

(上接B74版)

第四节 基金名称
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:建立长期稳健非负增长的收益增长线,运用优化组合管理机制实现风险预算目标,力争基金份额净值高于收益增长水平。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 投资策略
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、法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场条件下,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,在条件成熟时将作为本基金的重点投资对象。

第八节 投资限制
本基金采用优化投资组合保险策略,在固定比例投资组合保险策略(CPIPI)框架下适度把握市场时机,并辅以 VaR 控制仓位上升,合理配置资产,防止基金份额净值跌破收益增长线。

第九节 业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:MSCI China A 指数。债券投资部分的业绩比较基准为:上证国债指数。基金业绩比较基准参照 MSCI China A 指数x40%+上证国债指数x60%。

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。

第十二节 其他重要事项
本报告期内,本基金管理人严格按照法律法规及基金合同的约定履行了各项义务,基金资产运作符合基金合同的约定。

第十三节 基金的费用与税收
(一)基金费用的种类
1.基金运作有关的费用
(1)基金管理人的管理费
(2)基金托管人的托管费

第十四节 基金资产净值
截至 2014 年 9 月 30 日,本基金资产净值为 1,411,904.56 元,基金份额净值为 1.117 元。

第十五节 基金投资组合
截至 2014 年 9 月 30 日,本基金投资组合如下:
股票资产 68.86%,债券资产 29.14%,现金及银行存款 2.00%。

第十六节 基金业绩
截至 2014 年 9 月 30 日,本基金业绩如下:
净值增长率:1.117%
业绩比较基准:0.85%

第十七节 基金管理人
基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金管理人地址:深圳市福田区福田街道福安社区香梅路 1 号海富通大厦 10 楼

第十八节 基金托管人
基金托管人:交通银行股份有限公司
基金托管人地址:上海市浦东新区银城中路 188 号交通银行大楼

第十九节 基金销售
本基金在全国范围内设有销售网点,投资者可通过各销售网点购买或赎回基金份额。

第二十节 基金合同
基金合同是规范基金运作的基本法律文件,投资者在投资前应仔细阅读基金合同。

第二十一节 基金信息披露
基金管理人应严格按照法律法规及基金合同的约定履行信息披露义务,确保信息的真实、准确、完整、及时。

第二十二节 基金风险
基金投资存在风险,投资者在投资前应充分了解基金的风险收益特征,并根据自身的风险承受能力做出投资决策。

第二十三节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第二十四节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第二十五节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第二十六节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第二十七节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第二十八节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第二十九节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十一节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十二节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十三节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十四节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十五节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十六节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十七节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十八节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十九节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十一节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十二节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十三节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十四节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十五节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十六节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十七节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十八节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

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NAVSPD001。

(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密切配合,又责任明确,各自职责严格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.投资决策委员会根据策略分析师、股票分析师、固定产品分析师、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.投资策略委员会根据策略分析师、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数值;
3.投资策略委员会根据定量分析师按照组合保险策略计算资产配置比例,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,固定产品分析师的债券市场研究和品种选择,定量分析师对资产配置的比例和个股研究,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资金运用情况进行跟踪,并根据市场变化,实际交易情况及时调整;
8.定量分析师负责在优化投资组合保险策略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,并完成有关投资组合管理报告;

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为 MSCI China A 指数,债券投资部分的业绩比较基准为:上证国债指数。基金业绩比较基准参照 MSCI China A 指数x40%+上证国债指数x60%。

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。

第十二节 其他重要事项
本报告期内,本基金管理人严格按照法律法规及基金合同的约定履行了各项义务,基金资产运作符合基金合同的约定。

第十三节 基金的费用与税收
(一)基金费用的种类
1.基金运作有关的费用
(1)基金管理人的管理费
(2)基金托管人的托管费

第十四节 基金资产净值
截至 2014 年 9 月 30 日,本基金资产净值为 1,411,904.56 元,基金份额净值为 1.117 元。

第十五节 基金投资组合
截至 2014 年 9 月 30 日,本基金投资组合如下:
股票资产 68.86%,债券资产 29.14%,现金及银行存款 2.00%。

第十六节 基金业绩
截至 2014 年 9 月 30 日,本基金业绩如下:
净值增长率:1.117%
业绩比较基准:0.85%

第十七节 基金管理人
基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金管理人地址:深圳市福田区福田街道福安社区香梅路 1 号海富通大厦 10 楼

