中海货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要

（2011年第1号）

本基金基金合同于2010年7月28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。

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2011年1月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2010年12月31日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

本基金管理人为中海基金管理有限公司，基本信息如下：

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
设立日期：2004年3月18日
法定代表人：陈浩鸣
总经理：宋宇（代理总经理）
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）。
组织形式：有限责任公司
注册资本：1.3亿元
联系人：夏立峰
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	46.923%
国联证券股份有限公司	37.692%
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司	15.385%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

陈浩鸣先生，代理董事长，董事。中央财经大学硕士，高级经济师。现拟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。

储晓明先生，董事。香港大学硕士。现任申银万国证券股份有限公司总裁。历任中国工商银行评估部处长、风险管理部副总经理级干部，中海石油财务有限责任公司副总经理，中海信托股份有限公司常务副总经理、总裁（期间曾兼任中海基金管理有限公司董事长）。

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。

张志伟先生，董事。复旦大学硕士。现任国联证券股份有限公司总裁。历任无锡国联发展（集团）有限公司金融管理部经理、国联证券股份有限公司投资银行部总经理、国联证券股份有限公司副总裁。

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。

温天先生，董事。硕士。现任法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司执行董事、上海代表处首席代表、中国地区负责人，兼任法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司旗下注册于卢森堡的私募股权基金Orient Express China Fund的董事。历任北京、上海主流新闻媒体财经节目负责人、记者、主编，上海银行支行负责人（短期）、部门总经理，华安基金管理有限公司高级研究员、产品部门负责人、市场部门负责人和公司战略总监。

夏斌先生，独立董事。硕士，研究员，教授。现任国务院发展研究中心金融研究所所长。历任中国人民银行总行处长、副所长，中国证监会交易部主任兼信息部主任，深圳证券交易所总经理，中国人民银行非银行金融机构监管司司长。

陈瑛明先生，独立董事。复旦大学硕士。现任上海市瑛明律师事务所首席合伙人。历任香港史密夫律师行法律顾问、福建江成律师事务所合伙人、上海市新闵律师事务所专职律师。

李维森先生，独立董事。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。

2、监事会成员

朱恩惠女士，监事长。本科，会计师。现任中海信托股份有限公司运营总监兼信托事务管理总部总经理、托管部部门经理。曾任职于中信上海信托投资公司财务部。

Humbert GARREAU de LABARRE，监事。法国国籍。法国巴黎第九大学硕士。现任法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司私人银行部高级副总裁。历任Neuflize，Schlumberger，Mallet银行-荷银集团（法国巴黎）私人银行业务专业银行资产组合经理，Cie Financière爱德蒙得洛希尔银行（法国巴黎）资产组合经理。

王红女士，职工监事。研究生毕业。现任中海基金管理有限公司总经理助理兼北京分公司总经理。历任辽宁省针棉毛织品进出口公司储运科科员、北京中盛纸业有限公司总经理助理、北京大地投资有限公司总经理助理兼市场营销部经理、湘财证券有限责任公司北京办事处主任。2007年1月进入本公司工作，历任北京管理总部副总经理、北京分公司总经理。2009年1月至今任本公司总经理助理兼北京分公司总经理。

3、高级管理人员

宋宇先生，副总经理、代理总经理。复旦大学学士，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，2011年1月至今任本公司代理总经理。

李延刚先生，副总经理，加拿大国籍。南京大学学士，加拿大西蒙弗雷泽大学硕士，注册金融分析师（CFA）。历任中储发展股份有限公司海外业务发展助理、业务发展经理、战略发展总监，伦敦资产管理有限公司投资顾问、基金经理。2007年7月进入本公司工作，历任投资管理部副总经理、投研中心总经理。2009年4月至今任本公司副总经理。2008年1月至2009年6月任中海能源策略混合型证券投资基金基金经理，2008年4月至2009年6月任中海分红增利混合型证券投资基金基金经理，2009年6月至今任中海量化策略股票型证券投资基金基金经理。

