

中海安鑫保本混合型证券投资基金更新招募说明书摘要 (2014年第2号)

本基金基金合同于2013年7月31日生效。

重要提示

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

本基金是保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险收益品种。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。如发生《基金合同》约定的不适用保本条款的情形，投资者认购并持有到期的基金份额亦存在着无法收回本金的可能性。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2014年7月31日，有关财务数据和净值表现截止日为2014年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称：中海基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

邮政编码：200120

成立日期：2004 年 3 月 18 日

法定代表人：黄鹏

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2004]24 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：1.466667 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：兰嵘

联系电话：021-38429808

股东名称及其出资比例：

中海信托股份有限公司	41.591%
国联证券股份有限公司	33.409%
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司	25.000%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

陈浩鸣先生，董事长。中央财经大学硕士，高级经济师。现任中海信托股份有限公司总裁。历任海洋石油开发工程设计公司经济师，中国海洋石油总公司财务部保险处主管、资产处处长，中海石油投资控股有限公司总经理，中海信托股份有限公司副总裁，中海基金管理有限公司总经理。

成赤先生，董事。中国人民大学硕士。现任中国海洋石油总公司资金管理部总经理。历任中国海洋石油总公司计划资金部融资处处长、中国海洋石油有限公司资金融资部副总监。

黄鹏先生，董事。复旦大学硕士。现任中海基金管理有限公司总经理兼中海恒信资产管理（上海）有限公司董事长。历任上海市新长宁（集团）有限公司销售经理，上海浦东发展银行股份有限公司大连分行行长秘书，中海信托股份有限公司综合管理部经理助理、投资管理部经理、风控委员会委员，中海基金管理有限公司董事会秘书、总经理助理兼营销中心总经理。

彭焰宝先生，董事。清华大学学士。现任国联证券股份有限公司副总裁。历任国联证券股份有限公司（原无锡证券）交易员、投资经理、投资部副总经理，国联投资管理有限公司投资部总经理，中海基金管理有限公司投资总监（期间曾兼任中海优质成长证券投资基金基金经理）、风险管理部总经理兼风控总监，国联证券股份有限公司总裁助理兼证券投资部总经理。

江志强先生，董事。东南大学硕士。现任国联证券股份有限公司副总裁。历任国联证券股份有限公司（原无锡证券）上海海伦路证券营业部交易员、证券投资部投资主管、上海邯郸路证券营业部副总经理、总经理、无锡县前东街证券营业部总经理、无锡人民东路证券营业部总经理、财富管理中心总经理、无锡华夏南路证券营业部总经理、总裁助理兼资产管理部总经理、副总裁兼资产管理部总经理。

TAY SOO MENG（郑树明）先生，董事。新加坡国籍。新加坡国立大学学士。现任爱德蒙得洛希尔资产管理（香港）有限公司市场行销总监。历任新加坡Coopers & Lybrand审计师，法国兴业资产管理集团行政及财务部门主管、董事总经理兼营运总监（亚太区，日本除外）、董事总经理兼法国兴业资产管理新加坡执行长，爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司市场行销总监。

李维森先生，独立董事。澳大利亚悉尼大学博士。现任复旦大学经济学院经济学教授、博士生导师、副院长。历任山东社会科学院《东岳论丛》编辑部编辑，澳大利亚麦角理大学经济学讲师。

陈道富先生，独立董事。中国人民银行金融研究所硕士。现任国务院发展研究中心金融研究所综合研究室主任。曾任中关村证券公司总裁助理。

WEIDONG WANG（王卫东）先生，独立董事。美国国籍。芝加哥大学博士。现任美国德杰律师事务所合伙人。历任Sidley Austin（盛德律师事务所）芝加哥总部律师，北京大学国家发展研究院国际MBA项目访问教授，北京德恒律师事务所合伙人。

2、监事会成员

张悦女士，监事长。硕士，高级会计师。现任中海信托股份有限公司纪委副书记、总稽核兼合规总监、稽核审计部经理、信托事务管理总部总经理。历任北京石油交易部副经理，中国海洋石油东海公司计财部会计、企管部企业管理岗，中海石油总公司平湖生产项目计财部经理，中海石油有限公司上海分公司计财部经理，中海信托股份有限公司计划财务部会计、计划财务部经理。

Denis LEFRANC（陆云飞）先生，监事。法国国籍。学士。现任爱德蒙

得洛希尔资产管理（香港）有限公司执行总监。历任法国期货市场监管委员会审计师，法国兴业银行法律顾问、资本市场及资产管理法务部门副主管，法国兴业资产管理集团法遵主管及法律顾问，华宝兴业基金管理有限公司常务副总裁，法国兴业资产管理集团亚太区执行长，东方汇理资产管理香港有限公司北亚区副执行长，爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司亚洲区副执行总监。

