

**中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要**  
**(2010年第2号)**

本基金基金合同于2008年12月3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2010年6月3日，有关财务数据和净值表现截止日为2010年3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

邮政编码：200120

成立日期：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：中国证监会证监基金字[2004]24 号文件

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿叁仟万元人民币

存续期间：持续经营

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

储晓明先生，董事长。香港大学硕士。现任中海信托股份有限公司总裁。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。

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。

陈浩鸣先生，董事，总经理。中央财经大学硕士，高级经济师。现任中海基金管理有限公司总经理。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。

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。历任国联证券股份有限公司交易员、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，国联证券股份有限公司总裁助理兼证券投资部总经理。2004年3月至2008年12月先后任本公司投资总监（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。

温天先生，董事。香港大学硕士、ASO凯瑞商学院硕士。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。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。

## 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资产托管部经理。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。首都经济贸易大学硕士。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，历任北京管理总部副总经理、北京分公司总经理。2009年1月至今担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

陈浩鸣先生，总经理。简历同上。

方培池先生，副总经理。北京大学国际MBA。历任北京第二机床厂财务处主任科员、轻工业部外事司财务处处长、中美轻工业合作基金管理公司首席财务专家、深圳海王集团有限公司总会计师、深圳海王生物有限责任公司副总经理、湘财证券有限责任公司市场总监并兼任监事。2005年3月进入本公司工作，曾任总经理助理兼北京管理总部总经理。2008年1月至今任本公司副总经理。

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，曾先后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。2009年6月至今兼任中海量化策略股票型证券投资基金基金经理。

宋宇先生，督察长。复旦大学学士，经济师。历任国联证券股份有限公司营业部副总经理、办公室主任、研究发展部总经理。2004年3月至今任本公司督察长。

### 4、基金经理

许定晴女士，苏州大学金融学硕士，曾任国联证券股份有限公司研究员。2004年3月进入本公司工作，历任分析师、高级分析师、基金经理助理。2010年3月至今任中海蓝筹灵活配置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2008年12月3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
--------	---------

杨大力	2008年12月3日-2010年3月2日
许定晴	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。简历同上。

陈浩鸣先生，委员。简历同上。

朱劲松先生，委员。武汉大学经济学学士。历任中国保利集团金融部业务主管、君安证券（香港）有限公司业务主管、中煤信托投资有限责任公司证券总部交易部负责人、中海石油财务有限责任公司投资部经理，2008年3月进入本公司工作，任总经理助理，2009年1月至今任总经理助理兼风险管理部总经理、风控总监。

陶林健先生，委员。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、无锡筑路机械厂管理部经理、中企东方资产管理有限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，任分析师兼基金经理助理。现任投资副总监、中海分红增利混合型证券投资基金基金经理、中海能源策略混合型证券投资基金基金经理。

杨济如女士，委员。华东师范大学经济学硕士、哥伦比亚大学公共管理硕士，11年证券从业经历。曾任国泰君安证券股份有限公司投资银行部高级经理、资产管理部基金经理、上海乐丰投资管理有限公司投资经理。2008年4月进入本公司工作，曾任分析师、基金经理助理。2009年6月至今任中海优质成长证券投资基金基金经理。

陈明星先生，委员。中国科学技术大学经济学硕士，曾任平安资产管理有限公司运营管理部分析师。2007年10月进入本公司工作，任金融工程分析师、基金经理助理，现任金融工程总监兼中海上证50指数增强型证券投资基金基金经理。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人概况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

法定代表人：项俊波

成立时间：2009 年 1 月 15 日

注册资本：2600 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-68424199

联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保

留意见的 SAS70 审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004 年 9 月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

### 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

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

客户服务电话：95599

公司网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

(2) 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](http://www.bankcomm.com)

(3) 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

电话：010-66105799

传真：010-66105798

联系人：蒋松云

客户服务电话：95588

公司网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(4) 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：010-66275654

联系人：王琳

客户服务电话：95533

公司网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(5) 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：秦晓

传真：0755-83195049

联系人：王楠

客户服务电话：95555

公司网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(6) 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](http://bank.ecitic.com)