朱冰峰先生，督察长。华东政法学院学士。历任长江律师事务所律师、华虹（集团）有限公司法律顾问、锦天城律师事务所律师、上海证监局副处级职务。2009年10月进入本公司工作，曾任总经理助理。2010年12月至今任本公司督察长。

4、基金经理

江小震先生，基金经理。复旦大学硕士。历任长江证券股份有限公司投资经理、中维资产管理有限责任公司部门经理、天安人寿保险有限公司（原名恒康天安保险有限责任公司）投资部经理、太平洋资产管理有限责任公司高级经理。2009年11月进入本公司工作，现任投研中心固定收益小组负责人。2010年7月至今任中海货币市场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2010年7月28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
江小震	2010年7月28日-至今

6、投资决策委员会成员

李延刚先生，主任委员。现任中海基金管理有限公司副总经理、基金经理。
朱劲松先生，委员。现任中海基金管理有限公司总经理助理、风险管理部总经理、风控总监。
吕晓峰先生，委员。现任中海基金管理有限公司投研中心总经理、投资总监。
骆泽斌先生，委员。现任中海基金管理有限公司研究总监。
陶林健先生，委员。现任中海基金管理有限公司投资副总监、基金经理。
杨济如女士，委员。现任中海管理有限公司基金经理。
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。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

名称：中国工商银行股份有限公司
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：姜建清
注册资本：人民币334，018，850，026元
联系电话：010-66105799
联系人：蒋松云

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：陈浩鸣
总经理：宋宇（代理总经理）
成立日期：2004年3月18日
电话：021-68419518
传真：021-68419328
联系人：周颖
客户服务电话：400-888-9788或021-38789788
公司网站：www.zhfund.com

（2）中海基金管理有限公司北京分公司
办公地址：北京市西城区复兴门内大街158号远洋大厦F218
电话：010-66493583
传真：010-66425292
联系人：邹意
客户服务电话：400-888-9788
公司网站：www.zhfund.com

2、代销机构：

（1）中国工商银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
传真：010-66107914
客户服务电话：95588
公司网址：www.icbc.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：项俊波
联系人：滕涛
传真：010-85109219
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：胡怀邦
电话：021-58781234
传真：021-58408842
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：傅育宁
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）中国民生银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
电话：010-57092615
传真：010-57092611
联系人：董云巍
客户服务电话：95568
公司网址：www.cmbc.com.cn

（6）上海浦东发展银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区浦东南路500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：021-61618888
传真：021-63604199
联系人：倪苏云、虞谷云
客户服务电话：95528
公司网址：www.spdb.com.cn

（7）温州银行股份有限公司
住所：温州市车站大道华海广场1号楼
办公地址：温州市车站大道196号
法定代表人：邢增福
联系电话：0577-88990082
传真：0577-88995217
联系人：林波
客户服务电话：0577-96699
公司网址：www.wzbank.cn

（8）国联证券股份有限公司
住所：无锡市县前东街168号
办公地址：无锡市县前东街168号
法定代表人：雷建辉
电话：0510-82831662
传真：0510-82830162
联系人：徐欣
客户服务电话：0510-82588168
公司网址：www.glsc.com.cn

（9）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

（10）海通证券股份有限公司
住所：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
电话：021-23219000
传真：021-23219100
联系人：金芸、李笑鸣
客户服务电话：95553
公司网址：www.htsec.com

（11）中国银河证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址：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：顾伟国
电话：010-66568047
传真：010-66568536
联系人：李洋
客户服务电话：4008-888-888
公司网址：www.chinastock.com.cn

（12）中信建投证券有限责任公司
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：张佑君
联系人：权唐
开放式基金咨询电话：400-888-8108
开放式基金业务传真：010-65182261
公司网址：www.csc108.com

（13）国泰君安证券股份有限公司
注所：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

（14）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：丁国荣
电话：021-54033888
联系人：李清怡
客户服务电话：021-962505
公司网址：www.sw2000.com.cn

