：北京市朝阳门内大街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

（7）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

（8）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：杨泽柱

客户服务电话：95579

联系人：李良

长江证券客户服务网站：www.95579.com

（9）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：95511转8

联系人：郑舒丽

网址： stock.pingan.com

（10）中信万通证券有限责任公司

地址：山东省青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：95548

联系人：吴忠超

网址：www.zxwt.com.cn

（11）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：010-66045678

联系人：尹伶

网址：www.txsec.com

（12）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：王东明

电话：95558

联系人：顾凌

网址：www.cs.ecitic.com

（13）中信证券（浙江）有限责任公司

地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人：沈强

客户服务电话： 95548

联系人：姚锋

网址：www.bigsun.com.cn

（14）齐鲁证券有限公司

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.qlzq.com.cn

（15）中国中投证券有限责任公司

地址：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/

（16）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

（17）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：张背北

客服电话：400-666-2288

公司网站：www.jhzq.com.cn

（18）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： 4001022011

联系人： 李珍

网址：www.zsxq.com.cn

（19）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：祝雨林

客户服务电话：4008718880

联系人：刘晓明

网址：www.hongtastock.com

（20）国金证券股份有限公司

地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号成证大厦16楼

法定代表人：冉云

客户服务电话：4006600109

联系人：金喆

网址：www.gjzq.com.cn

（21）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：刘东

客户服务电话：020-961303

联系人：林洁茹

网址：www.gzs.com.cn

（22）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：4006666888

联系人：高峰

网址：www.cgws.com

（23）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：400-800-8899

联系人：唐静

网址：www.cindasc.com

（24）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：0731－84403360

传真：0731－84403330

联系人：郭磊

网址：www.cfzq.com

（25）华西证券有限责任公司

地址：四川省成都市青羊区下同仁路231号

法定代表人：杨炯洋

客户服务电话：400-888-8818 95584

联系人：李慧灵

网址：www.hx168.com.cn

（26）深圳众禄基金销售有限公司

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

（27）杭州数米基金销售有限公司

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：张裕

网址：www.fund123.cn

（28）上海好买基金销售有限公司

地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

联系人：阚迪

网址：www.ehowbuy.com

（29）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：王艳萍

客服电话：400-089-1289

公司网站： www.erichfund.com

（30）上海天天基金销售有限公司

地址：徐汇区龙田路190号2楼2层

法定代表人：其实

客户服务电话：400-1818-188

联系人：纳小丹

网址： www.1234567.com.cn

（31）和讯信息科技有限公司

地址：上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦25楼C区

法定代表人： 王莉

客户服务电话：400-920-0022

联系人：于杨

网址： licaike.hexun.com

（32）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：宋丽冉

网址： www.myfund.com

（33）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：胡璇

网址：www.5ifund.com

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、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

电话：010-59378835

传真：010-59378907

联系人：任瑞新

三、出具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

办公地址：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：孙睿

联系电话：021-31358666

经办律师：吕红、孙睿

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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法定代表人：杨绍信

经办注册会计师：薛竞、叶尔甸

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：刘莉

第四节 基金的名称

本基金名称：海富通双利分级债券型证券投资基金

第五节 基金的类型

本基金类型：契约型基金

第六节 基金的投资目标

本基金在追求基金资产长期稳定增值的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。

第七节 基金的投资方向

本基金的投资范围为固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、中小企业私募债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、债券回购、次级债、短期融资券、资产支持证券、中期票据、银行存款等固定收益类金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可投资于一级市场新股网上申购和增发新股申购，因通过发行、行权、可转换债券转股等原因形成的股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%，其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的3%。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。在双利A的每个开放日前20个工作日和后20个工作日期间不受前述投资组合比例的限制。

第八节 基金的投资策略

1.资产配置策略

本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。固定收益类资产中，本基金将采取久期管理、收益率曲线策略、类属配置等积极投资策略，在不同券种之间进行配置。

2.债券投资组合策略

在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。

（1）久期管理策略是根据对宏观经济环境、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金资产风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

（2）收益率曲线策略是指在确定组合久期以后，根据收益率曲线的形态特征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，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，在保持组合一定流动性的同时，可以从长、中、短期债券的价格变化中获利。

（3）类属配置包括现金、不同类型固定收益品种之间的配置。在确定组合久期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。

3.信用类债券投资策略

信用债券收益率可以分解为与其具有相同期限的无风险基准收益率加上反映信用风险的信用利差之和。信用利差收益主要受两方面的影响，一是该债券对应的信用利差曲线；二是该信用债券本身的信用变化的影响，因此本基金分别采用基于信用利差曲线变化策略和基于本身信用变化的策略：

（1）基于信用利差曲线变化策略

信用利差曲线的变化受宏观经济周期及市场供求两方面的影响较大，因此本基金一方面通过分析经济周期及相关市场的变化，判断信用利差曲线的变化，另一方面将分析债券市场的市场容量、市场形势预期、流动性等因素对信用利差曲线的影响，综合各种因素确定信用债券总的投资比例及分行业投资比例。

