海富通稳进增利分级债券型证券投资基金之增利A与增利B份额上市交易公告书

基金管理人：海富通基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2011年11月28日
公告日期：2011年11月23日

一、重要声明与提示

海富通稳进增利分级债券型证券投资基金之增利A与增利B上市交易公告书（以下简称"本公告"）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，海富通基金管理有限公司（以下简称"本基金管理人"）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）和深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2011年7月20日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》及海富通基金管理有限公司网站（http://www.hftfund.com）上的《海富通稳进增利分级债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称"招募说明书"）。

二、基金概览

1.基金名称：海富通稳进增利分级债券型证券投资基金。

2.基金类别：债券型。

3.基金的运作方式：契约型基金。本基金基金合同生效后，在封闭期内不开放申购、赎回业务。封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。

4.基金的封闭期限：本基金基金合同生效后，封闭期为三年（含三年），封闭期届满后转为上市开放式基金（LOF）。本基金封闭期自基金合同生效之日起至三年后对应日止。如该对应日为非工作日，则封闭期到期日顺延到下一个工作日。基金管理人有权在封闭期届满前召集基金份额持有人大会，审议是否在封闭期届满后延长封闭期及延长封闭期的期限，具体事项由基金管理人另行公告。

5.本基金发售结束后，场外、场内认购的全部份额将按8:2的比率确认为增利A份额与增利B份额。两类基金份额的基金资产合并运作。场外的A类份额和B类份额登记在注册登记系统；场内的A类份额和B类份额登记在证券登记结算系统。

6.基金份额的上市交易：基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，本基金在封闭期内，增利A份额与增利B份额两类基金份额同时申请上市交易。在本基金封闭期届满，本基金按照基金合同约定及深圳证券交易所规则转换为上市开放式基金（LOF），转换后的基金份额继续在深圳证券交易所上市交易。

7.截至2011年11月21日基金份额总额：本基金场内总份额49,677,912份，其中，增利A基金份额39,744,719份，增利B基金份额9,933,193份。本基金场外总份额170,834,653.45份，其中增利A基金份额136,665,332.34，增利B基金份额34,169,321.11份。

8.增利A基金份额参考净值：1.012元（截至2011年11月21日）

9.增利B基金份额参考净值：1.027元（截至2011年11月21日）

10.本次上市交易的两类基金份额简称及代码：

简称：增利A，代码：150044

简称：增利B，代码：150045

11.本次上市交易的两类基金份额总额：增利A份额39,744,719份，增利B份额9,933,193份（截至2011年11月21日）

12.上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

13.上市交易日期：2011年11月28日

14.基金管理人：海富通基金管理有限公司

15.基金托管人：中国建设银行股份有限公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1.基金募集申请的核准机构和核准文号：2011年6月9日中国证券监督管理委员会证监许可［2011］907号文。

2.基金合同生效日：2011年9月1日。

3.基金运作方式：契约型。

4.基金合同期限：不定期。

5.发售日期：2011年7月25日至2011年8月19日。

6.发售价格：1.00元人民币。

7.发售方式：场内、场外认购。

8.发售机构

场外销售机构为海富通基金管理有限公司的直销机构和场外代销机构（即符合《证券投资基金销售管理办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构）。其中直销机构指本公司设在上海的直销中心。场外代销机构包括：中国建设银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、深圳发展银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、海通证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、财通证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、方正证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、江海证券有限公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、日信证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中国建银投资证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、中银万国证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、民生证券有限责任公司等。

场内将通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位发售。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

9.验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

10.募集资金总额及入账情况：

本次募集的净认购金额为220,476,482.86元人民币，认购资金在募集期间产生的银行利息共计36,082.59元人民币，已折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户，归基金份额持有人所有。

本次募集有效认购总户数为2,387户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，募集期募集资金及其利息结转的基金份额共计220,476,482.86份。其中本基金管理人基金从业人员认购持有的基金份额总额为1,988.70（含募集期利息结转的份额），占本基金总份额的比例为0.0009%。

