中海稳健收益债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2011年第2号)

本基金基金合同于2008年4月10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10月10日,有关财务数据和净值表现截止日为2011年9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

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

邮政编码:200120

设立日期:2004年3月18日

法定代表人:陈浩鸣

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

存续期间:持续经营

联系人:兰嵘

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。

胡旭鹏先生,董事。华东政法大学硕士。现任中海信托股份有限公司副总裁兼首席风险官。历任蚌埠市人民检察院助理检察员,上海浦东发展银行总行资产保全部法务专员,中海信托股份有限公司法务主管、风险管理部代经理、风险管理部经理、合规总监兼风险管理总部总经理、副总裁兼合规总监兼风险管理总部总经理、副总裁兼合规总监。

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

刘俊先生,复旦大学博士。历任上海申银万国证券研究所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。

5、历任基金经理

本基金基金合同于2008年4月10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
张顺太	2008年4月10日-2008年9月17日
张顺太 欧阳凯	2008年9月18日-2009年5月20日
欧阳凯	2009年5月21日-2010年3月2日
刘俊	2010年3月3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、基金经理。

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。

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349,018,545,827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

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

电话:021-68419518

传真:021-68419328

联系人:周颖

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号远洋大厦F211B单元

办公地址:北京市西城区复兴门内大街158号远洋大厦F211B单元

负责人:王红

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)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:010-66108013

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:021-58408483

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:邓炯鹏

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:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦20层

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:广东省深圳市深南东路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196号

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:96699(浙江省内)、962699(上海地区)、0577-96699(其他地区)

公司网址:www.wzbank.cn

(12)华夏银行股份有限公司

住所:北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人:吴建

联系人:黄滨

电话:010-85237046

客户服务电话:95577

公司网站:www.hxb.com.cn

(13)上海农村商业银行股份有限公司

住所:上海市浦东新区浦东大道981号

办公地址:上海市银城中路8号中融碧玉蓝天大厦15层

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

(14)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

(15)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

(16)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

(17)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:010-66568430

传真:010-66568536

联系人:田薇

客户服务电话:4008-888-888

公司网址:www.chinastock.com.cn

(18)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、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

(19)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

(20)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:95523或4008895523

公司网址:www.sywg.com

(21)广发证券股份有限公司

住所:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼

法定代表人:林治海

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

(22)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

(23)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:021-38565783

联系人:谢高得

客户服务电话:400-8888-123

公司网址:www.xyzq.com.cn

(24)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

(25)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:潘鑫军

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

(26)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

(27)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

(28)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.cn

(29)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

(30)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

(31)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

(32)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

(33)西南证券股份有限公司

住所:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦8楼

法定代表人:王珠林

联系人:陈诚

电话:023-63786464

传真:023-63786311

客户服务电话:400-8096-096

公司网址:www.swsc.com.cn

(34)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

(35)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

(36)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:400-689-8888

公司网址:www.hlzqgs.com

(37)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

(38)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

(39)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

(40)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

(41)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

(42)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

(43)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

(44)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

(45)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

(46)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:高冠江

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

(47)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

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:陈忠

公司网址:www.cs.ecitic.com

(48)方正证券股份有限公司

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

(49)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: 潘锴、王京京

电话:0431-85096709、0431-85096530

客户服务电话:4006000686

公司网址:www.nesc.cn

(50)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

(51)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:徐勇力

联系人:汤漫川

电话:010-66555316

传真:010-66555246

客户服务电话:400-8888-993

公司网址:www.dxzq.net.cn

(52)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:010-66045608、010-66045521

传真:010-66045500

联系人:林爽、陈琳琳

客户服务电话:010-66045678

公司网址: www.txsec.com

(53)华宝证券有限责任公司

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦27层

法定代表人:陈林

联系人:宋歌

电话:021-50122086

传真:021-50122398

客服电话:400-820-9898、021-38929908

网址:www.cnhbstock.com

(54)厦门证券有限公司

住所:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

法定代表人:傅毅辉

联系人:卢金文

客户服务电话:0592-5163588

公司网站:www.xmzq.cn

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)出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

