# 中海量化策略股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2014年第1号）

本基金基金合同于2009年6月24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2013年12月24日, 有关财务数据和净值表现截止日为2013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

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:黄鹏
总经理:黄鹏
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(中外合资)
注册资本:1.466667亿元
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。

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兼资产管理部总经理。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。

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、董事兼营运总监(亚太区,日本除外)、董事总经理兼营运总监(亚太区,日本除外)、董事总经理兼新加坡执行长,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,会计师。现任中海信托股份有限公司总稽核兼纪委副书记、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、稽核审计部经理。

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、综合管理部总经理、风险管理部总经理兼风控总监。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。

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)。

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月至今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。

朱冰峰先生,督察长。华东政法学院国际经济法专业学士。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

俞忠华先生,简历同上。

周其源先生, 上海交通大学管理科学与工程专业博士。历任杭州恒生电子集团业务员,Lombard Risk Management Ltd. Co. (Lombard风险管理有限责任公司)金融工程师,太平洋资产管理有限责任公司高级研究员、高级投资经理。2012年5月进入本公司工作, 现任金融工程副总监。2013年3月至今任中海可转换债券债券型证券投资基金基金经理,2013年10月至今任中海量化策略股票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2009年6月24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 |
|---|---|
| YAN GANG LI(李延刚) | 2009年6月24日-2012年2月3日 |
| 笪菲 | 2012年2月4日-2013年2月7日 |
| 俞忠华 | 2013年2月8日-2013年10月23日 |
| 俞忠华、周其源 | 2013年10月24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

(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

经营范围:办理人民币存款、贷款、同业拆借业务;国内外结算;办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务;代理资金清算;提供信用证服务及担保;代理销售业务;代理发行、代理承销、代理兑付政府债券;代收代付业务;代理证券投资基金清算业务(银证转账);保险代理业务;代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务;保管箱服务;发行金融债券;买卖政府债券、金融债券;证券投资基金、企业年金托管业务;企业年金受托管理服务;年金账户管理服务;开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务;资信调查、咨询、见证业务;贷款承诺;企业、个人财务顾问服务;组织或参加银团贷款;外汇存款;外汇贷款;外币兑换;出口托收及进口代收;外汇票据承兑和贴现;外汇借款;外汇担保;发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券;自营、代客外汇买卖;外汇金融衍生业务;银行卡业务;电话银行、网上银行、手机银行业务;办理结汇、售汇业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

### 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: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)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:010-66107738
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:蒋超良
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:田国立
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: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

(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:王洪章
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:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:常振明
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:010-58560666
传真:010-57092611
联系人:杨成茜
客户服务电话:95568
公司网址:www.cmbc.com.cn

(9)平安银行股份有限公司
住所:深圳市深南东路5047号
办公地址: 广东省深圳市深南东路5047号
法定代表人:孙建一
联系电话: 021-38637673
传真电话: 021-50979507
联系人:张莉
客户服务电话:95511-3
公司网址: www.bank.pingan.com

(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—61616611
传真:021-63604199
联系人:朱萍
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:郑鹏
电话:010-85238667
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

(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:无锡市太湖新城金融一街8号
法定代表人:雷建辉
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

(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:陈有安
电话: 010-66568430
传真:010-66568990
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

(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: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

(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、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
电话:020-87555888
传真:020-87555305
联系人:黄岚
客户服务电话:95575或致电各地营业网点
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:021-38565955
联系人:谢高得
客户服务电话: 95562
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: 025-83290979
传真: 025-84579763
联系人:万鸣
客户服务电话:95597
公司网址:www.htsc.com.cn

(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)中信证券(浙江)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:0571-87112510
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

(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

(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)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

(32)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

(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:袁长清(代行)
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

(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:0931-8784656、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

(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)第一创业证券股份有限公司
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)中国中投证券有限责任公司
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-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话?0755-82023442
传真?0755-82026539?
客服电话?400?600?8008
公司网址?www.china-invs.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: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

(47)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

(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: 安岩岩
电话:0431-85096517
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:魏庆华
联系人:汤漫川
电话:010-66555316
传真:010-66555246
客户服务电话:400-888-8993
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
传真:010-66045549
联系人:林爽
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

