中海增强收益债券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 2011 年 3 月 23 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(更新)所载内容截止日为 2014 年 3 月 23 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2013 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

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:兰峰

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、无锡分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,中国海洋石油东海分司计财部会计、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,华宜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。历任中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 月至今任本公司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。

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

江小震先生,复旦大学金融学专业硕士。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、天安人寿保险股份有限公司(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,曾任固定收益小组负责人,现任固定收益部副总监。2010 年 7 月至 2012 年 10 月任中海货币市场证券投资基金基金经理,2011 年 3 月至今任中海增强收益债券型证券投资基金基金经理,2013 年 1 月至今任中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金基金经理,2014 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。

5、历任基金经理

本基金基金合同于 2011 年 3 月 23 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	2011年3月23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:娄建清

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: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:邹童

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:娄建清

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:杨成西

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

(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:李芸、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:丙敏银

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

(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.cn

(27)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

(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)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

(30)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

(31)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

(32)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: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

(33)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

(34)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

(35)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

(36)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

(37)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

(38)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

(39)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

(40)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

(41)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

(42)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

(43)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

(44)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:北京市朝阳区兆马桥路 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

(45)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

(46)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

(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

(48)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

(49)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

(50)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

(51)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:周婧旻

联系电话:0571-28829790

客服电话:4000-766-123

公司网址:www.fund123.cn

(52)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

(53)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

(54)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 号乐码头园区 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

(55)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:王荀

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

(56)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

(57)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

(58)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

(59)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

(60)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

(61)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:陈肇

联系电话:010-57756019

客服电话:400-786-8868-5

公司网址:www.chfund.com

(62)深圳市前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

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:周琳

(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

联系人:吕红

经办律师:秦悦民、王利民

(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:无锡市梁溪区 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

中海增强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稳定收益。

七、基金的投资范围

本基金的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债券、股票、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。

本基金固定收益类资产主要投资于国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等品种。

本基金固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%,权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%,持有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。投资比例将遵从法律法规或监管机构的规定。

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,确定利率变动的方向和趋势,据此合理安排资产组合的配置结构,在控制投资风险的前提下获取超过债券市场平均收益水平的投资业绩。此外,本基金还将通过积极的新股申购和个股精选等来增强基金资产的收益。

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。

本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策分析判断,采取自上而下的分析方法,比较不同证券子市场和金融工具的收益及风险特征,动态调定基金资产在固定收益类资产和权益类资产的配置比例。

2、债券投资策略(可转债除外)

(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。

利用宏观经济分析模型,判断宏观经济的周期变化,主要是中长期的变化趋势,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。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析,根据收益率模型为各种固定收益类金融工具进行风险评估,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。通过优化资产配置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。

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)债券类别配置:个券选择: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。

个券选择:基于各个投资品种具体情况,自下而上的资产配置。

个券选择应遵循如下原则:

相对价值原则:同等风险中收益率较高的品种,同等收益率风险较低的品种。

流动性原则:其它条件类似,选择流动性较好的品种。

(4)其它交易策略

a、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。

b、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。本基金将利用两个市场相同公司债券交易价格的差异,锁定其中的收益进行跨市场套利,增加基金资产收益。

3、可转换债券投资策略

可转换债券兼具债券和股票的相关特性,其投资风险和收益介于债券和股票之间。在进行可转换债券筛选时,本基金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以确定投资的可转换债券品种。

4、股票投资策略

(1)新股申购投资策略

本基金作为固定收益类产品,将充分依靠公司研究平台和股票估值体系、深入研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面,在有效控制风险的前提下制定相应的新股申购策略。对通过新股申购获得的股票,将根据其实际的投资价值确定持有或卖出。

(2)股票二级市场投资策略

本基金可适当参与股票二级市场投资,增强基金资产收益。本基金股票二级市场投资采用红利精选投资策略,通过运用分红模型和分红潜力模型,精选出现金股息率高、分红潜力强并具有成长性的优质上市公司,结合投研团队的综合判断,构造股票投资组合。

5、权证投资策略

本基金在证监会允许的范围内适度投资权证,权证投资策略主要从价值投资的角度出发,将权证作为套利和锁定风险的工具,采用包括套利投资策略、风险锁定策略和股票替代策略进行权证投资。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。

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,不超过该证券的百分之十;

(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%;本