兰嵘女士，职工监事。学士。现任中海基金管理有限公司董事会秘书、总经理助理、综合管理部总经理。历任东海石油公司（后变更为中海石油（中国）有限公司上海分公司）工程师、人事主管，中国海洋石油总公司人事管理岗，中海信托股份有限公司人力资源部经理、财富管理中心总经理，中海基金管理有限公司综合管理部总经理、董事会秘书兼综合管理部总经理、风险管理部总经理兼风控总监。

贺俊女士，职工监事。学士。现任中海基金管理有限公司营销中心渠道及客户服务总监。历任上海市邮政储汇局稽核员，中国银河证券上海四川北路营业部柜员、场内交易员、业务部经理、综合部经理、交易部经理，中海基金管理有限公司客户服务经理、客户服务部副总监、客户服务总监。

3、高级管理人员

黄鹏先生，总经理。复旦大学金融学专业硕士。历任上海市新长宁（集团）有限公司销售经理，上海浦东发展银行股份有限公司大连分行行长秘书，中海信托股份有限公司综合管理部经理助理、投资管理部经理、风控委员会委员。2007年10月进入本公司工作，曾任董事会秘书、总经理助理兼营销中心总经理，2011年10月至今任本公司总经理，2013年2月至今任本公司董事，2013年7月至今任中海恒信资产管理（上海）有限公司董事长。

宋宇先生，副总经理。复旦大学数理统计专业学士，经济师。历任无锡市统计局秘书，国联证券股份有限公司营业部副经理、发行调研部副经理、办公室主任、研究发展部总经理。2004年3月进入本公司工作，曾任本公司督察长。2010年12月至今任本公司副总经理（期间2011年1月至2011年10月兼任本公司代理总经理），2014年5月至今兼任本公司代理督察长。

俞忠华先生，副总经理。华东师范大学世界经济专业硕士。历任申银万

国证券股份有限公司（原上海万国证券公司）国际业务部经理，国泰君安证券股份有限公司（原君安证券公司）国际业务部总经理，瑞士联盟银行（UBS）上海代表处副代表、授权官员，美国培基证券公司上海代表处首席代表、副总裁，霸菱亚洲投资公司执行董事，今日资本集团合伙人，光大证券股份有限公司销售交易部总经理、研究所常务副所长、资产管理总部总经理、证券投资部董事总经理、研究所所长。2012年3月进入本公司工作，曾任公司总经理助理，2012年6月至今任副总经理兼投研中心总经理、投资总监。2012年7月至2014年3月任中海优质成长证券投资基金基金经理，2013年2月至今任中海量化策略股票型证券投资基金基金经理。

4、基金经理

刘俊先生，复旦大学金融学专业博士。历任上海申银万国证券研究有限公司策略研究部策略分析师、海通证券股份有限公司战略合作与并购部高级项目经理。2007年3月进入本公司工作，曾任产品开发总监。2010年3月至今任中海稳健收益债券型证券投资基金基金经理，2012年6月至今任中海保本混合型证券投资基金基金经理，2013年7月至今任中海安鑫保本混合型证券投资基金基金经理，2014年5月至今任中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

5、历任基金经理

本基金基金合同于2013年7月31日生效，历任基金经理如下表：

基金经理姓名	管理本基金时间
刘俊	2013年7月31日-至今

6、投资决策委员会成员

黄鹏先生，主任委员。现任中海基金管理有限公司董事、总经理。

俞忠华先生，委员。现任中海基金管理有限公司副总经理兼投研中心总经理、投资总监、基金经理。

陆成来先生，委员。现任中海基金管理有限公司投资副总监兼固定收益部总监、基金经理。

骆泽斌先生，委员。现任中海基金管理有限公司投资副总监、基金经理。

许定晴女士，委员。现任中海基金管理有限公司研究总监、基金经理。

陈明星先生，委员。现任中海基金管理有限公司金融工程总监、基金经理。

江小震先生，委员。现任中海基金管理有限公司固定收益部副总监、基金经理。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

成立时间：1992 年 10 月 19 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：186.5347 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人：朱萍

联系电话：(021) 61618888

上海浦东发展银行经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行设资产托管与养老金业务部，下设证券托管处、客户资产托管处、养老金业务处、内控管理处、运营管理处五个职能处室，现有员工 63 人。

上海浦东发展银行拥有证券投资基金、基金公司客户资产管理计划（一对多、一对一）、保险基金、QFII、QDII、券商资产管理计划、信托计划、

年金基金、理财产品、私募基金、客户资金托管等门类齐全的托管产品体系。

三、相关服务机构

（一）销售机构

1、直销机构：

（1）中海基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

法定代表人：黄鹏

电话：021-68419518

传真：021-68419328

联系人：曾智勇

客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）或 021-38789788

公司网址：www.zhfund.com

（2）中海基金管理有限公司北京分公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 158 号 1 号楼 F218

