# 中海能源策略混合型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2007年3月13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。

本更新招募说明书所载内容截止日为2011年3月13日，有关财务数据和净值表现截止日为2010年12月31日。

**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。硕士。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。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（朝间曾兼任中海基金管理有限公司董事长）。

成赤先生，董事。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。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。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（朝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。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《宏观经济管理》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。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，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。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。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、现任基金经理

陶林健先生，上海交通大学硕士。历任长江证券股份有限公司上海总部市场部投资经理助理，无锡玫瑰机械厂管理部经理，中金东方资产管理有限责任公司证券研究中心研究员，上海钜鸿投资管理有限责任公司证券投资部投资经理，西部证券股份有限公司投资管理总部投资经理、客户资产管理总部投资经理。2007年3月起进入本公司工作，曾任分析师兼基金经理助理，现任投资副总监。2009年6月至2011年2月任中海分红增利混合型证券投资基金基金经理，2010年5月至今任中海能源策略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2007年3月13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 |
|---|---|
| 朱晓明 | 2007年3月13日-2008年1月9日 |
| 朱晓明 李延刚 | 2008年1月10日-2008年11月11日 |
| 李延刚 施恒新 | 2008年11月12日-2009年6月22日 |
| 施恒新 | 2009年6月23日-2010年5月4日 |
| 陶林健 | 2010年5月5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。

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。现任中海基金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：赵会军

**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

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

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

公司网址：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中国银行股份有限公司

住所：北京西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

传真：010-66594946

客户服务电话：95566

公司网站：www.boc.cn

④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

⑤中国建设银行股份有限公司

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：郭树清

联系电话：010-67596093

联系人：何奕

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

⑥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：邓炳鹏

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

⑦中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：孔丹

客户服务电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

⑧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

⑨深圳发展银行股份有限公司

住所：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

联系电话：0755-82088888

传真电话：0755-82080714

联系人：张青

客户服务电话：95501

公司网址：www.sdb.com.cn

⑩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

⑪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

⑫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

⑬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

⑭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

⑮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

⑯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

⑰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

⑱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

⑲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

⑳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：鲁雁光

客户服务电话：400-888-1551

公司网址：www.xcsc.com

㉑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

㉒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

㉓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

㉔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

㉕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

㉖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

㉗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

㉘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

㉙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.bociehina.com

㉚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：邓舒丽

客户服务电话：400-881-6168

公司网址：www.pingan.com

㉛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

㉜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

㉝longone金融服务有限公司

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

㉞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

㉟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：0931-4890100

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

㊱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

㊲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

㊳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：400-888-1888

公司网址：www.firstcapital.com.cn

㊴万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

㊵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

㊶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

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第18层至21层

法定代表人：杨明辉

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

联系人：刘毅

客户服务电话：400-600-8008

公司网址：www.cjis.cn

㊷longzhong证券有限公司

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

㊸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

㊹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

㊺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

㊻平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

㊼万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

㊽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：潘锵

电话：0431-85096709

客户服务电话：4006000686

公司网址：www.nesc.cn

㊾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

㊿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

(51)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：021-68419525

联系人：曹伟

（三）注具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

法定代表人：廖海

电话：021-51150298

传真：021-51150398

经办律师：廖海、田卫红

（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**

中海能源策略混合型证券投资基金

**五、基金的类型**

契约型开放式

**六、基金的投资目标**

在世界能源短缺和中国经济增长模式向节约型转变的背景下，以能源为投资主题，重点关注具备能源竞争优势的行业和企业，精选个股，并结合积极的权重配置，谋求基金资产的长期稳定增值。

**七、基金的投资范围**

本基金投资范围限于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、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合的资产配置：股票资产30%-95%，债券资产（含短期融资券和资产证券化产品）0%-65%，权证投资0%-3%，本基金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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他产品（如股指期货、期权等衍生品），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80%以上的非现金基金资产投资于能源主题类股票、债券、权证等资产。

**八、基金的投资理念**

基于国家能源战略，综合考虑全球地缘政治、军事、经济、气象等多方面因素，从能源竞争优势的角度评估中国企业的投资价值，进行主动的投资组合管理。

**九、基金的投资策略**

1、一级资产配置：本基金根据股票和债券估值的相对吸引力模型（ASSVM，A Share Stocks Valuation Model），依据宏观经济分析和股票债券估值比较进行一级资产配置。ASSVM模型通过对股票市场和债券市场相对估值判断，决定股票和债券仓位配置。投资决策委员会作为本基金管理人投资的最高决策机构和监督执行机构，决定本基金的一级资产配置。