（2）基于信用债信用变化策略

本基金主要依靠内部信用评级系统分析信用债的信用水平变化、违约风险及理论信用利差等。本基金信用评级体系将通过定性与定量相结合，着力分析信用债券的实际信用风险，并寻求足够的收益补偿。另外，评级体现将从动态的角度，分析发行人的资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，进而预测信用水平的变化趋势，决定投资策略的变化。

4.中小企业私募债投资策略

与传统的信用债相比，中小企业私募债由于以非公开方式发行和转让，普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金对中小企业私募债投资将着力分析个券的实际信用风险，并寻求足够的收益补偿，增加基金收益。本基金管理人将对对个券信用资质进行详尽的分析，从动态的角度分析发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，进而预测信用水平的变化趋势，决定投资策略。在流动性风险控制，本基金会将重点放在一级市场，并根据中小企业私募债整体的流动性情况来调整持仓规模，严格防范流动性风险。

5.杠杆策略

杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较，判断是否存在利差套利空间，从而确定是否进行杠杆操作。进行杠杆放大策略时，基金管理人将严格控制信用风险及流动性风险。

6.可转换债券投资策略

由于可转换债券兼具债性和股性，本基金将着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究。对于可转换债券的投资将主要从三个方面的分析，数量为主的价值分析、债股性分析和公司基本面分析。通过以上分析，力求选择债券价值有一定支撑、安全性和流动性较好，并且发行人成长性良好的品种进行投资。

7.新股申购策略

参与新股申购和增发是增强收益的良好渠道。因此，本基金将根据股票市场整体定价水平，估计新股上市交易的合理价格，同时参考一级市场资金供求关系，制定相应的新股申购策略。根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低，确定继续持有或者卖出。

第九节 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准=中证全债指数

中证全债指数是中证指数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，也是中证指数公司编制并发布的首只债券类指数。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指数时，本基金可以在履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

第十节 基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

从本基金的两类基金份额来看，由于本基金资产及收益的分配安排，双利 A将表现出低风险、收益相对稳定的特征；双利B则表现出较高风险、收益相对较高的特征。

第十一节 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2014年7月1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2014年3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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,049,402,414.60	70.90
	其中：债券	1,049,402,414.60	70.90
	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	396,949,824.21	26.82
7	其他资产	33,739,302.27	2.28
8	合计	1,480,091,541.08	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票.

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

本基金本报告期末未持有股票.

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	960,051,414.60	91.67
5	企业短期融资券	9,999,000.00	0.95
6	中期票据	79,352,000.00	7.58
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,049,402,414.60	100.20

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	122904	10长城投	500,000	49,750,000.00	4.75
2	122911	10鞍城投	480,000	47,688,000.00	4.55
3	122028	09华发债	450,000	45,283,500.00	4.32
4	1182347	11新天山MTN1	400,000	39,636,000.00	3.78
5	122848	10桂林债	349,900	34,990,000.00	3.34

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合约。

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 本基金投资国债期货的投资政策

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 本基金投资国债期货的投资评价

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被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	143,517.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	33,595,784.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,739,302.27

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告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在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

第十二节 基金的业绩

基金业绩截止日为2014年3月31日。

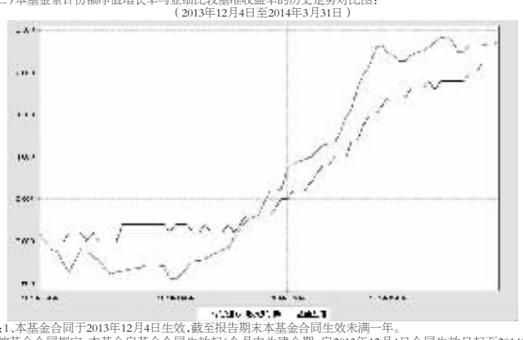
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）本基金份额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
2013年12月4日（基金合同生效日）至2013年12月31日	0.20%	0.06%	-0.28%	0.08%	0.48%	-0.02%
2013年12月4日（基金合同生效日）至2014年3月31日	2.10%	0.07%	2.38%	0.08%	-0.28%	-0.01%

（二）本基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：

（2013年12月4日至2014年3月31日）



注：1.本基金合同于2013年12月4日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期，自2013年12月4日合同生效日起至2014年3月31日，本基金运作时间未满6个月，仍处于建仓期中。

第十三节 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.双利A的销售服务费；

4.《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

5.《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

6.基金份额持有人大会费用；

7.基金的证券交易费用；

8.基金的银行汇划费用；

9.按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.7%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.2%÷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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3.双利A的销售服务费