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 158 号 1 号楼 F218

负责人：李想

电话：010-66493583

传真：010-66425292

联系人：邹意

客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）

公司网站：www.zhfund.com

2、代销机构：

（1）上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：021—61616193

传真：021-63604196

联系人：高天、杨文川

客户服务电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

（2）中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

（3）交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：021—58781234

传真：021-58408483

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

（4）招商银行股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

传真：0755-83195049

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(5) 上海农村商业银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

办公地址：上海市银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

法定代表人：胡平西

联系人：吴海平

电话：(021) 38576666

传真：(021) 50105124

客户服务电话：(021) 962999

公司网站： www.srcb.com

(6) 国联证券股份有限公司

住所：无锡市太湖新城金融一街 8 号

办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：沈刚

客户服务电话：95570

公司网址： www.glsc.com.cn

(7) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

公司网址： www.95579.com

(8) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐、许梦园

电话：400-8888-108

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：010-65182261

公司网址：www.csc108.com

（9）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

电话：021-38676161

传真：021-38670161

联系人：芮敏祺

客户服务电话：400-888-8666

公司网址：www.gtja.com

（10）申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

电话：021-54033888

联系人：李清怡

客户服务电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.sywg.com

（11）兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 268 号

办公地址：上海浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 楼

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-38565955

联系人：谢高得

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

（12）华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-83290979

传真：025-84579763

联系人：万鸣

客户服务电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

（13）中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

办公地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

法定代表人：刘军

电话：0571-87112510

传真：0571-86065161

联系人：丁思聪

客户服务电话：95548

公司网址：www.bigsun.com.cn

（14）东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人：朱科敏

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

联系人：梁旭

客户服务电话：400-888-8588

公司网址：www.longone.com.cn

（15）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

（16）中银国际证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层

法定代表人：许刚

电话：021-68604866

传真：021-50372474

联系人：李丹

客户服务电话：400-620-8888

公司网址：www.bocichina.com

（17）平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

法定代表人：杨宇翔

电话：4008866338

传真：0755-82400862

联系人：郑舒丽

客户服务电话：95511-8

公司网址：www.pingan.com

（18）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

（19）华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦

法定代表人：李晓安

电话：0931-8784656、4890208

传真：0931-4890515

联系人：李昕田

客户服务电话：400-689-8888

公司网址：www.hlzqgs.com

（20）齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号 23 层经纪业务总部

法定代表人：李玮

电话：0531-68889115

传真：0531-68889752

联系人：吴阳

客户服务电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

（21）宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

电话：010-88085201

传真：010-88085195

客户服务电话：4008-000-562

公司网址：www.hysec.com

（22）国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系人：李飞

客户服务电话：400-8888-777

公司网址：www.gyzq.com.cn

（23）渤海证券股份有限公司

住所：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：400-651-5988

公司网址：www.bhzq.com

（24）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：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

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客户服务电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

（25）中信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：顾凌

客户服务电话：400-889-5548

公司网址：www.cs.ecitic.com

（26）东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号证券大厦 1005 室

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

客户服务电话：4006000686

公司网址：www.nesc.cn

（27）华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

（28）天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法定代表人：林义相

电话：010-66045529

传真：010-66045518

联系人：尹伶

客户服务电话：010-66045678

公司网址：www.txsec.com

天相基金网网址：www.jjm.com.cn

（29）中信证券（山东）有限责任公司

住所：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：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

客服电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

（30）华林证券有限责任公司

住所：深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5-6 楼

法定代表人：薛荣年

联系人：王叶平

联系电话：0755-82707705

客服电话：400-188-3888

公司网址：<http://www.chinalions.com>

（31）杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：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

联系人：周瑾旻

联系电话：0571-28829790

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

（32）深圳众禄基金销售有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：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

联系人：汤素娅

联系电话：0755-33227950

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

（33）上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：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

业务联系人：沈雯斌

联系电话：021-58788678-8201

客服电话：400-089-1289

公司网址：www.erichfund.com

（34）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室
办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号东码头园区 C 栋
法定代表人：汪静波
联系人：方成
联系电话：021-38602377
客服电话：400—821—5399
公司网址：www.noah-fund.com

（35）和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
法定代表人：王莉
联系人：严跃俊
联系电话：021-68818891
客服电话：400-920-0022/ 021-20835588
公司网址：licaik.ehexun.com

（36）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼
法定代表人：其实
联系人：潘世友
联系电话：021-54509998
客服电话：400-1818-188
公司网址：www.1234567.com.cn

（37）万银财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201
办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201
法定代表人：李招弟
联系人：李亚洁

联系电话：010-59393923

客服电话：400-808-0069

公司网址：www.wy-fund.com

（38）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903～906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

