海富通集利纯债债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2017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：交通银行股份有限公司

重要提示

本基金经2016年8月11日中国证券监督委员会证监许可【2016】1820号文准予注册募集。本基金的基金合同于2016年9月29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，并经中国证监会注册。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财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资人在认购（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等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书所载内容截止日为2017年9月29日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年6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：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%、法国巴黎资产管理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。历任交通银行河南省分行铁道支行行长、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。

任志强先生，董事、总经理，硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理，华宝信托投资责任有限公司研究发展中心总经理兼投资管理部总经理、华宝信托投资责任有限公司总裁助理兼董事会秘书，华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。华宝兴业基金管理有限公司基金经理、投资总监、副总经理，华宝兴业资产管理（香港）有限公司董事长。2017年6月加入海富通基金管理有限公司，现任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

杨明先生，董事、管理学学士。历任中国人民银行新余支行科员、交通银行新余支行办公室科员、证券业务部负责人、证券业务部副主任、证券业务部主任，海通证券有限公司新余营业部总经理、海通证券股份有限公司江苏分公司筹备负责人、总经理、党委副书记，现任海通证券股份有限公司人力资源部总经理、党委组织部部长。

吴淑琨先生，董事，管理学博士。历任南京大学副教授，海通证券股份有限公司研究所宏观研究部经理、所长助理、机构业务部副总经理、企业及私人客户服务部副总主持、企业金融部总经理。现任海通证券股份有限公司战略发展部总经理。

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月至今任法国巴黎资产管理公司亚太区CEO。

黄金源(Alex NG Kim Guan)先生，董事，马来西亚国籍，文学学士，历任荷兰通用投资银行新加坡代表处客服主任，荷兰通用资本市场远东区域香港公司证券部经理，法国巴黎资产管理亚洲有限公司董事，现任法国巴黎资产管理亚洲有限公司亚太区投资总监。

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，先锋投资（米兰及都柏林）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 Control 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。

张馨先生，独立董事，博士，教授。1984年7月至今任职于厦门大学经济学院，历任厦门大学经济学院教授、副院长兼财政系主任、院长。现任厦门大学经济学院教授、博士生导师。

李础前先生，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。

魏海诺（Bruno Weil）先生，监事，法国籍，博士。历任巴黎银行东南亚负责人、亚洲融资项目副经理，法国巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投行业务部负责人、零售部中国代表、南京银行副行长。现任法国巴黎银行集团（中国）副董事长。

俞海先生，监事，博士，CFA。先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根投产管理（英国）有限公司。曾任上投摩根基金管理有限公司业务发展部总监。2012年11月至今任海富通基金管理有限公司产品与创新总监，2015年12月起兼任海富通基金管理有限公司总经理助理。

陈虹女士，监事，法学士。历任香港的近律师事务所上海代表处律师，工银安盛人寿保险有限公司高级法律顾问。2014年7月至2016年1月任海富通基金管理有限公司高级法务经理，现任海富通基金管理有限公司法律部总经理。

奚万荣先生，督察长，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内部审计，2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任监事、监察稽核总监、总经理助理。2015年7月起，任海富通基金管理有限公司督察长兼上海富诚海富通资产管理有限公司监事。

章明女士，副总经理，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4月至2015年7月任海富通基金管理有限公司督察长，2015年7月起任海富通基金管理有限公司副总经理。2016年12月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。

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、上海中主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。

何树方先生，副总经理，博士。历任山东济宁市财政贸易委员会副科长、魁北克蒙特利尔大学研究助理（兼职）、魁北克公共退休金管理投资公司分析师、基金经理助理，富国基金管理有限公司总经理助理，2011年6月加入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2014年11月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

何谦先生，硕士，历任平安银行资金交易员，华安基金管理有限公司债券交易员，2014年6月加入海富通基金管理有限公司，任海富通货币基金经理助理。2016年5月起任海富通纯债债券、海富通双福分级债券及海富通货币基金经理。2016年5月至2017年10月兼任海富通双利债券基金经理。2016年9月起兼任海富通集利债券基金经理。2017年8月起兼任海富通添益货币基金经理。

刘田女士，管理学学士。曾任上海银行同业客户经理，2016年4月加入海富通基金管理有限公司，2016年12月起任海富通集利债券的基金经理助理。

投资决策委员会常设委员有：任志强，总经理；胡光涛，总经理助理；王智慧，总经理助理；孙海忠，总经理助理兼固定收益投资总监；杜晓海，多资产策略投资部总监；黄东升、机构权益投资部总监；王金祥、研究副总监；陈甦瑛、量化投资部总监；陈扶平、固定收益投资副总监；赵赫，年金权益投资总监。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