双利A的年销售服务费率为0.50%，双利B不收取销售服务费。

销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

在通常情况下，双利A的销售服务费按前一日双利A的基金资产净值的年销售服务费率计提。计算方法如下：

H＝E×年销售服务费率÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日双利A的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

本基金转换为“海富通双利债券型证券投资基金”后，不收取销售服务费。

上述“一、基金费用的种类中第4—8项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1.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；

2.基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3.《基金合同》生效前的相关费用；

4.其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，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

海富通双利分级债券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.更新了基金管理人联系人信息。

2.更新了郑国汉先生的简历。

3.删除了王明权先生、陈洪先生的简历。

4.删除了位健先生的简历并新增了赵恒毅先生的简历。

5.新增历任基金经理信息。

6.更新了投资决策委员会常设委员的相关信息。

二、“第四节 基金托管人”部分：对基金托管人的主要人员情况、基金托管业务经营情况、基金托管人的内部控制制度等相关信息进行了更新。

三、“第五节 相关服务机构” 部分：

1.其他销售机构：

（1）更新了中国工商银行的相关信息；

（2）新增了除中国工商银行以外的其他销售机构的相关信息。

2.更新了审计基金财产的会计师事务所的相关信息。

四、“第七节 基金的募集”部分，更新了认购结束后募集的信息。

五、“第八节 基金合同的生效”部分，更新了基金合同的生效信息。

六、“第十节 基金份额的申购与赎回”部分，更新了“（五）申购和赎回的数额”部分的信息。

七、“第十一节 基金的投资”和“第十二节 基金的业绩”部分，根据2014年第一季度报告，新增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2014年3月31日。

八、“第二十三节 基金托管协议的内容摘要”部分，更新了基金管理人的联系人信息。

九、“第二十四节 对基金份额持有人的服务”部分：新增了“（七）网上开户与交易服务”部分的内容。

海富通基金管理有限公司

2014年7月18日

证券代码：002350 证券简称：北京科锐 公告编号：2014-034

北京科锐配电自动化股份有限公司 2014年第二次临时股东大会决议的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

特别提示：

1、本次临时股东大会无增加、变更、否决提案的情况；

2、本次临时股东大会以现场记名投票和网络投票相结合的方式召开。

一、会议召开和出席情况

北京科锐配电自动化股份有限公司（以下简称"公司"）2014年第二次临时股东大会现场会议于2014年7月17日14:00在北京市海淀区上地创业路8号3号楼4层公司会议室召开。本次临时股东大会增设了网络投票，通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的时间为2014年7月17日9:30～11:30、13:00～15:00；通过深圳证券交易所互联网系统投票的时间为2014年7月16日15:00至2014年7月17日15:00的任意时间。

参加本次会议的股东、股东代表及委托代理人共4人，代表股份129,812,709股，占公司有表决权股份总数的59.4707%。其中：

1、现场会议情况

参加本次现场股东大会的股东、股东代表及委托代理人共2人，代表股份129,782,709股，占公司有表决权股份总数的59.4570%。

2、网络投票情况

参加网络投票的股东共2人，代表股份30,000股，占公司有表决权股份总数的0.0137%.

3、通过现场和网络参加本次股东大会的中小投资者（单独或合计持有公司5%以上股份的股东以外的其他股东）共2人，代表股份30,000股，占公司有表决权股份总数的0.0137%。

本次股东大会由公司董事会召集，董事长张新育先生主持，公司部分董事、监事、高级管理人员及见证律师等相关人员出席了本次会议。本次会议的召集、召开符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和《公司章程》的规定。

二、议案审议和表决情况

本次临时股东大会以现场记名投票和网络投票相结合的方式，审议并通过了以下议案：

1、审议通过《关于使用部分超募资金暂时补充流动资金的议案》

《关于使用部分超募资金暂时补充流动资金的公告》已于2014年7月2日在公司指定信息披露媒体《中国证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn）披露。

表决结果：参与表决的有表决权的股份总数为129,812,709股。同意 129,810,909股，占出席会议的股东及股东代表所持表决权股份总数的99.9986%；反对1,800股，占出席会议的股东及股东代表所持表决权股份总数0.0014%；弃权0股，占出席会议的股东及股东代表所持表决权股份总数0%。

其中，中小投资者（单独或合计持有公司5%以上股份的股东以外的其他股东）表决情况为：同意28,200股，占出席会议的有表决权的中小投资者股份总数的94%；反对1,800股，占出席会议的有表决权的中小投资者股份总数的6%；弃权0股，占出席会议的有表决权的中小投资者股份总数的0%。

三、律师出具的法律意见

北京国枫凯文律师事务所曲凯律师、梁清华律师出席了本次临时股东大会，并出具了结论性意见：公司2014年第二次临时股东大会的召集、召开程序符合《公司法》、《股东大会规则》和《公司章程》的规定，会议召集人、出席会议人员的资格合法有效，会议表决程序符合法律、法规和公司章程的规定，本次股东大会通过的决议合法有效。

四、