（15）广发证券股份有限公司
住所：广东广州天河北路大都会广场43楼
办公地址：广东广州天河北路大都会广场36、38、41和42楼
法定代表人：王志伟
电话：020-87555888
传真：020-87555305
联系人：黄岚
客户服务电话：95575
公司网址：www.gf.com.cn

（16）湘财证券有限责任公司
住所：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人：林俊波
电话：021-68634518
传真：021-68865680
联系人：鲁雁先
客户服务电话：400-888-1551
公司网址：www.xcsc.com

（17）兴业证券股份有限公司
住所：福建省福州市湖东路99号标力大厦
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：021-38565783
联系人：谢高得
客户服务电话：400-8888-123
公司网址：www.xyzq.com.cn

（18）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：025-84457777
传真：025-84579763
联系人：万鸣
客户服务电话：95597
公司网址：www.htsc.com.cn

（19）东方证券股份有限公司
住所：上海市中山南路318号2号楼21层-29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼21层-29层
法定代表人：王益民
电话：021-63325888
传真：021-63326173
联系人：吴宇
客户服务电话：021-95503或4008-888-506
公司网址：www.dfzq.com.cn

（20）东吴证券股份有限公司
住所：江苏省苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
办公地址：江苏省苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
法定代表人：吴永敏
电话：0512-65581136
传真：0512-65588021
联系人：方晓丹
客户服务电话：0512-33396288
公司网址：www.dwzq.com.cn

（21）中信金通证券有限责任公司
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层
法定代表人：刘军
电话：0571-85783737
传真：0571-85106383
联系人：俞会亮
客户服务电话：96598
公司网址：www.bigsun.com.cn

（22）金元证券股份有限公司
住所：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人：陆涛
电话：0755-83025666
传真：0755-83025625
联系人：马贤清
客户服务电话：4008-888-228
公司网址：www.jyzq.com.cn

（23）东海证券有限责任公司
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：李涛
客户服务电话：400-888-8588
公司网址：www.longone.com.cn

（24）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

（25）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：唐新宇
电话：021-68604866
传真：021-50372474
联系人：张静
客户服务电话：400-620-8888
公司网址：www.bocichina.com

（26）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：400-881-6168
公司网址：www.pingan.com

（27）华泰联合证券有限责任公司
住所：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A
办公地址：深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层
法定代表人：马昭明
电话：0755-82492000
传真：0755-82492962
联系人：盛宗凌、庞晓芸
客户服务电话：95513
公司网址：www.lhzq.com

（28）西南证券股份有限公司
住所：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A座22-25层
法定代表人：王珠林
电话：023-63786922
传真：023-63786215
联系人：陈诚
客户服务电话：400-8096-096
公司网址：www.swsc.com.cn

（29）安信证券股份有限公司
住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层
法定代表人：牛冠兴
电话：021-68801217
传真：021-68801210
联系人：张勤
客户服务电话：4008-001-001
公司网址：www.essence.com.cn

（30）光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
电话：021-22169999
传真：021-22169134
联系人：刘晨
客户服务电话：400-888-8788或10108998
公司网址：www.ebscn.com

（31）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：甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人：李晓安
电话：0931-4890100
传真：0931-4890515
联系人：李昕田
客户服务电话：0931-4890100、4890619、4890618
公司网址：www.hlzqgs.com

（32）国信证券股份有限公司
住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
联系人：齐晓燕
客户服务电话：95536
公司网址：www.guosen.com.cn

（33）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

（34）第一创业证券有限责任公司
住所：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
法定代表人：刘学民
联系人：崔国良
电话：0755-25832852
传真：0755-82485081
客户服务电话：0755-25832583
公司网址：www.firstcapital.com.cn

（35）万联证券有限责任公司
住所：广州市中山二路18号广东电信广场36、37层
办公地址：广州市中山二路18号广东电信广场36、37层
法定代表人：张建军
电话：020-37865070
联系人：罗创斌
开放式基金咨询电话：400-8888-133
开放式基金接收传真：020-22373718-1013
公司网址：www.wlzq.com.cn