一、基金托管人基本情况
（一）基金托管人概况
公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）
公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人：牛锦明
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
邮政编码：200120
注册时间：1987年3月30日
注册资本：742.62亿元
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号
联系人：陆志俊
电话：95559

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
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：綦潇菡
电话：021-38650797
传真：021-33830160
2、其他销售机构
1）交通银行股份有限公司
地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：牛锦明
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com
2）上海天天基金销售有限公司
地址：上海市徐汇区徐家汇街道宛平南路88号金座26楼 （新地址）
法定代表人：其实
客户服务电话：400-1818-188
联系人：王超
网址：www.1234567.com.cn
二、登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
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：010-50938782
传真：010-50938907
联系人：赵亦清
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：俞卫锋
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：陈颖华
经办律师：孙睿、陈颖华
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：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：李丹
经办注册会计师：薛竞、都晓燕
电话：(021) 23238888
传真：(021) 23238800
联系人：都晓燕

四、基金的名称

本基金的名称：海富通集利纯债债券型证券投资基金

五、基金的类型

基金类型：契约型、开放式

六、基金的投资目标

本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，追求基金资产长期稳健增值，力争实现高于业绩比较基准的投资收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资对象是具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等，国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购和增发新股申购，因所持可转换公司债券转股形成的股票，本基金应在其可交易之日起的10个交易日内卖出。因投资于分离交易可转债而产生的权证，本基金应在其可交易之日起的10个交易日内卖出。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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

一、投资策略
1、资产配置策略
本基金为债券型基金，对债券的投资比例不低于基金资产的80%。在此约束下，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。
2、债券类属资产配置
类属配置包括国债、金融债、企业债等固定收益品种之间的配置。本基金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。类属配置主要根据各部分的利差的扩大及收窄分析，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、债券投资组合策略
债券投资主要采取利率策略、信用策略、收益率曲线策略以及杠杆策略，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。
（1）利率策略
利率策略主要是根据对宏观经济环境判断，预测市场利率水平变动趋势，以及收益率曲线变化趋势，从而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）信用策略
信用策略主要是根据不同信用等级资产的相对价值，确定资产在不同债券类属之间的配置，并通过对债券的信用分析，确定信用债的投资策略。本基金将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。
（3）收益率曲线策略
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，可以从长期、中期、短期债券的价格变化中获利。
（4）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。
4、中小企业私募债券投资策略
与传统的信用债相比，中小企业私募债券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券的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券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、资产支持证券投资策略
本基金投资资产支持证券将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。
6、国债期货投资策略
本基金的国债期货投资将以风险管理为原则，以套期保值为目的。管理人将按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。
二、投资决策和程序
1、决策依据
（1）投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定；
（2）投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比；
（3）投资部策略分析师、股票分析师、固定收益分析师、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、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。投资决策委员会定期或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）投资部门负责人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）定期不定期召开部门例会，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）基金经理在投资部门负责人授权下，根据部门例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标，在充分听取分析师债券配置意见的基础上，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）风险管理部负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。
（8）风险管理部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、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率
采用该业绩比较基准主要基于以下考虑：
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，也是中证指数有限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，中证指数有限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。
若未来法律法规发生变化，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，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。

十一、基金的投资组合报告

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。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月24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2017年6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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	215,438,300.00	92.13
	其中：债券	215,438,300.00	92.13
	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	13,379,730.99	5.72
7	其他资产	5,027,024.97	2.15
8	合计	233,845,055.96	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股通股票。
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	162,662,000.00	77.62
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	51,725,600.00	24.68
7	可转债（可交换债）	1,050,700.00	0.50
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	215,438,300.00	102.80

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	101660033	16晋焦煤MTN001	200,000	20,534,000.00	9.80
2	139310	16韩城投	200,000	19,392,000.00	9.25
3	112462	16徐工02	200,000	19,370,000.00	9.24
4	139311	16沾化债	200,000	19,366,000.00	9.24
5	139158	13南投债	200,000	19,214,000.00	9.17

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。
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 本期国债期货投资政策
本基金的国债期货投资以风险管理为原则，以套期保值为目的。管理人按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。
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 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末投资国债期货。
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出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
11.2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。
11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,387.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,024,637.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,027,024.97

