

# 海富通富祥混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2018 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

本基金经 2016 年 5 月 3 日中国证券监督管理委员会证监许可【2016】974 号文准予注册募集。本基金的基金合同于 2016 年 7 月 27 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资产，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预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并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人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 1 月 27 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 12 月 31 日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 第一部分基金管理人

### 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。

**Ligia Torres(陶乐斯)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。

**AlexandreWerno(韦历山)先生**，董事，金融硕士学位。2007 年 9 月至 2013 年 4 月在法国兴业投资银行全球市场部任执行董事、中国业务开发负责人职务；2013 年 5 月至 2017 年 11 月先后任华宝兴业基金管理有限公司总经理高级顾问、常务副总经理职务；2017 年 11 月至今任法国巴黎资产管理亚洲有限公司亚太区战略合作总监。

**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。

**Marc Bayot (巴约特)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，上海市公用事业管理局党办副主任，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。

**Bruno Weil（魏海诺）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。

**俞涛先生**，监事，博士，CFA。先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根资产管理（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 月起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 月至 2018 年 3 月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。

**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。

**陈轶平先生**，博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理，基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投资部副总监兼债券基金部总监。2013 年 8 月起任海富通货币基金经理。2014 年 8 月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014 年 11 月起兼任海富通上证可质押城投债 ETF 基金经理。2015 年 12 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 9 月兼任海富通稳进增利债券(LOF)基金经理。2016 年 4 月起兼任海富通一年定开债券基金经理。2016 年 7 月起兼任海富通富祥混合基金经理。2016 年 8 月起兼任海富通瑞丰一年定开债券基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 11 月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016 年 11 月起兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2017 年 1 月起兼任海富通上证周期产业债 ETF 基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通富源债券和海富通瑞合纯债基金经理。2017 年 5 月起兼任海富通富睿混合基金经理。2017 年 7 月起兼任海富通欣悦混合、海富通瑞福一年定开债券、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。

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；王金祥，研究副总监；陈甄璞，量化投资部总监；陈轶平，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。

## 第二部分基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）

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：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

## 第三部分相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、场外销售机构

##### （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：暴潇菡

电话：021-38650797

传真：021-33830160

##### （2）销售机构

## 1) 中国工商银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

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：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

## 3) 中国银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：陈四清

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

## 4) 平安银行股份有限公司

地址：广东省深圳市深南东路 5047 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

客户服务电话：95511-3

网址：bank.pingan.com

## 5) 上海浦东发展银行股份有限公司

地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

客户服务电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

## 6) 宁波银行股份有限公司

地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：95574

网址: [www.nbcab.com.cn](http://www.nbcab.com.cn)

7) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

地址: 江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人: 陆向阳

客户服务电话: 0519-96005

网址: [www.jnbank.com.cn](http://www.jnbank.com.cn)

8) 财富证券有限责任公司

地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-28 层

法定代表人: 蔡一兵

客户服务电话: 95317 或 4008835316

联系人: 郭磊

网址: [www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

9) 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: 尤习贵

客户服务电话: 95579 或 4008888999

联系人: 奚博宇

网址: [www.95579.com](http://www.95579.com)

10) 东北证券股份有限公司

地址: 吉林省长春市生态大街 6666 号

法定代表人: 李福春

客户服务电话: 95360

联系人: 安岩岩

网址: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

11) 广州证券股份有限公司

地址: 广东省广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔  
19 层、20 层

法定代表人: 刘东

客户服务电话: 95396



联系人：林洁茹

网址：www.gzs.com.cn

12) 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

法定代表人：冉云

客户服务电话：95310

联系人：刘婧漪

网址：www.gjq.com.cn

13) 国联证券股份有限公司

地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

法定代表人：姚志勇

客户服务电话：95570

联系人：沈刚

网址：www.glsc.com.cn

14) 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：杨德红

客户服务电话：95521

联系人：芮敏祺、吴倩

网址：www.gtja.com

15) 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：周杰

客户服务电话：95553 或 4008888001

联系人：李笑鸣

网址：www.htsec.com

16) 平安证券股份有限公司

地址：广东省深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：詹露阳

客户服务电话：95511 转 8

联系人：周一涵

网址：stock.pingan.com

17) 上海证券有限责任公司

地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

电话：021-53686888

客户服务电话：4008918918 或 021-962518

联系人：邵珍珍

网址：www.962518.com

18) 申万宏源证券有限公司

地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

客户服务电话：95523 或 4008895523

联系人：黄莹

网址：www.swhysc.com

19) 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：010-66045555 或 010-66045777 或 010-66045678（基金）