第十八节 基金托管人
基金托管人:交通银行股份有限公司
基金托管人地址:上海市浦东新区银城中路 188 号交通银行大楼

第十九节 基金销售
本基金在全国范围内设有销售网点,投资者可通过各销售网点购买或赎回基金份额。

第二十节 基金合同
基金合同是规范基金运作的基本法律文件,投资者在投资前应仔细阅读基金合同。

第二十一节 基金信息披露
基金管理人应严格按照法律法规及基金合同的约定履行信息披露义务,确保信息的真实、准确、完整、及时。

第二十二节 基金风险
基金投资存在风险,投资者在投资前应充分了解基金的风险收益特征,并根据自身的风险承受能力做出投资决策。

第二十三节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第二十四节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第二十五节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第二十六节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第二十七节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第二十八节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第二十九节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十一节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十二节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十三节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十四节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十五节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十六节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十七节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十八节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第三十九节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十一节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十二节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十三节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十四节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十五节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十六节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

第四十七节 基金其他
本基金的其他重要事项,请投资者参阅基金招募说明书及基金定期报告。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

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贵金属投资明细

8. 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

9. 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

10. 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

11. 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

12. 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

13. 其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

14. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

15. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

基金业绩截止日为 2014 年 6 月 30 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,投资者有风险,投资者在做出投资决策前请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:

Table with 6 columns: 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)