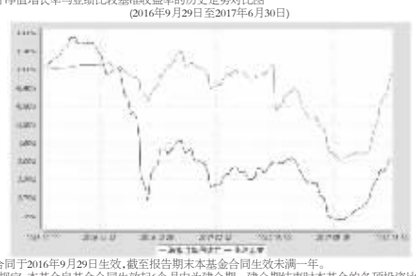
11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2017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
2016年9月29日（基金合同生效日）-2016年12月31日	-0.14%	0.05%	-1.74%	0.15%	1.60%	-0.10%
2017年1月1日-2017年6月30日	0.07%	0.11%	-0.20%	0.07%	0.27%	0.04%
2016年9月29日（基金合同生效日）-2017年6月30日	-0.07%	0.09%	-1.93%	0.10%	1.86%	-0.01%

二、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
（2016年9月29日至2017年6月30日）



注：1、本基金合同于2016年9月29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。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

十三、基金的费用与税收

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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券、期货交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、基金的账户开户费用、账户维护费用；
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0.4%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H=E×0.4%÷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
基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起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、公休假或不可抗力等，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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H=E×0.1%÷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
基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。
上述“一、基金费用的种类”中第3－9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。
3、证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后，自产品成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付，如基金财产余额不足支付该开户费用，由基金管理人于产品成立一个月后的5个工作日内进行垫付，基金托管人不承担垫付开户费用义务。
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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

海富通集利纯债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》、《公开募集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、“三、基金管理人”部分；
1. 更新了基金管理人概况的相关信息。
2. 更新了张文伟先生、陶乐斯（Ligia Torres）女士、黄金源(Alex NG Kim Guan)先生、何谦先生的简历。
3. 增加了任志强先生、刘田女士的简历。
4. 更新了投资决策委员会的相关信息。
二、“四、基金托管人”更新了基金托管人的相关信息。
三、“五、相关服务机构”部分：
1. 更新了直销机构的相关信息。
2. 更新了审计基金财产的会计师事务所的相关信息。
四、“九、基金的投资”和“第十部分 基金的业绩”部分：根据2017年第二季度报告，更新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2017年6月30日。

海富通基金管理有限公司
2017年11月11日

股票代码：002052 股票简称：同洲电子 公告编号：2017-046

深圳市同洲电子股份有限公司
关于对深圳证券交易所关注函的回复的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

深圳市同洲电子股份有限公司（以下简称“公司”）于2017年10月30日收到深圳证券交易所出具的《关于对深圳市同洲电子股份有限公司关注函》（中小板关注函【2017】第180号），公司及相关方就相关事项进行了认真核查，并对《关注函》中所列问题向深圳证券交易所作出了书面说明回复。现将回复内容公告如下：

1、请小牛龙行全面披露前期已支付给袁明的款项以及剩余股份转让应付款所涉及资金的来源情况，直至披露到来源于相关主体的自有资金（除股东投资入股款之外），经营活动所获资金或银行贷款，并按不同资金来源途径分别列示资金融出方名称、金额、资金成本、期限、担保和其他重要条款，以及后续还款计划（如尚无计划的，应制定明确的还款计划）。

回复：

根据《袁明与深圳市小牛龙行量化投资企业（有限合伙）关于深圳市同洲电子股份有限公司之协议书》（以下简称“《协议书》”），小牛龙行合计应向袁明支付股份转让价款人民币1,499,997,704.51元。前述转让价款扣除袁明所欠小牛龙行借款本金8.7亿元、借款本金的利息59,869,051.13元，以及小牛龙行依据《差额补足及奖励协议》及其补充协议向袁明支付的113,522,153.50元，还剩456,606,499.88元应由小牛龙行根据《协议书》向袁明支付。

1、已支付款项来源

（1）有限合伙人小牛商置对小牛龙行的实缴出资额3亿元

该等资金全部来自深圳市小牛投资管理有限公司（以下简称“小牛投资”）提供的借款，借款金额为3亿元，借款期限为1年，自借款实际发放之日起开始计算。

小牛投资的上述借款分别来自于其向深圳市小牛共赢十三号投资企业（有限合伙）提供的借款0.945亿元、深圳市小牛慧赢五号投资企业（有限合伙）提供的借款1.145亿元以及深圳市小牛共赢十五号投资企业（有限合伙）提供的借款1亿元，借款利率均为8%。