（36）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：010-88085338
传真：010-88085240
客户服务电话：4008-000-562
公司网址：www.hysec.com

（37）中国建银投资证券有限责任公司
住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层
法定代表人：杨明辉
电话：0755-82023442
传真：075582026539
联系人：刘毅
客户服务电话：400-600-8008
公司网址：www.cjis.cn

（38）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

（39）渤海证券股份有限公司
住所：天津市经济技术开发区第一大街29号
办公地址：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：王春峰
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

（40）国金证券股份有限公司
住所：成都市东城根上街95号
办公地址：成都市东城根上街95号6、16、17楼
法定代表人：冉云
联系人：金喆
客户服务电话：400-660-0109
公司网址：www.gjzq.com.cn

（41）信达证券股份有限公司
住所：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
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

（42）中信证券股份有限公司
住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层
法定代表人：王东明
联系电话：010-84683343
传真：010-84865560
联系人：张于爱
公司网址：www.cs.ecitic.com

（43）方正证券有限责任公司
住所：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：彭博
联系电话：0731-85832343
传真：0731-85832214
客户服务电话：95571
公司网址：www.foundersc.com

(44)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
法定代表人：矫正中
联系人：潘锴
电话：0431-85096709
客户服务电话：4006000686
公司网址：www.nesc.cn

（45）广发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、8、10层
法定代表人：黄金琳
联系人：张腾
联系电话：0591-87841160
传真：0591-87841150
客户服务电话：0591-96326
公司网址：www.gfhfzq.com.cn

（46）东兴证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人：崔海涛
联系人：黄英
客户服务电话：4008-888-993
公司网址：www.dxzq.net

（47）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：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
电话：010-66045446
传真：010-66045500
联系人：潘鸿
客户服务电话：010-66045678
公司网址：www.txsec.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

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：陈浩鸣
总经理：宋宇（代理总经理）
成立日期：2004年3月18日
电话：021-38429808
传真：021-68419328
联系人：曹伟

（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
法定代表人：韩炯
电话：021-31358666
传真：021-31358600
经办律师：吕红、黎明

（四）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有限公司
住所：无锡市新区开发区旺庄路生活区
办公地址：无锡市梁溪路28号
法定代表人：张彩斌
电话：0510-85888988 85887801
传真：0510-85885275
经办注册会计师：沈岩、华可天

四、基金的名称

中海货币市场证券投资基金

五、基金的类型

货币市场证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金投资目标是在保证资产安全与资产充分流动性前提下，追求高于业绩比较基准的收益率，为基金份额持有人创造稳定的当期收益。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为：

（1）现金；
（2）通知存款；
（3）短期融资券；
（4）一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；
（5）剩余期限在397天以内（含397天）的债券；
（6）期限在一年以内（含一年）的债券回购；
（7）期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；
（8）剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券；
（9）中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天。投资过程按照平衡组合流动性和最大化投资收益的原则对品种的投资比例进行动态调整。

八、基金的投资理念

团队缜密研究、量化系统精确测算，运用现金流管理策略构建短期金融工具投资组合和套利操作，以便在保证基金财产的安全性和流动性的基础上，获得稳定的当期收益。

九、基金的投资策略

1、利率预期策略

根据对宏观经济和利率走势的分析，本基金将制定利率预期策略。如果预期利率下降，将增加组合的久期；反之，如果预期利率将上升，则缩短组合的久期。

2、期限结构配置策略

各类债券资产在期限结构上的配置是本基金所选择的收益率曲线策略在资产配置过程中的具体体现。其做法是，根据对收益率曲线形状的变化预期，采用总收益分析法在下述的三种基础类型中进行选择：

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。

3、类属配置策略

在保持组合资产相对稳定的条件下，根据各类短期金融工具（国债、金融债、央行票据、回购等）的市场规模、收益性和流动性，决定各类资产的配置比例；再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