(53)华宝证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
法定代表人:陈林
联系人:宋歌
电话:021-68778010
传真:021-68778117
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:赵钦
客户服务电话:0592-5163588
公司网站:www.xmzq.cn

(55)中信万通证券有限责任公司
住所: 青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人:张智河
联系人:吴忠超
联系电话:0532-85022326
客服电话:95548
公司网址:www.zxwt.com.cn

(56)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:周嬿旻
联系电话:0571-28829790
客服电话:4000-766-123
公司网址:www.fund123.cn

(57)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

(58)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

(59)?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

(60)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:licaike.hexun.com

(61)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

(62)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

(63)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

(64)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

(65)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

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: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: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、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(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
经办注册会计师:沈岩、华可天四、基金的名称

中海量化策略股票型证券投资基金

### 五、基金的类型

股票型证券投资基金

### 六、基金的投资目标

根据量化模型,精选个股,积极配置权重,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:股票资产的比例为基金资产的60%—95%,债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 为基金资产的0%—40%,权证投资的比例为基金资产净值的0%—3%,本基金保持的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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。

### 八、基金的投资理念

以量化模型作为资产配置与构建投资组合的基础,以理性的积极投资管理获取长期的稳健收益。

### 九、基金的投资策略

本基金在对经济周期、财政政策、货币政策和通货膨胀等宏观经济因素进行前瞻性充分研究的基础上,通过比较股票资产与债券资产预期收益率的高低进行大类资产配置,动态调整基金资产在股票、债券和现金之间的配置比例。同时,本基金运用现代金融工程技术,对各类宏观经济指标与股票市场的领先滞后关系与相关性进行分析,筛选出一组针对股票市场的宏观经济领先指标。此外,本基金将采用我公司的市场泡沫度模型(SMBMM,Stock Market Bubble Measure Model)定期计算股票市场的泡沫度,以度量市场情绪状况。这些宏观经济领先指标和市场泡沫度模型将用于辅助大类资产配置。

1、股票投资

本基金产品的特色在于采用自下而上的选股策略,施行一级股票库初选、二级股票库精选以及投资组合行业权重配置的全程数量化。

首先,选取代表性最强的反映公司盈利能力的指标,主要包括过去三年平均EPS、ROE、毛利率三项指标,对所有A股上市公司进行筛选从而得到一级股票库。

其次,在一级股票库初选的基础之上,本基金选取相应的盈利性指标、估值指标以及一致预期指标,基于熵值法确定各个指标权重,对一级库股票进行打分排名,从而筛选出二级股票库。其中,盈利性指标包括过去三年平均毛利率、EPS及ROE;估值指标包括PE、PB、PS、PCF及PEG等指标;一致预期指标包括EG、RC、RA及EY等指标。

在选股指标权重的确定上,以往对于选股指标权重的确定主要采用主观评定法或是简单等权法。“熵值法”动态赋权的特点在于可根据市场情况的变化而动态量化赋权,即若所有股票的某项选股指标差异度高,则该指标的权重就会相对较高;相反,若所有股票的某项指标差异度低,则该指标的权重就会相对较低。

最后,在行业权重配置方面,我们采用Black-Litterman模型(以下简称BL模型),结合市场均衡状态和一致预期数据计算出最优行业配置权重。结合BL模型给出的行业配置权重,我们确定股票组合每只股票的配置比例。

2、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,投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、可分离可转债产品,在获取较高利息收入的同时兼顾资本利得,谋取超额收益。

本基金债券投资组合资产配置采用自上而下的方法,个券选择采用自下而上的方法,具体债券资产配置、个券选择及投资流程如下:

(1)债券资产配置方法:自上而下。

1)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。

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和风险管理方案。

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,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)依据信用利差分析,对债券类别进行自上而下资产配置

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。

(2)个券选择方法:自下而上。

通过数量分析,在剩余期限、久期、到期收益率基本接近的同类债券之间,确定最优个券。个券选择基于相对价值和流动性进行。

普通债券上,本基金认为普通债券,包括国债、金融债、企业债和公司债的估值,主要基于收益率曲线的拟合。在正确拟合收益率曲线的基础上,及时发现偏离市场收益率的债券,并帮助找出因投资者偏好、资金供求、流动性、信用利差等导致债券价格偏离的原因:同时,基于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段,从而指导相对价值投资,选择投资于定价低估的债券品种。