联系人：谭磊

网址：www.txsec.com

20) 中国银河证券股份有限公司

地址：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：陈共炎

客户服务电话：95551 或 4008888888

联系人：邓颜

网址：www.chinastock.com.cn

21) 中山证券有限责任公司

地址：广东省深圳市南山区科技中一路华强高新大厦 7-8 楼

法定代表人：黄扬录

客户服务电话：95329

联系人：罗艺琳

网址：www.zszq.com

22) 中信建投证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

23) 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：95548

联系人：赵艳青

网址：www.citicssd.com

24) 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 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

电话：95548

联系人：顾凌

网址：www.cs.ecitic.com

25) 华西证券股份有限公司

地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

客户服务电话：95584

联系人：周志茹

网址: [www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

26) 西藏东方财富证券股份有限公司

地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号金座 9、10、11、16、17、18 层

法定代表人: 陈宏

客户服务电话: 95357

联系人: 周艳琼

网址: [www.xzsec.com](http://www.xzsec.com)

27) 开源证券股份有限公司

地址: 西安市雁塔区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人: 李刚

客户服务电话: 4008608866

联系人: 袁伟涛

网址: [www.kysec.cn](http://www.kysec.cn)

28) 华金证券股份有限公司

地址: 上海市浦东新区杨高南路 759 号 30 层

法定代表人: 宋卫东

客户服务电话: 4008211357

联系人: 秦臻

网址: [www.huajinsc.cn](http://www.huajinsc.cn)

29) 中信期货有限公司

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 13 层  
1301-1305 室、14 层

法定代表人: 张皓

客户服务电话: 4009908826

联系人: 韩钰

网址: [www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

30) 天风证券股份有限公司

注册地址: 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

办公地址: 湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

客户服务电话：4008005000

联系人：杨晨

官网：www.tfzq.com

31) 宏信证券有限责任公司

地址：四川省成都市人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼

法定代表人：吴玉明

客户服务电话：4008366366

联系人：张鋈

网址：www.hxzq.cn

32) 大同证券有限责任公司

地址：山西省太原市小店区长治路 111 号 12、13 层

法定代表人：董祥

客户服务电话：4007121212

联系人：薛津

网址：www.dtsbc.com.cn

33) 首创证券有限责任公司

地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号

法定代表人：吴涛

客户服务电话：4006200620

联系人：刘宇

网址：www.sczq.com.cn

34) 华龙证券股份有限公司

地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

法定代表人：李晓安

客户服务电话：0931-95368（甘肃）或 4006898888（全国）

联系人：范坤

网址：www.hlzq.com

35) 中泰证券股份有限公司

地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

联系人：许曼华

网址：www.zts.com.cn

36) 光大证券股份有限公司

地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

客户服务电话：95525

联系人：刘晨、李芳芳

网址：www.ebscn.com

37) 安信证券股份有限公司

地址：广东省深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

客户服务电话：95517

联系人：陈剑虹

网址：www.essence.com.cn

38) 世纪证券有限责任公司

地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：姜昧军

客户服务电话：4008323000

联系人：袁媛

网址：www.csc.com.cn

39) 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

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](http://www.1234567.com.cn)

## 40) 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：董一峰

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

## 41) 深圳众禄金融控股股份有限公司

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](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