联系电话：021-58870011

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

（39）上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 10 楼

法定代表人：盛大

联系人：徐雪吟

联系电话：021-50583533

客服电话：400-005-6355

公司网址：www.leadfund.com.cn

（40）北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 号

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 号

法定代表人：罗细安

联系人：孙晋峰

联系电话：010-67000988

客服电话：400-001-8811

公司网址：www.zcvc.com.cn

(41) 北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：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

联系人：陈攀

联系电话：010-57756019

客服电话：400-786-8868-5

公司网址：www.chtfund.com

(42) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 国际企业大厦 C 座 9 层

法定代表人：陈操

联系人：邓洁

联系电话：010-58325388-1105

客服电话：4008507771

公司网址：t.jrj.com

(43) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

联系人：胡璇

联系电话：0571-88911818

客服电话：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

(44) 中国国际期货有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、11 层、12 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、

11 层、12 层

法定代表人：王兵

联系人：孟夏

联系电话：010-59539861

客服电话：95162、400-8888-160

公司网址：www.cifco.net

基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实际情况选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构，并及时公告。

（二）登记机构

名称：中海基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

法定代表人：黄鹏

总经理：黄鹏

成立日期：2004 年 3 月 18 日

电话：021-38429808

传真：021-68419328

联系人：周琳

（三）担保人

名称：中国投融资担保有限公司

住所：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦写字楼 9 层

办公地址：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦写字楼 9 层

法定代表人：刘新来

成立日期：1993 年 12 月 4 日

组织形式：有限责任公司

注册资本：4,500,000,000 元人民币

经营范围：融资性担保业务：贷款担保、票据承兑担保、贸易融资担保、项目融资担保、信用证担保及其他融资性担保业务。监管部门批准的其他业务：债券担保、诉讼保全担保、投标担保、预付款担保、工程履约担保、尾付款如约偿付担保等履约担保业务，与担保业务有关的融资咨询、财务顾问等中介服务，以自有资金投资。投资及投资相关的策划、咨询；资产受托管理；经济信息咨询；人员培训；新技术、新产品的开发、生产和产品销售；仓储服务；组织、主办会议及交流活动。上述范围涉及国家专项规定管理的按有关规定办理。

（四）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

法定代表人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（五）审计基金财产的会计师事务所

名称：江苏公证天业会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：无锡市新区龙山路 4 号 C 幢 303 室

办公地址：无锡市梁溪路 28 号

执行事务合伙人：张彩斌

电话：0510-85888988

传真：0510-85885275

联系人：华可天

经办注册会计师：沈岩、华可天

四、基金的名称

中海安鑫保本混合型证券投资基金

五、基金的类型

保本混合型证券投资基金

六、基金的保本

（一）保本

在第一个保本周期到期日，如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和低于其认购保本金额，则基金管理人应补足该差额，并在保本周期到期日后二十个工作日内将该差额支付给基金份额持有人。

本基金第一个保本周期后各保本周期到期日，如基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其过渡期申购保本金额、或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额，则基金管理人或保本义务人应补足该差额。

基金份额持有人在保本周期内申购，或在当期保本周期到期日前赎回或转换转出的基金份额或者发生《基金合同》约定的其他不适用保本条款情形的，相应基金份额不适用本条款。

认购保本金额为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额，即基金份额持有人认购并持有到期的基金份额净认购金额、认购费用及募集期间的利息收入之和。

过渡期申购保本金额为基金份额持有人过渡期申购并持有到期的基金

份额的投资金额，即基金份额持有人在过渡期内进行申购并持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值及过渡期申购费用之和。

从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额为基金份额持有人从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的投资金额，即基金份额持有人将其上一保本周期持有到期的基金份额转入当期保本周期并持有到期的，其基金份额在折算日所代表的资产净值。

对于基金份额持有人多次认购或申购、赎回的情况，以后进先出的原则确定持有到期的基金份额。

（二）保本周期

2 年。

本基金第一个保本周期自《基金合同》生效之日起至 2 个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日。本基金第一个保本周期后的各保本周期自基金管理人公告的保本周期起始日起至 2 个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。基金管理人将在保本周期到期前公告的到期处理规则中确定下一个保本周期的起始日。

（三）保本案例

若某非养老金客户投资者投资 10,000 元认购本基金（该认购申请被全额确认）并持有到保本周期到期，认购费率为 1.0%。假定募集期间产生的利息为 3 元，持有期间基金累积分红 0.05 元/基金份额。则：

$$\text{净认购金额} = 10,000 / (1 + 1.0\%) = 9,900.99 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 10,000 - 9,900.99 = 99.01 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (10,000 - 99.01 + 3) / 1.00 = 9,903.99 \text{ 份}$$