(7) 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：010-58351666

传真：010-83914283

联系人：董云巍、吴海鹏

客户服务电话：95568

公司网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(8) 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

法定代表人：法兰克.纽曼（Frank N.Newman）

联系电话： 0755-82088888

传真电话： 0755-82080714

联系人：周勤

客户服务电话：95501

公司网址：[www.sdb.com.cn](http://www.sdb.com.cn)

（9）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：汤嘉惠、虞谷云

客户服务电话：95528

公司网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

（10）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](http://www.wzbank.cn)

（11）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：400-888-5288、0510-82588168

公司网址：[www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

（12）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：4008—888—999

公司网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

（13）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：021-53831169

传真：021-53858549

联系人：李笑鸣

客户服务电话：95553

公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

（14）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：胡长生

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](http://www.chinastock.com.cn)

（15）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

电话：010-65178899

传真：010-65182261

联系人：权唐

客户服务电话：400-888-8108

公司网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（16）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

法定代表人：祝幼一

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺

客户服务电话：400-888-8666

公司网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

（17）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](http://www.sw2000.com.cn)

（18）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](http://www.gf.com.cn)

（19）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](http://www.xcsc.com)

（20）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](http://www.xyzq.com.cn)

（21）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](http://www.htsc.com.cn)

（22）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](http://www.dfzq.com.cn)

（23）东吴证券有限责任公司

住所：江苏省苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦

办公地址：江苏省苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦

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](http://www.dwzq.com.cn)

(24) 中信金通证券有限责任公司

住所: 浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

办公地址: 浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人: 刘军

电话: 0571-85783715

传真: 0571-85783771

联系人: 俞会亮

客户服务电话:0571-96598

公司网址: [www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

(25) 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: 金春

客户服务电话: 4008-888-228

公司网址: [www.jyzq.com.cn](http://www.jyzq.com.cn)

(26) 东海证券有限责任公司

住所: 江苏省常州市延陵西路 59 号投资广场 18 楼

办公地址: 上海市浦东区东方路 989 号中达广场 17 楼

法定代表人: 朱科敏

电话: 021-50586660-8966

传真: 021-50819897

联系人: 李涛

客户服务电话: 400-888-8588

公司网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(27) 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](http://www.newone.com.cn)

(28) 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.bocichina.com](http://www.bocichina.com)

(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：周璐

客户服务电话：400-881-6168

公司网址：[www.pingan.com](http://www.pingan.com)



(30) 华泰联合证券有限责任公司

住所：深圳罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

办公地址：深圳罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

法定代表人：马昭明

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

联系人：盛宗凌

客户服务电话：4008-888-555，95513

公司网址：[www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

(31) 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：米兵

客户服务电话：400-8096-096

公司网址：[www.swsc.com.cn](http://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](http://www.essence.com.cn)

(33) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 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](http://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：甘肃省兰州市静宁路 308 号

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](http://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 16 层至 26 层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

联系人：齐晓燕

客户服务电话：95536

公司网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

（36）齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

联系人：吴阳

客户服务电话：95538

公司网址：[www.qlzq.com.cn](http://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：魏颖

电话：0755-25832852

客户服务电话：0755-25832583

公司网址：[www.firstcapital.com.cn](http://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：李舫金

电话：020—37865070

传真：020—22373718-1011

联系人：罗创斌

客户服务电话：400—8888—133

公司网址：[www.wlzq.com.cn](http://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：汤世生

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

（40）中国建银投资证券有限责任公司

住所：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心 48-50 层

法定代表人：杨小阳

电话：0755-82026511

传真：075582026539

联系人：杨瑞芳

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一大街 29 号

办公地址：天津市河西区宾水道 3 号

法定代表人：张志军

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](http://www.gjzq.com.cn)

(44) 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](http://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

法定代表人：王东明

联系电话：010-84588888

传真：010-84865560

联系人：陈忠

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(46) 方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

客户服务电话：95571

公司网址：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

(47) 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：潘锴  
电话：0431-85096709  
客户服务电话：4006000686  
公司网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(48) 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](http://www.gfhfzq.com.cn)

(49) 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](http://www.dxzq.net)