2、股票投资：本基金围绕能源主题。首先，根据摩根斯坦利和标准普尔公司联合发布的全球行业四级分类标准（GICS），对A股所有行业进行了重新划分。将A股所有行业划分为能源供给型行业和能源消耗型行业；然后，将能源供给型行业细分为能源生产行业和能源设备与服务行业，将能源消耗型行业细分为低耗能行业和高耗能行业（能源下游需求各行业能耗相对高低的界定，主要来源于国家统计局和国家发改委的相关文件）。

本基金股票资产的行业配置主要依据中海能源竞争优势评估体系。本基金依托中海油在能源研究方面的独特优势，收集整理外部能源专家和其他研究机构的研究成果，综合考虑全球地缘政治、军事、经济、气象等多方面因素，结合本公司内部能源研究小组的研究，对未来能源价格的趋势进行预测。在此基础上，行业研究小组根据经济增长和能源约束的动态发展关系，结合未来能源价格趋势的预测，从能源策略的角度，确定能源主题类行业（包括能源供给型行业、高耗能行业中单位能耗产出比具有竞争优势的企业和低耗能行业中单位能耗产出比具有竞争优势的企业的权重。在能源价格趋势向上时，提高能源生产行业、能源设备与服务行业的权重配置。当能源价格趋势向下时，加大高耗能行业中单位能耗产出比具有竞争优势的企业的权重配置。

同时本基金还将动态调整行业的配置权重，规避能源价格波动引起的风险。

①一级股票库构建

本基金主要由金融工程小组采用中海能源竞争优势多因子模型从能源供给型上市公司（包括能源生产行业和能源设备与服务行业）、低耗能行业上市公司以及在高耗能行业中单位能耗产出比具有竞争优势的上市公司中选取综合得分最高的300只左右的股票作为一级股票库。

②二级股票库构建

在一级股票库的基础上，由行业研究小组通过分析目标公司的资产分布、盈利结构以及财务状况等指标，综合考察公司的估值、成长性以及在竞争环境中的优势地位等因素精选个股，形成公司的二级股票库。

③三级股票库构建

在二级股票库的基础上，由基金经理选择估值合理、公司管理卓越、业务构架清晰、资产分布合理、财务安全、成长性突出且持续的个股，并由投资决策委员会开会审核通过而形成三级股票库。基金经理根据市场变化，自主选择三级股票库中的股票进行投资。

3、债券投资：债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，采取积极主动的投资策略。

①久期配置：债券组合的久期配置采用自上而下的方法。

1）通过数量分析，预测宏观经济周期趋势性变化，结合货币政策和财政政策，判断市场利率的变化趋势；

2）根据利率变化趋势，确定债券投资组合的久期配置和风险管理方案；

3）根据市场状况，采用有效的投资策略和交易策略构建组合，并通过数量模型优化。

②个券选择方法：个券的选择采用自下而上的方法，遵循如下原则：

1）相对价值原则：属性相近的债券，选择收益率较高的券种；在收益率相同的情况下，选择风险（久期）较低的券种。对二者都相近的券种，根据凸性，选择凸性较大的券种。

2）流动性原则：收益率、剩余期限、久期和凸性基本类似的券种，市场表现有时差别明显。在一般情况下，避免波动性过大的券种，选择流动性较好的券种。

对于信用品种，本基金建立内部信用评估体系，对信用类债券进行二次评级。只有通过评级，基金经理才能进行投资。

4、权证投资

本基金的权证投资将以保值为主要投资策略，以达到控制正股下跌风险、实现保值和锁定收益的目的。同时，发掘潜在的套利机会，以达到增值目的。

本基金持有的权证，可以是因上市公司派送而被动持有的权证，也可以是根据权证投资策略在二级市场上主动购入的权证。

**十、基金的投资决策依据和决策程序**

①投资决策依据

1）国家有关法律、法规和《基金合同》的有关规定；

2）宏观、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本基金投资决策的基础；

3）国家财政、货币政策、产业政策、区域规划与发展政策；

4）证券市场的发展水平和走势及基金业发展状况；

5）上市公司的行业发展状况、景气指数及竞争优势；

6）上市公司的持续盈利能力以及综合价值的评估；

②投资决策程序

1）投资决策支持：研究人员、基金经理及相关人员根据独立研究及各咨询机构的研究报告，向投资决策委员会提出宏观经济分析报告和投资策略报告等决策支持。

2）投资原则的制定：投资决策委员会在遵守国家有关法律、法规和《基金合同》的有关规定的前提下，根据研究人员和基金经理的有关报告，决定基金投资的主要原则，对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。

