中海增强收益债券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2011年9月23日，有关财务数据和净值表现截止日为2011年6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

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（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。

成亦先生，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《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，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、基金经理。2010年7月至今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。

5、历任基金经理

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

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中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：鲁雁宪

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

㉚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：马晓明

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

联系人：盛宗凌、周晓芸

客户服务电话：95513

公司网址：www.lhzq.com

㉛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

㉜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

㉝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

㉞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

㉟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

㊱济鲁证券有限公司

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

㊲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

㊳万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

㊴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

㊵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

㊶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

㊷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

㊸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

㊹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

㊺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

㊻东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路138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

㊼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

㊽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

㊾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

㊿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：021-68419328

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

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

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，动态确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（不转债除外）

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%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

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%；本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十；

⑤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%；

⑥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%；

⑦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，不得超过该基金资产净值的10%；

⑧本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、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；

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本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资比例和投资策略的约定；

⑪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。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。

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。

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将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将基金管理人、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，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：

中国债券总指数收益率×90%+上证红利指数收益率×10%。

中国债券总指数由中央国债登记结算有限责任公司于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（附定、浮动利率）、金融债。上证红利指数于2005年1月4日发布，挑选在上证所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的50只股票作为样本，以反映上海证券市场高红利股票的整体状况和走势。

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%。因此，"中国债券总指数收益率×90%+上证红利指数收益率×10%"是衡量本基金投资业绩的理想基准。

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，经基金管理人与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股票型基金和混合型基金，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10月14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6月30日报告期末的二季报数据。

1、基金资产组合情况

截至2011年6月30日，中海增强收益债券型证券投资基金A类资产净值为144,424,533.64元，基金份额净值为1.003元，累计基金份额净值为1.003元；C类资产净值为133,012,468.14元，基金份额净值为1.001元，累计基金份额净值为1.001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	3,688,353.64	1.32
	其中：股票	3,688,353.64	1.32
2	固定收益投资	200,248,563.30	71.72
	其中：债券	200,248,563.30	71.72
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,195.00	17.91
	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	23,055,005.58	8.26
6	其他各项资产	2,210,692.18	0.79
7	合计	279,202,809.70	100.00

2、期末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	714,400.00	0.26
C0	食品、饮料	714,400.00	0.26
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
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	-	-
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	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	474,953.64	0.17
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	2,499,000.00	0.90
	合计	3,688,353.64	1.33

3、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

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	600881	亚泰集团	300,000	2,499,000.00	0.90
2	000858	五粮液	20,000	714,400.00	0.26
3	000061	农产品	29,759	474,953.64	0.17

4、期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）