本基金募集结束后，按照基金合同约定基金份额按8:2的比率确认为增利A份额与增利B份额。其中，增利A的基金份额为176,410,051.34份，增利B的基金份额44,102,514.11份。

募集资金已分别于2011年8月24日（场外认购资金）和8月25日（场内认购资金）划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。

11.基金备案情况

本基金于2011年8月29日验资完毕，2011年9月1日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2011年9月1日获得书面确认，本基金基金合同自该日起正式生效。

12.基金合同生效日：2011年9月1日。

13.基金合同生效日的基金份额总额：220,512,565.45份，其中，增利A的基金份额为176,410,051.34份，增利B的基金份额44,102,514.11份。

（二）增利A与增利B基金份额上市交易的主要内容

1.基金上市交易的核准机构和核准文号：深证上［2011］353号。

2.上市交易日期：2011年11月28日。

3.上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。

4.本次上市的基金份额简称：增利A、增利B

5.本次上市的基金份额交易代码：增利A的交易代码150044、增利B的交易代码150045

6.本次上市交易份额：增利A的份额为39,744,719份，增利B的份额为9,933,193份（数据截至2011年11月21日）。

7.基金资产净值的披露：每个工作日的次日公布本基金的基金份额净值和两类基金份额增利A和增利B的份额参考净值，并在深交所行情发布系统揭示增利A和增利B的份额参考净值。

8.未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至2011年11月21日，增利A场内基金份额持有人户数为431户，平均每户持有的增利A场内基金份额92,215份。增利B场内基金份额持有人户数为430户，平均每户持有的增利B场内基金份额23,100份。

（二）持有人结构

截至2011年11月21日，场内基金份额持有人结构如下：

场内机构投资者持有的场内增利A基金份额28,000,893份，占比70.45%；场内个人投资者持有的场内增利A基金份额11,743,826份，占比29.55%。

场内机构投资者持有的场内增利B基金份额7,000,223份，占比70.47%；场内个人投资者持有的场内增利B基金份额2,932,970份，占比29.53%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：

截至2011年11月21日，场内增利A前十名基金份额持有人的情况。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占总份额比例
1	东北证券-建行-东北证券3号主题投资集合资产管理计划	12,001,000.00	30.20%
2	国元证券股份有限公司	8,000,333.00	20.13%
3	招商证券股份有限公司	7,999,560.00	20.13%
4	杨帆	4,001,360.00	10.07%
5	汤佩兴	797,316.00	2.01%
6	余东华	400,016.00	1.01%
7	王勇	240,020.00	0.60%
8	王飞	240,020.00	0.60%
9	李拓	182,960.00	0.46%
10	李玉华	120,005.00	0.30%

截至2011年11月21日，场内增利B前十名基金份额持有人的情况。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占总份额比例
1	东北证券-建行-东北证券3号主题投资集合资产管理计划	3,000,250.00	30.20%
2	国元证券股份有限公司	2,000,083.00	20.14%
3	招商证券股份有限公司	1,999,890.00	20.13%
4	杨帆	1,000,340.00	10.07%
5	汤佩兴	199,329.00	2.01%
6	余东华	100,004.00	1.01%
7	王勇	60,005.00	0.60%
8	王飞	60,005.00	0.60%
9	李拓	45,740.00	0.46%
10	李玉华	30,001.00	0.30%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1.名称：海富通基金管理有限公司

2.法定代表人：邵国有

3.总经理：田仁灿

4.注册资本：1.5亿元人民币

5.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

6.批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基金字［2003］48号

7.工商登记注册的法人营业执照文号：310000400339452

8.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它业务。

9.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%。

10.内部组织结构及职能：

公司按照建立和完善公司治理结构的要求，设立董事会和监事会，并聘请了4名独立董事。为强化董事会的监督和指导功能，促进公司各项业务稳健发展，董事会设立了风险委员会、薪酬委员会、审计委员会三个专业委员会，其成员以独立董事为主。

董事会决定公司的战略规划，强化各项审计稽核监察职能，充分保障公司基金持有人的利益，为公司的健康发展提供最佳的资源支持，并且为保护基金持有人的利益提供最佳保障。董事会由九位董事组成，其中四名为独立董事。