由于深圳市小牛共赢十三号投资企业（有限合伙）、深圳市小牛慧赢五号投资企业（有限合伙）和深圳市小牛共赢十五号投资企业（有限合伙）于2017年8月满两年的投资期限，小牛投资于上述企业投资期限到期前向新的出借方借入资金归还给上述企业。新的借款方深圳市前海宝兴隆投资有限公司（以下简称“宝兴隆”）和深圳市前海乾兴泰贸易有限公司（以下简称“乾兴泰”）向小牛投资提供借款，具体情况如下：

序号	借款方	出借方	借款金额（万元）	利率	担保	借款期限
1	小牛投资	宝兴隆	19,750.00	8%/年	小牛资本管理集团有限公司提供连带责任保证	自每笔借款实际发生之日起1年
2	小牛投资	乾兴泰	13,750.00	8%/年	小牛资本管理集团有限公司提供连带责任保证	自每笔借款实际发生之日起1年
		合计	33,500.00			

公司查阅了宝兴隆和乾兴泰的工商资料以及说明函，相关情况如下：

① 宝兴隆

公司名称	深圳市前海宝兴隆投资有限公司
住所	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
股东	湖南一统文化传媒有限公司（出资比例60%），李跃民（出资比例40%）
成立时间	2015年11月10日
注册资本	500万元
法定代表人	李跃民
经营范围	受托资产管理、投资管理（不得从事信托、金融资产管理、证券资产管理等业务）；投资咨询、企业管理咨询、经济信息咨询（不含限制项目）；股权投资（具体项目另行申报）。

宝兴隆的股东湖南一统文化传媒有限公司的注册资本为510万元，股东为黄海琼，出资比例100%。

根据宝兴隆出具的说明函，宝兴隆向小牛投资提供的借款来源于深圳市勤勇珠宝有限公司（以下简称“勤勇珠宝”）提供的借款15,450万元及乾兴泰提供的借款4,500万元；关于前述出借资金，宝兴隆不存在直接或间接使用小牛资本管理集团有限公司（以下简称“小牛集团”）及其子公司资金的情形，并承诺对所提供的全部资金拥有完全、有效的处分权且合法合规。

公司查阅了勤勇珠宝的工商资料以及承诺函，相关情况如下：

公司名称	深圳市勤勇珠宝有限公司
住所	深圳市罗湖区翠竹街道田贝四路和文锦北路交汇处鹏大厦一层A11
股东	易勤勇
成立时间	2015年12月2日
注册资本	500万元
法定代表人	易勤勇
经营范围	金银、钯金、铂金、翡翠、玉、钻石、珍珠、珠宝首饰、饰品以及工艺品的购销；国内贸易。（法律、行政法规、国务院决定规定在登记前须经批准的项目除外，法律、行政法规限制的项目须取得许可后方可经营）

根据勤勇珠宝出具的承诺函，勤勇珠宝向宝兴隆提供的借款来源于公司自有资金及自筹资金，不存在直接或间接使用小牛集团及其子公司的资金的情形，并承诺对所提供的全部资金拥有完全、有效的处分权且合法合规。

② 乾兴泰

公司名称	深圳市前海乾兴泰贸易有限公司
住所	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
股东	湖南一统文化传媒有限公司（出资比例60%），李跃民（出资比例40%）
成立时间	2015年11月4日
注册资本	500万元
法定代表人	李跃民
经营范围	国内贸易（不含许可经营项目，不含专营、专控、专卖商品）。

根据乾兴泰出具的说明函，乾兴泰向小牛投资提供的借款为自有资金及自筹资金。自筹资金来源于深圳金渠供应链有限公司（以下简称“金渠供应链”）提供的借款5,000万元，深圳市华尔街创投电子商务有限公司（以下简称“华尔街创投”）提供的借款2,500万元，田甜提供的借款9,500万元；关于前述出借资金，乾兴泰不存在直接或间接使用小牛集团及其子公司资金的情形，并承诺对所提供的全部资金拥有完全、有效的处分权且合法合规。

公司查阅了上述出借方金渠供应链、华尔街创投的工商资料及其提供的承诺函，查阅了田甜提供的承诺函，具体情况如下：

A、金渠供应链

公司名称	深圳金渠供应链有限公司
住所	深圳市罗湖区翠竹街道水贝二路水贝工业区10栋首层01#
股东	江阴市金渠资本管理有限公司
成立时间	2016年1月29日
注册资本	1,000万元
法定代表人	王艺新
经营范围	计算机软硬件技术服务