## 42) 蚂蚁（杭州）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：李雁雯

网址：蚂蚁财富 APP

## 43) 上海好买基金销售有限公司

地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

联系人：陆敏

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

## 44) 上海基煜基金销售有限公司

地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

联系人：李鑫

网址：www.jiyufund.com.cn

45) 和讯信息科技有限公司

地址：上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 E 座 18F

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022

联系人：刘洋

网址：licaikexun.com

46) 众升财富（北京）基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

法定代表人：李招弟

客户服务电话：400-876-9988

联系人：付少帅

网址：www.zscffund.com

47) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 室

法定代表人：陈操

客户服务电话：400-850-7771

联系人：文雯

网站：<https://t.jrj.com/>

48) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-089-2899

联系人：单丙烨

公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

49) 上海联泰资产管理有限公司

法定代表人：燕斌

地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室



客服电话：4000-466-788

联系人：陈东

网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

50) 上海汇付金融服务有限公司

地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

客服电话：400-820-2819

联系人：李栋

网址：[www.chinapnr.com](http://www.chinapnr.com)

51) 北京增财基金销售有限公司

地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

法定代表人：罗细安

客服电话：400-001-8811

联系人：史丽丽

网址：[www.zcvc.com.cn](http://www.zcvc.com.cn)

52) 上海陆金所资产管理有限公司

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：郭坚

客服电话：4008 6666 18

联系人：程晨

网址：<https://www.lu.com>

53) 北京钱景基金销售有限公司

地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服电话：400-893-6885

联系人：高静

网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

54) 北京虹点基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

法定代表人：胡伟

客服电话：400-068-1176

联系人：陈铭洲

网址：[www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

55) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园3号

法定代表人：林卓

客服电话：400-6411-999

联系人：张晓辉

网址：<http://www.taichengcaifu.com>

56) 北京恒天明泽基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层

法定代表人：梁越

客服电话：4008-980-618

联系人：王海彬

网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

57) 珠海盈米财富管理有限公司

地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

联系人：吴煜浩

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

58) 嘉实财富管理有限公司

地址：上海市浦东新区世纪大道8号国金中心办公楼二期46层4609-10单元

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

联系人：余永健

网址：<http://www.harvestwm.cn/>

## 59) 大泰金石基金销售有限公司

地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

法定代表人：袁顾明

客服电话：021-22267982

联系人：赵明

网址：[www.dtfortune.com](http://www.dtfortune.com)

## 60) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

法定代表人：沈伟桦

客服电话：400-6099-200

联系人：刘梦轩

网址：<http://www.yixinfund.com/>

## 61) 上海凯石财富基金销售有限公司

地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

法定代表人：陈继武

客服电话：4000-178-000

联系人：王哲宇

网址：[www.vstonewealth.com](http://www.vstonewealth.com)

## 62) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

法定代表人：彭运年

客服电话：4008-909-998

联系人：王莅晨

网址：<http://www.jnlc.com/>

## 63) 一路财富（北京）信息科技有限公司

法定代表人：吴雪秀

地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702

客服电话：400-001-1566

联系人：徐越

网址: [www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

64) 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: 罗恒

网址: [www.myfund.com](http://www.myfund.com)

65) 上海利得基金销售有限公司

地址: 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

法定代表人: 李兴春

客服电话: 400-921-7755

联系人: 徐鹏

网址: <http://www.leadbank.com.cn>

66) 深圳富济财富管理有限公司

地址: 深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层法定代表人: 齐小贺

客服电话: 0755-83999907

联系人: 刘娜

网址: [www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

67) 奕丰金融服务(深圳)有限公司

地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)

法定代表人: TAN YIK KUAN

客服电话: 400-684-0500

联系人: 叶健

网址: [www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

68) 浙江金观诚财富管理有限公司

地址: 杭州市拱墅区登云路 45 号(锦昌大厦) 1 幢 10 楼 1001 室

法定代表人: 徐黎云

客服电话: 400-068-0058

联系人：孙成岩

网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

69) 上海大智慧财富管理有限公司

地址：上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 楼

法定代表人：申健

客服电话：021-20219931

联系人：施燕华

网址：<https://8.gw.com.cn>

70) 北京广源达信基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 楼浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

客服电话：400-623-6060

联系人：崔丁元

网址：<https://www.niuniufund.com/>

71) 北京汇成基金销售有限公司

地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

联系人：丁向坤

网址：[www.hcji jin.com](http://www.hcji jin.com)

72) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504

法定代表人：陈洪生

客服电话：400-918-0808

联系人：蔡之帆

网址：[www.xds.com.cn](http://www.xds.com.cn)