监事会由三名监事组成，其中一名监事为公司职工代表，由公司职工民主选举和罢免。其余成员由股东会选举和罢免。监事会向股东会负责，并向股东会汇报工作情况。

公司实行董事会领导下的总经理负责制。总经理全面负责公司的经营管理。公司下设运营部、渠道业务部、机构业务部、营销部、投资部、监察稽核部、风险管理部、法律部、人力资源部、战略发展部、财务部等部门。公司按照合理配置技能、有效激励和强调从业经验等原则，严把人员聘用关，公司员工覆盖基金运作的各个环节，能够保证本基金募集后顺利、规范运作。

11.人员情况：

截止2011年9月30日，公司正式员工199人，其中超过53%的员工具有硕士以上学历。

12.信息披露负责人：奚万荣

电话：021-38650891

13.基金管理业务情况简介：

截至2011年9月30日，海富通基金管理有限公司旗下共管理19只公募基金，资产规模超过351亿元人民币。旗下管理的基金包括：海富通精选证券投资基金、海富通股票证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势股票型证券投资基金、海富通精选武弓混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通中国海外精选股票型证券投资基金、海富通领先成长股票型证券投资基金、海富通中证100指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘股票型证券投资基金、上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选股票型证券投资基金、上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金及海富通稳进增利分级债券型证券投资基金。

14.本基金基金经理

张丽洁女士，经济学硕士学位，2002年7月至2004年7月就职于南京银行股份有限公司，从事债券交易工作，2004年8月加入海富通基金管理有限公司，任助理固定收益分析师、组合经理，2008年2月起任海富通货币基金基金经理，2011年9月起兼任海富通稳进增利分级债券基金基金经理。

（二）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，在莫斯科设有代表处，设立了湖北桃江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、安徽繁昌建信村镇银行、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《财本》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。

2.主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3.基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年6月30日，中国建设银行已托管195只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2010年初，中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为2009年度"国内最佳托管银行"（Domestic Top Rated），并连续第三年被香港《财资》杂志评为"中国最佳次托管银行"。

（三）上市推荐人

本基金无上市推荐人

（四）基金验资机构

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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法人代表：杨绍信

经办注册会计师：汪棣、金毅

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：金毅

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

海富通稳进增利分级债券型证券投资基金2011年11月21日资产负债表如下：（除特别注明外，金额单位为人民币元）

资 产	本报告期末
资 产：	
银行存款	70,510,953.64
结算备付金	1,199,795.87
存出保证金	46.55
交易性金融资产	218,824,076.00
其中：股票投资	7,829,096.04
债券投资	210,994,979.96
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	1,699,737.84
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	292,234,609.90
负债和所有者权益	
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	67,999,743.00
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	90,188.88
应付托管费	25,768.23
应付销售服务费	-
应付交易费用	8,937.83
应交税费	-
应付利息	34,584.00
应付利润	-
其他负债	161,310.40
负债合计	68,320,532.34
所有者权益：	
实收基金	220,512,565.45
未分配利润	3,401,512.11
所有者权益合计	223,914,077.56
负债和所有者权益总计	292,234,609.90

注：1、截至2011年11月21日，基金份额净值1.015元，基金份额总额220,512,565.45份。

八、基金投资组合

截至2011年11月21日，本基金的投资组合情况如下：

（一）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	7,829,096.04	2.68
	其中：股票	7,829,096.04	2.68
2	固定收益投资	210,994,979.96	72.20
	其中：债券	210,994,979.96	72.20
	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	71,710,749.51	24.54
6	其他资产	1,699,784.39	0.58
7	合计	292,234,609.90	100.00

（二）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		
B	采掘业		
C	制造业	12,000.00	0.01
C0	食品、饮料		
C1	纺织、服装、皮毛		
C2	木材、家具		
C3	造纸、印刷		
C4	石油、化学、塑胶、塑料		
C5	电子		
C6	金属、非金属		
C7	机械、设备、仪表	12,000.00	0.01
C8	医药、生物制品		
C99	其他制造业		
D	电力、煤气及水的生产和供应业		
E	建筑业		
F	交通运输、仓储业		
G	信息技术业	3,444,000.00	1.54
H	批发和零售贸易		
I	金融、保险业	4,373,096.04	1.95
J	房地产业		
K	社会服务业		
L	传播与文化产业		
M	综合类		
	合计	7,829,096.04	3.50