3）研究支持：研究分析人员根据投资决策委员会的决议，为基金经理提供各类分析报告和投资建议；也可根据基金经理的要求进行有关的研究。

4）制定投资决策：基金经理按照投资决策委员会决定的投资原则，根据研究分析人员提供的投资建议以及自己的分析判断，做出具体的投资决策。

5）风险管理与绩效评估：风险管理通过建立一系列完整的风险预警、风险识别以及风险控制体系，运用数量化和系统化的方法来识别、测度、监督和控制风险。风险控制委员会定期召开会议，听取投资管理部、基金经理、监察稽核人员对基金投资组合进行的风险评估，并提出风险控制意见。绩效评估通过业绩表现分析、归因分析、绩效检讨报告，对基金投资进行总结，协助基金经理提高投资业绩。

6）组合的调整：组合调整包括组合管理本身所进行的调整、根据风险控制与绩效评估报告的要求所进行的调整以及被动调整是基金应对申购、赎回进行的调整。基金经理可在其权限范围内对组合进行调整，超出其权限需报投资决策委员会审批。

**十一、基金的投资限制**

1、禁止行为

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，但法律法规或国务院证券监督管理机构另有规定的除外；

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主承销的证券；

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当时有效的法律法规、国务院证券监督管理机构及《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限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

①本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的10%；

②本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；

③投资于能源生产行业、低耗能行业、能源设备与服务行业、高耗能行业中单位能耗产出比具有竞争优势的企业的比例不低于股票资产的80%；

④本基金投资短期融资券的比例不超过基金资产净值的20%；

⑤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%；

⑥本基金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；

⑦本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%。基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%；

⑧基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

⑨相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制；

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

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。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

**十二、基金的业绩比较基准**

本基金的业绩基准为：沪深300指数涨跌幅×65%+上证国债指数涨跌幅×35%

本基金的股票资产占基金资产的30%-95%。正常情况下，本基金的股票仓位将保持在65%左右，债券仓位将保持在35%左右。因此，业绩基准中的资产配置比例基本可反映出本基金的风险收益特征。

本基金股票组合的业绩基准采用沪深300指数；本基金债券组合的业绩基准采用上证国债指数。沪深300指数于2005年4月正式发布，是反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”。沪深300指数的运行结果显示，该指数走势强于上证综合指数和深证综合指数。沪深300指数成份股为A股市场中市场代表性好、流动性高、交易活跃的主流股票，能够反映市场主流投资的收益情况。

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的股票指数时，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。

**十三、基金的风险收益特征**

本基金属混合型证券投资基金，为证券投资基金中的中高风险品种。

本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

**十四、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3月31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日报告期末的四季报数据。

（一）基金资产组合情况

截至2010年12月31日，中海能源策略混合型证券投资基金资产净值为7,072,600,542.81元，基金份额净值为0.9579元，累计基金份额净值为1.2679元。其资产组合情况如下：

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 6,395,062,863.55 | 90.16 |
| | 其中：股票 | 6,395,062,863.55 | 90.16 |
| 2 | 固定收益投资 | 339,194,116.00 | 4.78 |
| | 其中：债券 | 339,194,116.00 | 4.78 |
| | 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 | 350,169,891.02 | 4.94 |
| 6 | 其他各项资产 | 8,561,152.51 | 0.12 |
| 7 | 合计 | 7,092,988,023.08 | 100.00 |

（二）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 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 65,025,000.00 | 0.92 |
| B | 采掘业 | 1,587,874,412.44 | 22.45 |
| C | 制造业 | 2,388,434,897.55 | 33.77 |
| C0 | 食品、饮料 | 287,748,986.12 | 4.07 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 238,447,537.07 | 3.37 |
|