(50) 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：010-66045529  
传真：010-66045500

联系人：莫晓丽

客户服务电话：010-66045678

公司网址：[www.txsec.com](http://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：陈浩鸣

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、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(原江苏公证会计师事务所)

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:夏正曙、钱云霞



#### 四、基金的名称

中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

#### 五、基金的类型

混合型证券投资基金

#### 六、基金的投资目标

通过研究股票市场和债券市场的估值水平和价格波动，调整股票、固定收益资产的投资比例，优先投资于沪深 300 指数的成份股和备选成份股中权重较大、基本面较好、流动性较高、价值相对低估的上市公司以及收益率相对较高的固定收益类品种，适当配置部分具备核心优势和高成长性的中小企业，兼顾资本利得和当期利息收益，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：股票资产占基金资产的 30%—80%，债券资产占基金资产的 20%—70%，权证资产占基金资产净值的 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。

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

基于中国经济周期的景气研判，采取动态的资产配置，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，进行主动的投资组合管理。

#### 九、基金的投资策略

## 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) 上市公司的行业发展状况、景气指数及竞争优势。

(5) 上市公司的持续盈利能力以及综合价值的评估。

## 2、投资决策流程：

(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情况下，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应对申购、赎回进行的被动调

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。

### 3、资产配置

#### (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)动态调整一级资产的权重配置，确定股票和固定收益品种仓位。投资决策委员会作为公司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) “核心—卫星”配置/久期配置：

“核心-卫星”配置：本基金股票投资部分采取核心-卫星投资策略(Core-Satellite Strategy)，在控制股票投资组合相对于市场系统风险的基础上，获取超越市场平均水平的收益。根据国际惯例，结合中国实际情况，本基金将蓝筹股定义为沪深300指数的成份股和备选成份股中权重较大、基本面较好、流动性较高的上市公司。核心组合投资蓝筹股的比例为股票资产净值的80%—100%；卫星组合则投资于具备核心优势和高成长性的中小企业，以超额收益为投资导向，投资比例为股票资产净值的0%—20%。

“核心-卫星”的具体配置比例采用自下而上和自上而下相结合的方法确定。

- a) 自下而上的方法：根据寻找到的具有长期高速增长投资标的的数量确定，数量多时，提高卫星组合的配置比例；数量少时，降低卫星组合的配置比例。
- b) 自上而下的方法：根据市场股权风险溢价水平(ERP)的变化确定：当市场股权溢价水平比较高时，市场偏好稳健型品种，此时降低卫星组合的配置；当市场股权溢价水平比较低时，市场偏好高增长、高收益、高风险品种，此时提高卫星组合的配置。

债券资产久期配置：根据经济周期，采用自上而下的方法确定组合久期。

- a) 通过数量模型分析，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。

- b) 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，在利率上升时降低久期，在利率下降时加大久期。

(3) 个股选择和个券选择：

- a) 个股选择：核心组合利用“中海综合估值模型”，在沪深 300 指数的成份股和备选成份股的范围内，精选出其中价值相对被低估的优质上市公司；卫星组合采用主动性投资策略，自下而上、精选个股，针对具备核心优势和高成长性的中小企业，结合流通市值、成交金额、波动性等多项指标进行综合筛选，积极投资。
- b) 个券选择：采用自下而上的方法。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。个券选择遵循以下原则：

➤ 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，选择凸性大的券种。

➤ 流动性原则

收益率、剩余期限、久期和凸性基本类似的券种，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。

### 5、组合调整：

分为主动调整和被动调整。主动调整包括组合管理本身所进行的调整，以及根据风险控制与绩效评估报告的要求所进行的调整。被动调整是基金应对申购、赎回进行的调整。

### 6、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。

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。

## 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）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%。

（2）本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%。

（3）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%。

（4）本基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金

的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

(5) 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。

(6) 本基金投资股权分置改革中产生的权证，在任何交易日买入的总金额，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%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定。

(7) 本基金投资资产支持证券的，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%；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%；基金管理人管理的全部证券投资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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%。

(8) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。

(9) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述(1)-(3)项以及(5)-(8)项规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