4、流动性管理策略

在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下，通过基金资产安排（包括现金库存、资产变现、剩余期限管理或以其他措施），在保持基金资产高流动性的前提下，确保基金的稳定收益。

5、套利策略

本基金的套利策略主要分为正回购与银行同业存款之间的套利策略、正回购与逆回购之间的套利策略、跨市场套利策略以及跨期限套利策略四大类：

正回购与银行同业存款之间的套利

所谓正回购与银行同业存款之间的套利，指的是以低于金融同业存款利率的价格融入资金后，再以金融同业存款利率存放银行，从而获得收益。

正回购与逆回购之间的套利

同一市场异日正回购与逆回购之间的套利

所谓同一市场异日正回购与逆回购之间的套利，指的是在同一市场第T天以低于金融同业存款利率的成本融入资金，而在T天后选定的交易日以高于金融同业存款利率的价格融出资金，从而获取收益。

同日正回购与逆回购之间的套利

所谓同日正回购与逆回购之间的套利，指的是第T天以低于金融同业存款利率的成本融入资金，同时在该天以高于金融同业存款利率的价格在同一品种上融出资金，从而获取收益。

跨市场套利

所谓跨市场套利指的是在利率低的市场融入资金同时在利率高的市场融出去，从而获取收益；

跨市场异日正回购与逆回购之间的套利

所谓跨市场异日正回购与逆回购之间的套利，指的是第T天在一个市场以较低的成本融入资金，而在T天后选定的交易日在另一个市场以高于成本的价格融出资金，从而获取收益。

回购与债券之间的套利

所谓在回购与债券之间的套利是指在利率低的市场融入资金，投资在收益率较高的债券（含央行票据）市场上，从而获取收益。

跨期限套利

跨期限套利是指在满足货币基金投资平均剩余期限的条件下，当较短期回购利率低于较长期回购利率时，进行较短期滚动正回购操作和较长期逆回购操作而实现跨期限套利；或当较短期回购利率高于较长期回购利率时，进行较长期正回购操作和较短期滚动逆回购操作而实现跨期限套利。

十、基金的投资限制

1、本基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金不得投资于以下金融工具：
1）股票；
2）可转换债券；
3）剩余期限超过397天的债券；
4）信用等级在AAA级以下的企业债券；
5）以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但市场条件发生变化后另有规定的，从其规定；
6）非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券；
7）中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

（2）本基金的投资组合将遵循以下比例限制：

1）本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天；

2）本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券发行总规模的10%；

3）本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的30%；

4）本基金持有的剩余期限不超过397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%；

本基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动债券；

5）本基金买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过397天；

6）本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的5%；

7）本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的10%；

8）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%；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%；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%；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%；

9）除发生巨额赎回的情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%；因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的，基金管理人应当在5个交易日内进行调整；

10）在全国银行间债券市场债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的百分之四十。在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

11）本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：

A、国内信用评级机构评定的A-1级或相当于A-1级的短期信用级别；

B、根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级应具备下列条件之一：

A）国内信用评级机构评定的AAA级或相当于AAA级的长期信用级别；

B）国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。

同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。本基金持有的短期融资券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起20个交易日内对其予以全部减持；

12）中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。

除上述第（9）条和（11）外，因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到上述标准。法律法规另有规定时，从其规定。

（3）本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的AAA级或相当于AAA级的信用级别。

本基金持有的资产支持证券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起3个月内对其予以全部卖出。

（4）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本基金合同生效之日起开始。

若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，基金管理人履行适当程序后，本基金可相应调整投资限制规定。法律法规或中国证监会取消该等限制的，基金管理人履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

（1）承销证券；
（2）向他人贷款或提供担保；
（3）从事承担无限责任的投资；
（4）买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
（5）向基金管理人、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债券；
（6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
（8）本基金不得与基金管理人的股东进行交易，不得通过交易上的安排人为降低投资组合的平均剩余期限的真实天数；
（9）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