企业债券类证券(包括企业债、公司债、可分离债的债券部分)是获得较高投资收益不可忽视的一部分,也是本基金在力争在低风险下获取较高收益时将采取的主要投资策略。本基金结合对宏观经济态势的判断与企业的盈利性、成长性评估债券的信用风险,本基金将在该风险评估基础上,依据对企业所处行业的研究以及企业自身发展与偿还能力的分析选择选择符合目标久期和资产配置需要的企业债券类证券以期获得高于基准的收益。

可转债品种上,本基金还将凭借多年的可转债投资研究力量积累进行可转债品种投资,着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究,重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债进行投资。

(3)债券投资流程

具体流程上,本基金债券投资组合管理分为三个主要阶段:投资规划、投资实施、投资反馈调整阶段。按照以下步骤进行:

第一阶段:投资规划

1)分析研究

研究发展部、固定收益部根据宏观经济数据,并跟踪中国人民银行及各部委的各项政策,研究各种政策的力度和影响,分析判断宏观经济变化趋势,确定市场利率变化方向,定期或不定期地出具债券市场研究报告。

2)投资计划

在上述研究的基础上,由基金经理结合市场情况,拟定投资计划,供投资决策委员会讨论。

3)资产配置策略

投资决策委员会定期召开会议,依据研究发展部、固定收益部、基金经理的研究分析报告,确定债券组合的久期等配置。

第二阶段:投资实施

4)投资组合构建

基金经理根据投资决策委员会的资产配置策略,结合债券研究报告,确定券种的具体选择,并负责日常的维护和调整。

5)投资决策交易执行

交易部依据基金经理的指令,制定交易策略,统一执行交易计划。在各种交易平台完成交易,并将交易结果反馈基金经理。

第三阶段:投资反馈调整

6)投资组合动态调整

基金经理负责对投资组合进行动态调整。金融工程研究小组分析当前收益率曲线的形态,以及各市场之间的差异,发掘其中可能的套利机会,供基金经理参考,适时调整组合。

3、资产支持证券投资

本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下,深入分析影响资产支持证券定价的多种因素,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等,秉持稳健投资原则,综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资,以期获得基金资产的长期稳健回报。基于稳健投资规避信用风险,本基金只投资于信用评级为AAA的资产支持证券品种。

4、权证投资

本基金在证监会允许的范围内适度投资权证。在权证投资中, 本基金将对权证标的证券的基本面进行研究, 利用Black-Scholes-Merton模型、二叉树模型及其它权证定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值,权证投资策略主要从价值投资的角度出发,采用如下策略进行权证投资:

(1)套利投资策略

在权证和标的股票之间出现套利机会时,对权证进行套利投资。

(2)风险锁定策略

根据认沽权证和标的股票之间的价差,在投资标的股票的时候,同时投资认沽权证,锁定投资风险。

(3)股票替代策略

在价值投资的基础上,根据权证的溢价率和隐含波动率等指标,寻找溢价率低(甚至折价)的权证,利用权证替代股票,以期降低风险或提高潜在收益。

由于权证市场的高波动性,本基金在投资权证时还需要重点考察权证的流动性风险,寻找流动性与基金投资规模相匹配的、成交活跃的权证进行适量配置。

(4)杠杆投资策略

对以根据量化模型所选品种为标的股票的权证进行模型定价研究,利用权证的杠杆效应,以期获得超额收益。

### 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%,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%。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基金资产净值的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%,中国证监会规定的特殊品种除外。本基金持有资产支持证券期间,如果其信用登记下降、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。

(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%。

(10)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。

(11)一只基金持有一家公司发行的流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的百分之二;一只基金持有的所有流通受限证券,其市值不得超过该基金资产净值的百分之十;经基金管理人和托管人协商,可对以上比例进行调整。

(12)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。

(13)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、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:沪深300指数涨跌幅×80%+中国债券总指数涨跌幅×20%。