中海稳健收益债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

在充分重视本金长期安全的前提下,力争为基金份额持有人创造较高的稳定收益。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以通过参与新股、可转债、可分离转债首发的投资方式来获取一级市场申购收益,提高基金收益水平。

本基金投资组合的资产配置:债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)80%-100%,股票、权证类资产不超过20%,权证资产占基金净值的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。本基金80%以上的基金资产投资于债券类金融工具。

八、基金的投资理念

本基金的投资理念是基于宏观经济周期趋势性变化,进行自上而下的主动性投资。在规避风险的前提下,为投资者提供较高的稳定收益。

九、基金的投资策略

1、一级资产配置

一级资产配置主要采取自上而下的方式。比较固定收益品种与一级市场申购预期收益率,确定进行一级市场申购的资产比例,进行大类资产配置。

本基金在进行新股申购时,将结合金融工程数量化模型,使用中海基金估值模型等方法评估股票的内在价值,充分借鉴合作券商等外部资源的研究成果,对于拟发行上市新股(或增发新股)等权益类资产价值进行深入发掘,评估新股(或增发新股)等权益类资产一、二级市场价差。同时分析新股(或增发新股)等权益类资产融资规模、市场申购资金规模等条件,评估申购中签率水平,从而综合评估申购收益率,确定申购资金在不同品种之间、网上与网下之间的资金分配,对申购资金进行积极管理,制定相应申购和择时卖出策略以获取较好投资收益。

一般情况下,本基金对获配新股将在上市首日起择机卖出。但若上市初价格低于合理估值,则等待价格上升至合理价位时卖出,但持有时间最长不超过可交易之日起的90个交易日。此外,为保证股票资产比例不超过20%,本基金在存在锁定期的交易品种所形成的股票资产合计达到基金净值的10%时,将不再申购存在锁定期的交易品种。当通过发行市场申购、可转债转股所形成的股票资产合计达到基金净值的18%时,将不再申购新股。

2、久期配置/期限结构配置

(1)久期配置:基于宏观经济趋势性变化,自上而下的资产配置。

利用中海宏观经济分析模型,确定宏观经济的周期变化,主要是中长期的变化趋势,由此确定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。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析,根据一定的收益率模型为各种固定收益投资品种进行风险评估,最终确定投资组合的久期配置。

(2)期限结构配置:基于数量化模型,自上而下的资产配置。

在确定组合久期后,通过研究收益率曲线形态,采用收益率曲线分析模型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。通过AAM模型选择预期收益率最高的期限段进行配比组合,从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。

3、债券类别配置:主要依据信用利差分析,自上而下的资产配置。

本基金根据国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、可分离可转债、资产支持证券之间的相对价值,以其历史价格关系的数量分析为依据,同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析,综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、可分离可转债、资产支持证券等信用债券,在信用利差水平较低时持有国债,从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。

本基金对于投资品种信用等级的投资限制如下:国债、央行票据、政策性金融债无限制;企业债券、公司债券等信用债券投资范围限制为AA以上(含AA)的投资品种,信用评级低于AA的信用债券不得投资。(本基金信用评级体系参见附录四)

4、做市策略:基于各个投资品种具体情况,自下而上的交易策略。

为增加投资者利益和改善交易所债券市场的流动性,本基金将根据自身持仓的公司债券的具体情况,对一些公司债券的交易采取做市策略。

为适应中国固定收益市场快速发展的环境,提高固定收益市场流动性,上海证券交易所建设了"固定收益电子信息平台",引入一级交易商做市机制。提高证券交易的效率和市场流动性,为国债等固定收益产品提供了高效、低成本的批发交易平台。

本基金将在上海证券交易所固定收益综合电子平台上选择公司债券进行双边报价。国内外各金融市场做市交易策略的实证研究表明,做市交易策略可获得稳定的收益回报。

因此,本基金对于部分公司债券采取做市策略交易,一方面可以实现一定利润;另一方面可以增加公司债券的流动性。

5、其它交易策略

(1)短期资金运用:在短期资金运用上,如果逆回购利率较高,选择逆回购融出资金。

(2)公司债跨市场套利:

公司债将在银行间市场和交易所市场同时挂牌,根据以往的经验,两个市场的品种将出现差价套利交易的机会。随着交易所固定收益综合电子平台的推出,交易所债券市场流动性日益增强,这使得跨市场套利策略成为可能。本基金将利用两市场相同公司债券交易价格的差异,锁定其中的无风险收益进行跨市场套利,增加持有人收益。

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)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)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%。

(4)本基金不得在二级市场买入权证。在一级市场申购可分离转债所持有的权证只能单向卖出,不得买入。基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。

法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定。

(5)现金和到期日不超过1年的政府债券不低于5%。

(6)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%。

(7)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%。

(8)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)本基金财产参与股票发行申购,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。

(10)本基金80%以上的基金资产投资于债券类金融工具。

(11)因通过发行市场申购、可转债转股所形成的股票资产合计低于基金净值的20%。

(12)本基金不得在二级市场买入股票。

(13)本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定。

(14)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如关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。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。其中因交易品种存在锁定期的原因,当通过发行市场申购、可转债转股所形成的股票资产合计超过基金净值的20%,基金管理人将在相关交易品种锁定期满后10个交易日内调整,以达到标准。法律法规、监管部门另有规定的从其规定。

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基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券。

(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、操纵证券交易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、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,履行适当程序后,本基金投资可不受上述规定限制。

十一、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中国债券总指数收益率×100%。中国债券总指数由中央国债登记结算中心于2003年1月1日编制发布,样本涵盖交易所、银行间市场记帐式国债(固定、浮动利率)、金融债。中央国债登记结算有限公司将中国债券总指数情况于中国债券信息网(www.chinabond.com.cn)上公开发布。

本基金选择中国债券总指数作为业绩比较基准的原因如下:

第一,从投资范围看,本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括国内依法公开发行和上市的国债、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债等债券。而中国债券总指数是目前涵盖范围最广的公开指数,涵盖了中国债券市场整体价格和投资回报情况;且指数样本是采集市场上真正在交易品种当前的公开报价,有利于基金管理人以此总指数为基准进行投资组合的配置。迄今为之,这一指数已经为包括社保基金和许多债券基金在内的很多机构所采用,而且使用范围正不断扩大。

第二,从发布主体看,中央国债登记结算公司是全国债券市场内提供国债、金融债、企业债和其他固定收益证券的登记、托管、交易结算等服务的国有独资金融机构,是财政部唯一授权主持建立、运营全国国债托管系统的机构,是中国人民银行指定的全国银行间债券市场债券登记、托管、结算机构和商业银行柜台记账式国债交易的一级托管人。因此从发布主体上保证中国债券总指数比较客观和专业。

第三,从编制规则看,中债总指数在样本券选择上使用合理的双边报价、合理和结算价、跨公司债券价格处理等价格源,且具有财富、全价、净价三组总值,指数按待偿期分段提供了12个指标值为一组的多组指标值。因此中债总指数的编制规则较为全面科学。

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。

十二、基金的风险收益特征

本基金属债券型证券投资基金,为证券投资基金中的较低风险品种。

本基金长期平均的风险和预期收益低于混合型基金,高于货币市场基金。

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11月7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2011年9月30日报告期末的第三季度报告数据,其中所列财务数据未经审计。

(一)基金资产组合情况

截至2011年9月30日,中海稳健收益债券型证券投资基金资产净值为299,428,178.75元,基金份额净值为0.975元,累计基金份额净值为1.210元。其资产组合情况如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,687,223.66	7.55
	其中:股票	22,687,223.66	7.55
2	固定收益投资	250,854,544.70	83.43
	其中:债券	250,854,544.70	83.43
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	13,000,000.00	4.32
	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	9,905,150.04	3.29
6	其他各项资产	4,217,118.46	1.40
7	合计	300,664,036.86	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	13,444,435.28	4.49
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	10,193,684.94	3.40
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	3,250,750.34	1.09
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	1,629,305.58	0.54
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	7,613,482.80	2.54
I	金融、保险业	-	-
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	22,687,223.66	7.58