1、若保本周期到期日，本基金基金份额净值为 0.90 元。

$$\text{认购保本金额} = 9,900.99 + 99.01 + 3 = 10,003.00 \text{ 元}$$

$$\text{可赎回金额} = 0.90 \times 9,903.99 = 8,913.59 \text{ 元}$$

$$\text{持有期间累计分红金额} = 0.05 \times 9,903.99 = 495.20 \text{ 元}$$

$$\text{可赎回金额} + \text{持有期间累计分红金额} = 9,408.79 \text{ 元}$$

即：可赎回金额+持有期间累计分红金额<认购保本金额

保本赔付差额=10,003.00-9,408.79=594.21 元

若保本周期到期日该投资者赎回基金份额，则基金管理人将按照认购保本金额（扣除其持有期间的累计分红金额）向该投资者支付10,003.00-495.20=9,507.80 元。

2、若保本周期到期日，本基金基金份额资产净值为 1.20 元。

认购保本金额=9,900.99+99.01+3=10,003.00 元

可赎回金额=1.20×9,903.99=11,884.79 元

持有期间累计分红金额=0.05×9,903.99=495.20 元

可赎回金额+持有期间累计分红金额=12,379.99 元

即：可赎回金额+持有期间累计分红金额>认购保本金额

若保本周期到期日该投资者赎回基金份额，则基金管理人将按照可赎回金额向该投资者支付 11,884.79 元。

（四）适用保本条款的基金份额

1、对于本基金第一个保本周期而言，基金份额持有人认购并持有到期的基金份额。

2、对于本基金第一个保本周期后的保本周期而言，基金份额持有人在本基金过渡期内申购并持有到期的基金份额、基金份额持有人从本基金上一个保本周期结束后选择或默认选择转入当期保本周期并持有到期的基金份额（进行基金份额折算的，指折算后对应的基金份额），按照第十八部分第二条第 8 项的约定未获得可享受保本条款确认的基金份额除外。

（五）不适用保本条款的情形

1、在保本周期到期日，按基金份额持有人认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和不低于其

认购保本金额、或过渡期申购保本金额、或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额；

2、基金份额持有人认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期，但在基金当期保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换转出的基金份额；

3、基金份额持有人在保本周期内申购或转换转入本基金的基金份额；

4、在保本周期内发生《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形；

5、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且保证人不同意继续承担保证责任或保本义务人不同意继续承担偿付责任；

6、在保本周期到期日之后（不包括该日）基金份额发生的任何形式的净值减少；

7、因不可抗力导致基金投资亏损，或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》规定的其他情形基金管理人或保本义务人免于履行保本义务的；

8、若基金份额持有人从本基金上一个保本周期结束后选择或默认选择转入当期保本周期的基金份额所代表的资产净值总额超过保证人提供的当期保本周期担保额度或保本义务人提供的当期保本周期保本额度的，基金管理人按照第十八部分第二条第 8 项的约定确认的可享受保本条款的基金份额之外的其他部分基金份额。

9、未经保证人或保本义务人书面同意修改《基金合同》条款，可能加重保证人保证责任或保本义务人偿付责任的，根据法律法规要求进行修改的除外。

七、基金的投资目标

通过采用保本投资策略，在保证本金安全的前提下，力争在保本周期内实现基金资产的稳健增值。

八、基金的投资范围

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、货币市场工具、权证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相关规定)。

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。

本基金将基金资产划分为安全资产和风险资产，其中债券及货币市场工具等属于安全资产，股票、权证等属于风险资产。债券包括国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、中期票据、可转换债券、可分离债券、债券回购、央行票据、短期融资券、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具。本基金的投资组合比例为：股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 60%，其中基金保留的现金或投资于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%。

九、基金的投资策略

本基金以 CPPI 策略为主、OBPI 策略为辅进行资产配置和投资组合管理，其中主要通过 CPPI 策略动态调整安全资产与风险资产的投资比例，以确保本基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值，从而实现基金资产的保本前提；通过 OBPI 策略控制投资组合的下行风险，同时获取投资组合的上行收益。

（1）CPPI 策略与资产配置

本基金以 CPPI 策略为主，通过设置安全垫，对安全资产与风险资产的投资比例进行动态调整，以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值，确保到期保本。

CPPI 策略的原理可以用下面的公式加以说明：

$$A_t = D_t + E_t$$

$$E_t = M_t \times (A_t - V_t)$$

$$V_t = F_t \times (1 + X_t)$$

其中， A_t 表示 t 时刻的基金资产净值， D_t 表示 t 时刻的安全资产净值， E_t 表示 t 时刻风险资产的净值；

M 为风险乘数，由基金管理人根据市场状况等因素动态调整；

V_t 表示 t 时刻的动态保本金额，称为价值底线； $(A_t - V_t)$ 称为安全垫，是指基金资产净值与价值底线之间的差额；

F_t 表示 t 时刻的最低保本金额，称为保本底线；

X_t 为在保本底线基础上上浮的比例。

该策略的具体实施方案如下：

1) 确定保本底线 F_t ：根据本基金 2 年保本周期到期时的最低目标价值（投资金额）和合理的折现率设定当前应持有的安全资产的数量，使得这部分资产到期后本利之和等于期末目标价值；此现值即为保本底线；