73) 北京新浪仓石基金销售有限公司

地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪  
总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

客服电话：010-62675369

联系人：吴翠

网址：<http://finance.sina.com.cn/fund/>

74) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

法定代表人：江卉

客服电话：95118 / 400-098-8511

联系人：赵德赛

网址：<http://fund.jd.com>

75) 凤凰金信（银川）投资管理有限公司

地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院朝来高科技产业园 18 号楼

法定代表人：程刚

客服电话：400-810-5919

联系人：王鹤敏

网址：[www.fengfd.com](http://www.fengfd.com)

76) 深圳市金斧子投资咨询有限公司

地址：深圳市南山区南山街道科苑路 18 号东方科技大厦 18F

法人代表：陈姚坚

客服电话：400-9500-888

联系人：张烨

网址：[www.jfzinv.com](http://www.jfzinv.com)

77) 上海华夏财富投资管理有限公司

地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

法人代表：李一梅

客服电话：400-817-5666

联系人：穆文燕

网址：[www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.com)

78) 南京苏宁基金销售有限公司

地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法人代表：钱燕飞

客服电话：95177

联系人：喻明明

网址：www.snjijin.com

79) 北京蛋卷基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法人代表：钟斐斐

客服电话：4000-618-518

联系人：侯芳芳

网址：www.danjuanapp.com

80) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

联系人：李娟

网址：www.noah-fund.com

81) 中民财富管理（上海）有限公司

地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

法人代表：弭洪军

客服电话：400-876-5716

联系人：黄鹏

网址：www.cmiwm.com

## 2、场内销售

本基金可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理基金销售业务的上海证券交易所会员单位进行销售。

基金管理人可以根据有关法律法规的要求，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

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：孙睿

经办律师：黎明、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



## 第四部分 基金的名称

本基金名称：海富通富祥混合型证券投资基金

## 第五部分 基金的类型

基金类型：契约型开放式

## 第六部分 基金的投资目标

本基金的投资目标为：本基金通过稳健的大类资产配置策略和个券及个股精选策略，在严格控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的收益。

## 第七部分 基金的投资方向

本基金的投资范围为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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券等）、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、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）。

本基金投资于债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的 70%，股票、权证等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 30%，扣除股指期货、国债期货合约保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

法律法规或监管机构日后允许本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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

## 第八部分 基金的投资策略

### 一、投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金为混合型基金，对债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的70%。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、市场风险收益特征及市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和股票资产等的预期风险收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。

#### 2、债券组合投资策略

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，本基金将会重点放在一级市场，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、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。

#### 6、资产支持证券投资策略

对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，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

#### 7、杠杆投资策略

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。

#### 8、股票投资策略

本基金的股票投资策略主要为个股精选策略，通过价值分析及成长性分析，兼顾个股的成长性和估值水平，寻找具有较强的持续成长能力，同时价值又没有被高估的股票主动投资。价值分析主要侧重公司的品质分析及估值水平分析。对于成长性分析，本基金管理人将重点关注企业的内涵式增长。本基金的股票投资强调将定量的股票筛选和定性的公司研究有机结合，并实时应用风险控制手段进行组合调整。

#### 9、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，本基金将在控制风险的前提下，以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上适当参与。

#### 10、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

#### 11、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势

的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 二、投资决策依据和程序

### 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,在充分听取策略分析师宏观配置意见、股票分析师行业配置意见及固定收益分析师的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，在证券分析师设定的证券池内，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。

## 第九部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准： $\text{中证全债指数收益率} \times 70\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 30\%$ 。

中证全债指数是由中证指数有限公司编制的反映债券全市场整体价格和投资回报情况的指数，具有很高的代表性；沪深 300 指数由中证指数有限公司编制，是由沪深 A 股中规模大、流动性好的最具代表性的 300 只股票组成，可以综合反映沪深 A 股市场整体表现。基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

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时，本基金管理人可以与基金托管人协商一致报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，不需要召开基金份额持有人大会。