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	000562	宏源证券	299,938	4,373,096.04	1.95
2	600406	国电南瑞	100,000	3,444,000.00	1.54
3	002638	勤上光电	500	12,000.00	0.01
4					
5					
6					
7					
8					
9					
10					

（四）按券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	100,346,979.96	44.81
5	企业短期融资券	100,768,000.00	45.00
6	中期票据	-	-
7	可转债	9,880,000.00	4.41
8	其他	-	-
9	合计	210,994,979.96	94.23

（五）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

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	122098	11八钢债	200,000	20,500,000.00	9.16
2	041161006	11桂冠CP002	200,000	20,222,000.00	9.03
3	041160006	11陕有色CP002	200,000	20,204,000.00	9.02
4	041173001	11中冶CP003	200,000	20,196,000.00	9.02
5	041164007	11营口港CP001	200,000	20,086,000.00	8.97

（六）投资组合报告附注

1.自基金合同生效日至2011年11月21日，本基金前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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。

3.其他资产构成如下：

序号	其他资产	金额（元）
1	存出保证金	46.55
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,699,737.84
4	应收股利	-
5	其他应收款	-
6	合计	1,699,784.39

4.权证投资情况

截至2011年11月21日，本基金未持有权证。

5.本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	股票名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	9,880,000.00	4.41

6.本报告期末按市值占基金净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

截至2011年11月21日，本基金未持有资产支持证券。

7.投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

（一）中国证监会核准基金募集的文件

（二）《海富通稳进增利分级债券型证券投资基金基金合同》

（三）《海富通稳进增利分级债券型证券投资基金招募说明书》

（四）《海富通稳进增利分级债券型证券投资基金托管协议》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

海富通基金管理有限公司
二〇一一年十一月二十三日

附件：基金合同摘要

一、基金合同当事人及权利义务

（一）基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1.自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

2.依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

3.发售基金份额；

4.依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

5.在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

6.根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

7.在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

8.在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

9.自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

10.选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

11.选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

12.在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

13.依法召集基金份额持有人大会；

14.法律法规和基金合同规定的其他权利。

（二）基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

1.依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2.办理基金备案手续；

3.自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4.配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5.建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7.依法接受基金托管人的监督；

8.计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

9.采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

10.按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

11.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12.编制季度、半年度和年度基金报告；

13.严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

14.保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

15.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

16.依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

17.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

18.以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

19.组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20.因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21.基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22.按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

23.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

24.执行生效的基金份额持有人大会决议；

25.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26.依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（三）基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1.依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

2.监督基金管理人对本基金的投资运作；

3.自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

4.在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

5.根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

6.依法召集基金份额持有人大会；

7.按规定取得基金份额持有人名册资料；

8.法律法规和基金合同规定的其他权利。

（四）基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

1.安全保管基金财产；

2.设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

3. 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

4.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5.保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6.按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

7.保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

8.对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

9.按照规定保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

10.按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

11.办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

12.复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

13.按照规定监督基金管理人的投资运作；

14.按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

15.依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

16.按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

17.因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

18.基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

19.参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

21.执行生效的基金份额持有人大会决议；

22.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

23.建立并保存基金份额持有人名册；

24.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（五）基金份额持有人的权利

每份基金份额具有同等的合法权益，但在本基金转换为上市开放式基金（LOF）前，增利A份额、增利B份额基金份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定，仅在其份额类别内拥有同等的权益，且相同类别基金份额的同等权益不因基金份额持有人取得基金份额的方式（场内认购、场外认购或上市交易）而有所差异。根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

1.分享基金财产收益；

2.参与分配清算后的剩余基金财产；

3.依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

4.按照规定要求召开基金份额持有人大会；

5.出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

6.查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7.监督基金管理人的投资运作；

8.对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

9.法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

（六）基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金