(三)股票投资的前十名股票明细

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	601566	九牧王	370,000	8,924,400.00	2.98
2	601010	文峰股份	411,985	7,613,482.80	2.54
3	601633	长城汽车	257,179	3,204,450.34	1.07
4	601599	鹿港科技	113,127	1,269,284.94	0.42
5	601669	中国水电	146,000	657,000.00	0.22
6	601886	江河幕墙	25,836	500,701.68	0.17
7	601789	宁波建工	62,630	471,603.90	0.16
8	601222	林洋电子	2,000	28,020.00	0.01
9	002614	蒙发利	500	18,280.00	0.01
10	-	-	-	-	-

(四)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	19,320,000.00	6.45
3	金融债券	39,714,000.00	13.26
	其中:政策性金融债	39,714,000.00	13.26
4	企业债券	128,419,167.80	42.89
5	企业短期融资券	10,064,000.00	3.36
6	可转债	53,337,376.90	17.81
7	其他	-	-
8	合计	250,854,544.70	83.78

(五)债券投资的前五名债券明细

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	110003	新钢转债	205,590	20,441,813.70	6.83
2	110311	11进出11	200,000	20,030,000.00	6.69
3	100312	10进出12	200,000	19,684,000.00	6.57
4	1101022	11央票22	200,000	19,320,000.00	6.45
5	122953	09岳城建	194,750	19,085,500.00	6.37

(六)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2011年9月30日,本基金的其他资产项目构成如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	125,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,070,788.21
5	应收申购款	21,330.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,217,118.46

(4)截至2011年9月30日,本基金持有处于转股期的可转债明细

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	110003	新钢转债	20,441,813.70	6.83
2	113001	中行转债	17,484,638.40	5.84
3	125731	美丰转债	7,319,391.88	2.44
4	125709	唐钢转债	5,163,297.92	1.72
5	110015	石化转债	2,928,235.00	0.98

(5)截至2011年9月30日,本基金未持有权证投资。

(6)截至2011年9月30日,本基金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	601633	长城汽车	3,204,450.34	1.07	网下申购新股锁定
2	601669	中国水电	657,000.00	0.22	网上申购新股锁定
3	601886	江河幕墙	500,701.68	0.17	网下申购新股锁定
4	601789	宁波建工	471,603.90	0.16	网下申购新股锁定

十四、基金的业绩

本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。基金业绩数据截至2011年9月30日。

基金本期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
2008.04.10-2008.12.31	11.79%	0.18%	11.28%	0.23%	0.51%	-0.05%
2009.01.01-2009.12.31	6.56%	0.24%	-1.24%	0.10%	7.80%	0.14%
2010.01.01-2010.12.31	8.54%	0.21%	1.92%	0.10%	6.62%	0.11%
2011.01.01-2011.06.30	-2.65%	0.23%	1.03%	0.08%	-3.68%	0.15%
2011.07.01-2011.09.30	-3.47%	0.29%	0.59%	0.12%	-4.06%	0.17%
自基金合同生效起至今	21.51%	0.22%	13.82%	0.14%	7.69%	0.08%

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和律师费。

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、基金的销售服务费。

9、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。

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)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)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0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.6%÷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2‰的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×2‰÷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、基金的销售服务费

本基金的销售服务费年费率为0.35%,本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日基金资产净值的0.35%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.35%÷当年天数

H为基金每日应计提的销售服务费

E为前一日基金资产净值

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基金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3-9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。

(四)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。

(五)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、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,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和基金管理人网站上公告并报中国证监会备案。

(六)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"及"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)在"相关服务机构",对"销售机构"部分进行了更新。

(四)在"基金份额的申购和赎回",对"申购与赎回的数额限制"及"定期定额投资计划"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"基金业绩"按最新资料进行了更新。

(七)在"基金份额持有人服务"部分,对"网上交易服务"、"信息定制服务"及"投资者投诉受理服务"进行了更新。

(八)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○一一年十一月二十二日