2) 确定价值底线 V_t ：根据保本底线的值上浮一定比例 X_t 作为动态保本金额，即确定价值底线。价值底线的设立是为更好的控制基金投资组合的下跌风险，力争使基金资产净值高于价值底线水平，从而更好的实现保本的目标。上浮比例 X_t 采取动态调整和定期调整相结合的策略，主要考虑基金单位净值增长、风险资产与安全资产的投资比例及市场状况等因素决定。价值底线的调整贯彻只升不降的原则，其实际运作中的效应为：当市场处于阶段性上涨的时候，逐渐加大风险资产的投资比例，获取更高的收益，当风险资产的投资比例达到上限的时候，由于价值底线的提升，可以保证风险资产的投资比例不超过 40% 的上限。在风险资产市场表现从顶部开始回落的时候，组合中风险资产的投资比例迅速下降，达到了避险的目标，但由于价值底线的自动提升，从而锁定了前期已实现的收益；

3) 计算基金资产净值超过价值底线的数值，该数值即为安全垫 $A_t - V_t$ ；

4) 确定风险乘数 M ：风险乘数主要通过考察以下几方面因素进行选取并由金融工程小组通过数量化研究进行定期的重新评估与调整：

a、证券市场的运行情况；

b、基金资产的风险情况；

c、国内外政治经济情况。

M 值的取值范围为 0-5 之间。

5) 确定风险资产及安全资产的投资比例：将相当于安全垫与风险乘数的乘积的资金规模投资于风险资产（如股票等）以谋求本基金高于目标价值的收益，除风险资产外剩余资金投资债券等安全资产以保证基金资产到期保本；

6) 动态调整：根据本基金的投资运作情况计算新的安全垫，就风险资产和安全资产的比例进行动态微调。

举例说明 CPPI 策略：

假定《基金合同》成立后基金净资产为 20 亿元。假定第一个保本周期内无风险年利率为 3%，则期初保本底线与价值底线为 $2,000,000,000 / (1+2*3\%) = 1,886,792,452.83$ 。若风险乘数为 2，则期初本基金可将 $2 * (2,000,000,000 - 1,886,792,452.83) = 226,415,094.34$ 元投资于风险资产，剩余的 $2,000,000,000 - 226,415,094.34 = 1,773,584,905.66$ 元投资于安全资产。

假定《基金合同》成立后的第 t 日，本基金净资产变为 21 亿元，保本底线变为 19 亿元，而价值底线在保本底线基础上上调 0.5 亿元，即为 19.5 亿元，风险乘数为 3，则第 t 日本基金将 $3 * (21 \text{ 亿} - 19.5 \text{ 亿}) = 4.5$ 亿元投资于风险资产，投资于安全资产的基金资产等于 $21 \text{ 亿} - 4.5 \text{ 亿} = 16.5$ 亿元。

假设第一个保本周期届满时，本基金基金资产净值为 24 亿元，此时组合保本底线为 20 亿元，本基金保本周期收益率为 20%，实现保本目标。

（2）OBPI 策略与组合管理

OBPI 策略主要基于期权的避险策略，在该策略中同时买入风险资产（如：股票）和以该风险资产为标的的看跌期权。当风险资产价格下跌时，可执行看跌期权，以规避风险资产价格下跌的风险；当风险资产价格上涨时，则放弃执行看跌期权，以获取风险资产价格上行的收益。

而根据期权平价公式，OBPI 策略可由风险资产和看跌期权的投资组合

衍生出另一种投资组合，即同时买入无风险资产和看涨期权，具体过程可以通过以下公式推演得到：

$$Put + S = Call + Xe^{-rt}$$

其中：Put 为看跌期权，S 为风险资产，Call 为看涨期权， Xe^{-rt} 为无风险资产，X 为期权的执行价格。

本基金可以通过上述两种不同类型的组合配置实现 OBPI 策略，达到控制下行风险、获取上行收益的投资目标。

（3）债券组合配置策略

1) 久期配置

本基金基于对宏观经济指标和宏观经济政策的分析，判断宏观经济所处的经济周期，由此预测利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性，即货币市场顺周期、债券市场逆周期的特点，确定债券资产配置的基本方向和特征；同时结合债券市场资金供求分析，最终确定投资组合的久期配置。

2) 期限结构配置

在确定组合久期后，通过研究收益率曲线形态，采用统计和数量分析技术，对各期限段的风险收益情况进行评估，对收益率曲线各个期限的骑乘收益进行分析，在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。