本基金的股票资产占基金资产的60%-95%。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中国债券总指数。

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。

中国债券总指数由中央债券登记结算中心于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(www.chinabond.com.cn)上公开发布。

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

本基金属股票型证券投资基金,为证券投资基金中的较高风险品种。

本基金长期平均的风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、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2014年1月17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2013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。

1、 基金资产组合情况

截至2013年9月30日,中海量化策略股票型证券投资基金资产净值为202,140,339.32元,基金份额净值为0.943元,累计基金份额净值为0.980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 | 189,778,001.09 | 88.95 |
| | 其中:股票 | 189,778,001.09 | 88.95 |
| 2 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中:债券 | – | – |
| | 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 | 22,890,744.52 | 10.73 |
| 6 | 其他资产 | 676,723.90 | 0.32 |
| 7 | 合计 | 213,345,469.51 | 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 | 2,052,600.00 | 1.02 |
| C | 制造业 | 98,045,681.16 | 48.50 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | – | – |
| E | 建筑业 | 2,032,209.20 | 1.01 |
| F | 批发和零售业 | 12,741,262.11 | 6.30 |
| 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 | 15,438,055.20 | 7.64 |
| J | 金融业 | – | – |
| K | 房地产业 | 11,109,125.65 | 5.50 |
| L | 租赁和商务服务业 | 11,700,676.00 | 5.79 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 6,976,617.57 | 3.45 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,418,872.00 | 2.19 |
| 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 | 25,262,902.20 | 12.50 |
| S | 综合 | – | – |
| | 合计 | 189,778,001.09 | 93.88 |

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 | 000731 | 四川美丰 | 1,088,451 | 10,285,861.95 | 5.09 |
| 2 | 300336 | 新文化 | 154,300 | 9,612,890.00 | 4.76 |
| 3 | 600637 | 百视通 | 168,100 | 8,800,035.00 | 4.35 |
| 4 | 300058 | 蓝色光标 | 117,700 | 7,885,900.00 | 3.90 |
| 5 | 000963 | 华东医药 | 174,906 | 7,678,373.40 | 3.80 |
| 6 | 600887 | 伊利股份 | 167,050 | 7,463,794.00 | 3.69 |
| 7 | 600557 | 康缘药业 | 252,179 | 7,351,017.85 | 3.64 |
| 8 | 600880 | 博瑞传播 | 244,900 | 7,151,080.00 | 3.54 |
| 9 | 002236 | 大华股份 | 144,346 | 6,579,290.68 | 3.25 |
| 10 | 600085 | 同仁堂 | 277,987 | 6,146,292.57 | 3.04 |

4、 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(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。

(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。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(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。

(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。

10、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2013年9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 | 659,294.95 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 5,770.92 |
| 5 | 应收申购款 | 11,658.03 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 676,723.90 |

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

(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

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2013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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2009.06.24-2009.12.31 | 4.10% | 1.81% | 13.08% | 1.68% | -8.98% | 0.13% |
| 2010.01.01-2010.12.31 | 6.38% | 1.34% | -9.35% | 1.27% | 15.73% | 0.07% |
| 2011.01.01-2011.12.31 | -20.27% | 1.19% | -19.41% | 1.04% | -0.86% | 0.15% |
| 2012.01.01-2012.12.31 | 7.27% | 1.19% | 6.87% | 1.02% | 0.40% | 0.17% |
| 2013.01.01-2013.06.30 | -6.23% | 1.41% | -9.79% | 1.20% | 3.56% | 0.21% |
| 2013.07.01-2013.09.30 | 9.91% | 1.11% | 7.22% | 1.15% | 2.69% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.38% | 1.34% | -14.61% | 1.21% | 12.23% | 0.13% |

### 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、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。

本基金合同终止、基金财产清算时所发生费用,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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E\times 1.5\%\div$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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E\times 0.25\%\div$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。

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。

(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、基金托管费率或基金销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,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日前依照《信息披露办法》的有关规定在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“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“基金份额的申购与赎回”部分,对“申购与赎回的数额限制”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”按最新资料进行了更新。
(七)对“对基金份额持有人的服务” 部分进行了更新。
(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**
**二〇一四年二月七日**