2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日

2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日

2005 年 1 月 1 日至 2005 年 12 月 31 日

2004 年 1 月 1 日至 2004 年 12 月 31 日

2003 年 1 月 1 日至 2003 年 12 月 31 日

2002 年 1 月 1 日至 2002 年 12 月 31 日

2001 年 1 月 1 日至 2001 年 12 月 31 日

2000 年 1 月 1 日至 2000 年 12 月 31 日

1999 年 1 月 1 日至 1999 年 12 月 31 日

1998 年 1 月 1 日至 1998 年 12 月 31 日

1997 年 1 月 1 日至 1997 年 12 月 31 日

1996 年 1 月 1 日至 1996 年 12 月 31 日

1995 年 1 月 1 日至 1995 年 12 月 31 日

1994 年 1 月 1 日至 1994 年 12 月 31 日

1993 年 1 月 1 日至 1993 年 12 月 31 日

1992 年 1 月 1 日至 1992 年 12 月 31 日

1991 年 1 月 1 日至 1991 年 12 月 31 日

1990 年 1 月 1 日至 1990 年 12 月 31 日

1989 年 1 月 1 日至 1989 年 12 月 31 日

1988 年 1 月 1 日至 1988 年 12 月 31 日

1987 年 1 月 1 日至 1987 年 12 月 31 日

1986 年 1 月 1 日至 1986 年 12 月 31 日

1985 年 1 月 1 日至 1985 年 12 月 31 日

1984 年 1 月 1 日至 1984 年 12 月 31 日

1983 年 1 月 1 日至 1983 年 12 月 31 日

1982 年 1 月 1 日至 1982 年 12 月 31 日

1981 年 1 月 1 日至 1981 年 12 月 31 日

1980 年 1 月 1 日至 1980 年 12 月 31 日

1979 年 1 月 1 日至 1979 年 12 月 31 日

1978 年 1 月 1 日至 1978 年 12 月 31 日

1977 年 1 月 1 日至 1977 年 12 月 31 日

1976 年 1 月 1 日至 1976 年 12 月 31 日

1975 年 1 月 1 日至 1975 年 12 月 31 日

1974 年 1 月 1 日至 1974 年 12 月 31 日

1973 年 1 月 1 日至 1973 年 12 月 31 日

1972 年 1 月 1 日至 1972 年 12 月 31 日

1971 年 1 月 1 日至 1971 年 12 月 31 日

1970 年 1 月 1 日至 1970 年 12 月 31 日

1969 年 1 月 1 日至 1969 年 12 月 31 日

1968 年 1 月 1 日至 1968 年 12 月 31 日

1967 年 1 月 1 日至 1967 年 12 月 31 日

1966 年 1 月 1 日至 1966 年 12 月 31 日

1965 年 1 月 1 日至 1965 年 12 月 31 日

1964 年 1 月 1 日至 1964 年 12 月 31 日

1963 年 1 月 1 日至 1963 年 12 月 31 日

1962 年 1 月 1 日至 1962 年 12 月 31 日

1961 年 1 月 1 日至 1961 年 12 月 31 日

1960 年 1 月 1 日至 1960 年 12 月 31 日

1959 年 1 月 1 日至 1959 年 12 月 31 日

1958 年 1 月 1 日至 1958 年 12 月 31 日

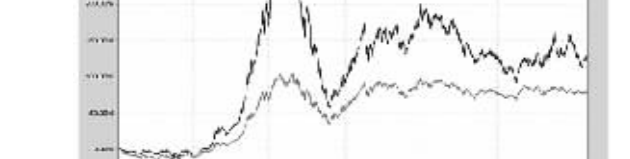
1957 年 1 月 1 日至 1957 年 12 月 31 日

1956 年 1 月 1 日至 1956 年 12 月 31 日

1955 年 1 月 1 日至 1955 年 12 月 31 日

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 2014 年 6 月 30 日)



注:按基金合同约定,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 日起,按 2007 年 11 月 1 日为持续营销后建仓期,建仓期间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.基金运作有关的费用

(1)基金管理人的管理费
(2)基金托管人的托管费

1. 基金管理人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×1.5%÷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;

2. 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提,计算方法如下:
H=E×0.25%÷当年天数;
H 为每日应计提的基金托管费;
E 为前一日基金资产净值;

3) 与基金运作有关的其他费用
主要包括:基金销售服务费、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、基金合同生效后与基金相关的会计审计费和律师费、投资管理由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按照费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

(二)基金费用的调整
本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客户服务基金份额持有人的费用。

(三)基金管理人及基金托管人的其他费用根据相关法律法规及中国证监会相关规定列支。

(四)基金费用的列支
基金管理人及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。

(五)基金费用的列支
基金管理人及基金托管人的其他费用根据相关法律法规及中国证监会相关规定列支。

(六)基金费用的列支
基金管理人及基金托管人的其他费用根据相关法律法规及中国证监会相关规定列支。

(七)基金费用的列支
基金管理人及基金托管人的其他费用根据相关法律法规及中国证监会相关规定列支。

(八)基金费用的列支
基金管理人及基金托管人的其他费用根据相关法律法规及中国证监会相关规定列支。

(九)基金费用的列支
基金管理人及基金托管人的其他费用根据相关法律法规及中国证监会相关规定列支。

(十)基金费用的列支
基金管理人及基金托管人的其他费用根据相关法律法规及中国证监会相关规定列支。

(十一)基金费用的列支
基金管理人及基金托管人的其他费用根据相关法律法规及中国证监会相关规定列支。

(十二)基金费用的列支
基金管理人及基金托管人的其他费用根据相关法律法规及中国证监会相关规定列支。

(十三)基金费用的列支
基金管理人及基金托管人的其他费用根据相关法律法规及中国证监会相关规定列支。

(十四)基金费用的列支
基金管理人及基金托管人的其他费用根据相关法律法规及中国证监会相关规定列支。

(十五)基金费用的列支
基金管理人及基金托管人的其他费用根据相关法律法规及中国证监会相关规定列支。