子弹组合，即，使组合的现金流尽量集中分布；

杠铃组合，即，使组合的现金流尽量呈两极分布；

梯形组合，即，使组合的现金流在投资期内尽可能平均分布。

（4）个券投资策略

在宏观分析和久期及期限结构配置的基础上，本基金对不同类型债券的信用风险、市场流动性、市场风险等因素进行分析，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾其基本面分析，综合分析各品种的利差和变化趋势。在信用利差水平较高时持有金融债、公司债（企业债）、资产支持证券等信用品种，在信用利差水平较低时持有国债、央行票据等利率品种，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。

1) 信用品种的投资策略（中小企业私募债除外）

本基金对金融债、企业债、公司债和资产支持证券等信用品种采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本基金在久期配置策略与期限结构配置策略基础上,运用数量化分析方法对信用品种的信用风险、流动性风险、市场风险等因素进行分析,对利差走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本基金运用行业和公司基本面研究方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。

本基金将借助公司内部行业及公司研究员的专业研究能力,并综合参考外部研究机构的研究成果,对发债主体企业进行深入的基本面分析,主要包括经营历史、行业地位、竞争实力、公司治理、股东或地方政府的实力以及支持力度等;并结合债券的发行条款,综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上以确定信用品种的实际信用风险状况及其信用利差水平,投资于信用风险相对较低、信用利差收益相对较大的优质品种。

2) 中小企业私募债投资策略

本基金对中小企业私募债的投资策略主要基于信用品种投资略,在此基础上重点分析私募债的信用风险及流动性风险。首先,确定经济周期所处阶段,研究私募债发行人所处行业在经济周期和政策变动中所受的影响,以确定行业总体信用风险的变动情况,并投资具有积极因素的行业,规避具有潜在风险的行业;其次,对私募债发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力综合分析;最后,结合私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素,综合评价私募债的信用风险和流动性风险,选择风险与收益相匹配的品种进行配置。

3) 可转换债券投资策略

可转换债券的资产特性即包含一个看涨期权和无风险债券资产,即OBPI策略公式中的 $Call + Xe^{-rt}$,因此,本基金可通过可转换债券来实现OBPI策略。在本基金购入可转换债券后,可将其视为债券和与其相对应的看涨期权的投资组合,分别列入安全资产和风险资产,利用可转换债券自身特性来避免因频繁调整安全资产与风险资产比例带来的交易成本。当基础股票价格远低

于转股价时，本基金可选择将可转换债券持有到期，享受债券本息收益；当基础股票价格远高于转股价时，本基金可选择将可转换债券转换为股票，然后卖出股票，享受股票差价收益。因此，在此策略下，投资可转换债券可控制下行风险并获取上行收益。

基于以上的理论基础，本基金在进行可转换债券投资时，将首先对可转换债券自身的内在债券价值（如票面利息、利息补偿及无条件回售价格）、保护条款的适用范围、流动性等方面进行研究；然后对可转换债券的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估；最后将可转换债券自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起，选择被市场低估的品种，以合理价格买入并持有，获取稳健的投资回报。

（5）股票投资策略

在股票投资中，本基金采用定量分析与定性分析相结合的方法，选择其中经营稳健、具有核心竞争优势的上市公司进行投资。其间，本基金也将积极关注上市公司基本面发生改变时所带来的投资交易机会。

1) 定量分析

本基金通过综合考察上市公司的财务优势、估值优势和成长优势来进行个股的筛选。

本基金考察的财务指标主要包括：净资产收益率、资产负债率。

本基金考察的估值指标主要包括：市盈率、市净率和市销率。

本基金考察的成长指标主要包括：营业收入增长率、净利润增长率。

本基金将结合市场形势综合考虑上市公司在各项指标的综合得分，按照总分的高低在各行业内进行排序，选取各行业排名靠前的股票。

2) 定性分析

本基金主要通过实地调研等方法，综合考察评估公司的经营情况，重点投资具有较高进入壁垒、在行业中具备比较优势、经营稳健的公司，并坚决规避那些公司治理混乱、管理效率低下的公司，以确保最大程度地规避投资风险。

（6）权证投资策略

本基金在买入股票等风险资产时，同时投资以其为标的的看跌期权（即 OBPI 策略公式中的 $S + \text{Put}$ ）；或者在买入债券等无险资产时，同时投资看涨期权（即 OBPI 策略公式中的 $\text{Call} + Xe^{-rt}$ ），以实现控制下行风险、获取上行收益的目标。

本基金将在以上理论框架的基础上，运用期权估值模型，根据隐含波动率、剩余期限、正股价格走势，并结合本基金的资产组合状况进行权证投资。

十、基金的投资限制

（1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1) 在保本周期内，本基金股票、权证等风险资产占基金资产的比例不超过 40%，债券及货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 60%；