十一、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：同期7天通知存款利率（税后）

通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期7天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十二、基金的风险收益特征

本基金属货币市场证券投资基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2011年2月16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2010年12月31日报告期末的第四季度报告数据，其中所列财务数据未经审计。

1、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	固定收益投资	401，176，512.21	8.63
	其中：债券	401，176，512.21	8.63
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3，026，602，855.60	65.08
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1，213，383，125.66	26.09
4	其他各项资产	9，099，468.18	0.20
5	合计	4，650，261，961.65	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.51	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

3、基金投资组合平均剩余期限

3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	25
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

注：根据本基金基金合同规定，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，下同。

3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	84.33	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	3.49	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	7.87	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.86	-
4	90天（含）—180天	1.31	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天（含）—397天（含）	2.83	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.82	-

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	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	9，952，141.01	0.22
3	金融债券	170，998，348.51	3.73
	其中：政策性金融债	170，998，348.51	3.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	220，226，022.69	4.80
6	其他	-	-
7	合计	401，176，512.21	8.74
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	131，056，332.25	2.86

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	070211	07国开11	800，000	80，660，941.98	1.76
2	100221	10国开21	400，000	39，942，016.26	0.87
3	070219	07国开19	300，000	30，196，391.88	0.66
4	1081161	10赛尔CPO1	300，000	30，018，124.32	0.65
5	090407	09农发07	200，000	20，198，998.39	0.44
6	1081212	10豫投资CPO1	200，000	20，057，530.85	0.44
7	1081086	10柳化工CPO1	200，000	20，048，025.47	0.44
8	1081254	10新奥CPO1	200，000	20，035，348.39	0.44
9	1081100	10传化CPO1	200，000	20，031，411.44	0.44
10	1081211	10晋三维CP02	200，000	20，002，904.14	0.44

6、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25（含）-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0800%
报告期内偏离度的最低值	-0.2003%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0699%

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。

8、投资组合报告附注

8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提收益。

8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券，未发生该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

8.3 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。

8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	8，479，277.91
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	620，190.27
7	其他	-
8	合计	9，099，468.18

8.5 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。

基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较（截止日期2010年12月31日）：

1、A级基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去1个月	0.2049%	0.0023%	0.1157%	0.0000%	0.0892%	0.0023%
过去3个月	0.5128%	0.0029%	0.3442%	0.0000%	0.1686%	0.0029%
自基金合同生效起至今	0.7081%	0.0026%	0.5888%	0.0000%	0.1193%	0.0026%

2、B级基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去1个月	0.2247%	0.0023%	0.1157%	0.0000%	0.1090%	0.0023%
过去3个月	0.5736%	0.0028%	0.3442%	0.0000%	0.2294%	0.0028%
自基金合同生效起至今	0.8134%	0.0026%	0.5888%	0.0000%	0.2246%	0.0026%

注：本基金合同生效日为2010年7月28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、基金销售服务费；
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费。
6、基金份额持有人大会费用。
7、基金的证券交易费用。
8、基金的银行汇划费用。
9、按照法律法规有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（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0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.33%÷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，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2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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.10%÷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，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2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。

3、基金销售服务费

本基金A级基金份额的销售服务费年费率为0.25%，B级基金份额的销售服务费年费率为0.01%。各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

H=E×R÷当年天数
H为每日该级基金份额应计提的基金销售服务费
E为前一日该级基金份额的基金资产净值
R为该级基金份额的年销售服务费率

基金销售服务费每日计算，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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性划付基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第4-9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。

（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）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费服务率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体上公告。

（五）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“基金管理人概况”和“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“基金份额的申购和赎回”部分，对“基金的转换”和“定期定额投资计划”进行了更新。
（五）在“基金的投资”部分，新增“基金投资组合报告”并按最新资料进行了更新。
（六）新增“基金的业绩”并按最新资料进行了更新。
（七）在“对基金份额持有人的服务”部分，对“定期定额投资计划”
进行了更新。
（八）新增“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
二〇一一年三月十一日