## 第十部分 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

## 第十一部分 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。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于 2018 年 2 月 9 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 12 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	6,000,411.00	4.50
	其中：股票	6,000,411.00	4.50
2	固定收益投资	117,637,905.30	88.31
	其中：债券	117,637,905.30	88.31
	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	6,587,412.39	4.95
7	其他资产	2,986,761.80	2.24
8	合计	133,212,490.49	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

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	采矿业	264,203.00	0.26
C	制造业	4,179,893.00	4.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	257,334.00	0.25
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	1,030,053.00	1.00
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	268,928.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	6,000,411.00	5.83

## 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投资股票。

## 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

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	600332	白云山	35,800	1,150,612.00	1.12
2	600519	贵州茅台	400	278,996.00	0.27
3	000661	长春高新	1,500	274,500.00	0.27



4	002027	分众传媒	19,100	268,928.00	0.26
5	000338	潍柴动力	32,000	266,880.00	0.26
6	000538	云南白药	2,600	264,654.00	0.26
7	600028	中国石化	43,100	264,203.00	0.26
8	601939	建设银行	34,400	264,192.00	0.26
9	600104	上汽集团	8,200	262,728.00	0.26
10	300024	机器人	13,900	261,598.00	0.25

#### 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	8,096,130.00	7.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,673,000.00	48.25
	其中：政策性金融债	49,673,000.00	48.25
4	企业债券	57,484,900.00	55.84
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,383,875.30	2.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	117,637,905.30	114.26

#### 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	160210	16 国开 10	400,000	35,204,000.00	34.19
2	018006	国开 1702	150,000	14,469,000.00	14.05
3	122595	12 泉州 02	100,000	10,110,000.00	9.82
4	136845	16 环球 03	100,000	9,714,000.00	9.44
5	136019	15 龙湖 04	100,000	9,615,000.00	9.34

## 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。

### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资以套期保值为主要目的，并选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或者空头套期保值。

## 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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 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

本报告期，本基金未参与国债期货投资。

## 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	44,175.78
2	应收证券清算款	419,161.07
3	应收股利	-
4	应收利息	2,523,395.25
5	应收申购款	29.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,986,761.80

### 11.4 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	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110034	九州转债	943,345.30	0.92

### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600332	白云山	1,150,612.00	1.12	重大资产重组

## 第十二部分 基金的业绩

基金业绩截止日为2017年12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) 本报告期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
2016年7月27日（基金合同生效日）至2016年12月31日	-0.30%	0.13%	1.82%	0.28%	-2.12%	-0.15%
2017年1月1日至2017年12月31日	-3.41%	0.14%	5.92%	0.21%	-9.33%	-0.07%
2016年7月27日（基金合同生效日）至2017年12月31日	-3.70%	0.14%	7.85%	0.24%	-11.55%	-0.10%

(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：

(2016年7月27日至2017年12月31日)



注：本基金合同于 2016 年 7 月 27 日生效，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。

## 第十三部分 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、《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、律师费和诉讼费；
- 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、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 1.2% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—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。

## 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

海富通富祥混合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、“第三部分 基金管理人”部分：

1. 对基金管理人概况部分进行了更新。

2. 更新了张文伟先生、Ligia Torres（陶乐斯）女士、章明女士、陈轶平先生的简历。

3. 增加了任志强先生、AlexandreWerno(韦历山)先生的简历。

4. 删除了 Alex NG Kim Guan（黄金源）先生的简历。

5. 更新了投资决策委员会的相关信息。

6. 更新了基金管理人的内部控制制度。

二、“第四部分 基金托管人”部分，更新了基金托管人的相关信息。

三、“第五部分 相关服务机构”部分：

1. 对基金份额发售机构的相关信息进行了更新。

2. 更新了审计基金财产的会计师事务所的信息。

四、“第九部分 基金的投资”部分，更新了投资决策程序的相关信息，并根据 2017 年第四季度报告，更新了基金投资组合报告内容，相关数据截止期为 2017 年 12 月 31 日。

五、“第十部分 基金的业绩”部分，根据 2017 年第四季度报告，更新了基金业绩的内容，相关数据截止期为 2017 年 12 月 31 日。

海富通基金管理有限公司

2018 年 3 月 12 日