2) 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；

3) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超

过该资产支持证券规模的 10%；

11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

15) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

(2) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

-
- 1) 承销证券；
 - 2) 向他人贷款或者提供担保；
 - 3) 从事承担无限责任的投资；
 - 4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
 - 5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
 - 6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
 - 7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
 - 8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

十一、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：2 年期银行定期存款利率（税后）。

在基金合同生效日，业绩比较基准为中国人民银行公布的、该日适用的 2 年期银行定期存款利率（税后）；并随着 2 年期银行定期存款利率的调整而动态调整。

本基金是保本混合型基金，保本周期为 2 年，保本但不保证收益。目前，银行定期存款类似于保本定息产品。根据本基金的投资策略、保本期限和目标客户等特点，以 2 年期银行定期存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金保本受益人理性判断本基金的风险收益特征，合理地衡量比较本基金保本保证的有效性。

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，在报中国证监会备案后变更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。

十二、基金的风险收益特征

本基金为保本混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

十三、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本基金投资组合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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据基金合同规定，于2014年8月18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为截至2014年6月30日报告期末的半年报数据。

1、基金资产组合情况

截至2014年6月30日，中海安鑫保本混合型证券投资基金资产净值为234,799,008.82元，基金份额净值为1.028元，累计基金份额净值为1.028元。其资产组合情况如下：

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	19,269,771.16	8.15
	其中：股票	19,269,771.16	8.15
2	固定收益投资	204,498,120.67	86.45
	其中：债券	204,498,120.67	86.45
	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	7,643,942.04	3.23
7	其他资产	5,152,248.75	2.18
8	合计	236,564,082.62	100.00

2、 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	-	-
C	制造业	15,127,071.16	6.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	540,000.00	0.23
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	2,236,200.00	0.95
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,366,500.00	0.58
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	19,269,771.16	8.21

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

金额单位：人民币元

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	600594	益佰制药	59,832	2,460,890.16	1.05
2	002450	康得新	100,000	2,275,000.00	0.97
3	300034	钢研高纳	125,000	2,076,250.00	0.88
4	300072	三聚环保	90,000	1,799,100.00	0.77
5	300147	香雪制药	60,000	1,620,000.00	0.69
6	300026	红日药业	55,170	1,616,481.00	0.69
7	300010	立思辰	60,000	1,495,200.00	0.64
8	002465	海格通信	90,000	1,433,700.00	0.61
9	002672	东江环保	50,000	1,366,500.00	0.58
10	002185	华天科技	100,000	1,118,000.00	0.48

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	15,024,500.00	6.40
	其中：政策性金融债	15,024,500.00	6.40
4	企业债券	184,416,049.07	78.54
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	5,057,571.60	2.15
8	其他	-	-
9	合计	204,498,120.67	87.09

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

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	1180083	11 汉江水电债	200,000	20,366,000.00	8.67
2	1080119	10 无锡城投债	200,000	19,980,000.00	8.51
3	126019	09 长虹债	165,510	15,794,619.30	6.73
4	122040	09 新黄浦	150,000	15,060,000.00	6.41
5	122034	09 中企债	129,880	13,067,226.80	5.57

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

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名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

根据基金合同规定，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

根据基金合同规定，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合约。

10.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

11、投资组合报告附注

（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。

（2）报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 截至 2014 年 6 月 30 日，本基金的其他资产项目构成如下：

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	93,957.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,057,995.27
5	应收申购款	296.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,152,248.75

(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	110017	中海转债	2,335,381.60	0.99
2	128001	泰尔转债	2,180,380.00	0.93

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金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。

十四、基金的业绩

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。

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较（截止日期 2014年06月30日）：

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. 7. 31-2013. 12. 31	-0.30%	0.08%	1.58%	0.01%	-1.88%	0.07%
2014. 1. 1-2014. 6. 30	3.11%	0.15%	1.83%	0.01%	1.28%	0.14%
自基金成立以来至今	2.80%	0.12%	3.44%	0.01%	-0.64%	0.11%

注：本基金合同生效日为2013年7月31日，基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十五、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、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 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：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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。

上述“一、基金费用的种类中第 3—7 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。

到期操作期间（保本周期到期日除外）和过渡期内本基金不计提管理费和托管费。

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法同上。

（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，包括但不限于验资费、会计师和律

师费、信息披露费用等费用。

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。

十六、对招募说明书更新部分的说明

（一）在“基金管理人”部分，对“主要人员情况”进行了更新。

（二）对“基金托管人”部分进行了更新。

（三）对“相关服务机构”部分进行了更新。

（四）在“基金保本保障机制”部分，对“保证人或保本义务人”部分进行了更新。

（五）在“基金的投资”部分，对“基金投资组合报告”按最新资料进行了更新。

（六）对“基金的业绩”部分按最新资料进行了更新。

（七）在“其他应披露的事项”部分，披露了本期间本基金的公告信息。

中海基金管理有限公司

二〇一四年九月十三日