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

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，但是国务院另有规定的除外。

(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) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

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

本基金的业绩比较基准为：

沪深 300 指数×60%+中债国债指数×40%

本基金的股票资产占基金资产的比例为 30%-80%，债券资产占基金资产的比例为 20%-70%。本基金的股票仓位和债券仓位长期来看应大体保持在 60%与 40%左右。因此，业绩比较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。

鉴于本基金股票投资中的核心组合将以沪深 300 指数的成份股和备选成份股为标的，因此本基金股票组合的业绩比较基准采用沪深 300 指数；另外由于投资规模和流动性的因素，目前基金的债券组合主要集中在银行间债券市场，因此本基金债券组合的业绩比较基准采用中债国债指数。

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。

如果沪深 300 指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有

更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，基金管理人有权对此基准进行调整并及时公告。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并在履行适当的程序后予以公告。

## 十二、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较高风险品种。

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。

## 十三、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本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。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，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截至 2010 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1、基金资产组合情况

截至 2010 年 3 月 31 日，中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金资产净值为 292,019,166.02 元，基金份额净值为 1.0631 元，累计基金份额净值为 1.3231 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	205,134,832.93	69.84
	其中：股票	205,134,832.93	69.84
2	固定收益投资	63,534,555.20	21.63
	其中：债券	63,534,555.20	21.63
	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	20,779,224.36	7.08
6	其他资产	4,270,633.25	1.45
7	合计	293,739,245.74	100.00

## 2、报告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	5,694,252.00	1.95
B	采掘业	9,405,357.60	3.22
C	制造业	82,048,264.03	28.10
C0	食品、饮料	7,225,959.36	2.47
C1	纺织、服装、皮毛	1,682,136.00	0.58
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,747,538.10	0.60
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,649,424.06	2.96
C5	电子	3,437,002.80	1.18
C6	金属、非金属	5,999,630.76	2.05
C7	机械、设备、仪表	42,657,562.27	14.61
C8	医药、生物制品	9,095,255.68	3.11
C99	其他制造业	1,553,755.00	0.53
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,995,416.56	1.71
F	交通运输、仓储业	5,245,757.24	1.80
G	信息技术业	37,646,392.28	12.89
H	批发和零售贸易	12,967,446.92	4.44

I	金融、保险业	34,522,259.31	11.82
J	房地产业	3,934,308.10	1.35
K	社会服务业	1,635,206.55	0.56
L	传播与文化产业	1,534,032.00	0.53
M	综合类	5,506,140.34	1.89
	合计	205,134,832.93	70.25

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

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	000063	中兴通讯	226,169	9,612,182.50	3.29
2	600570	恒生电子	309,835	7,219,155.50	2.47
3	600202	哈空调	338,185	7,091,739.45	2.43
4	601601	中国太保	262,530	7,088,310.00	2.43
5	600036	招商银行	364,478	5,933,701.84	2.03
6	000858	五粮液	203,221	5,724,735.57	1.96
7	000860	顺鑫农业	325,200	5,694,252.00	1.95
8	002142	宁波银行	273,415	4,374,640.00	1.50
9	600631	百联股份	239,590	4,355,746.20	1.49
10	600016	民生银行	543,631	4,180,522.39	1.43

4、报告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（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	49,170,000.00	16.84
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	10,043,469.00	3.44
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	4,321,086.20	1.48
7	其他	-	-
8	合计	63,534,555.20	21.76

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

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	0901044	09央行票据44	500,000	49,170,000.00	16.84
2	122033	09富力债	68,220	7,190,388.00	2.46
3	126012	08上港债	28,980	2,853,081.00	0.98
4	125709	唐钢转债	25,240	2,805,930.80	0.96
5	110003	新钢转债	12,970	1,515,155.40	0.52

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、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除宜宾五粮液股份有限公司被监管部门立案调查外,其他发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。宜宾五粮液股份有限公司董事会于2009年9月9日发布《宜宾五粮液股份有限公司第四届董事会公告》,称公司接到中国证监会调查通知书。本基金投资五粮液的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。本基金管理人的投研团

队对五粮液受调查事件进行了及时分析和跟踪研究,认为该事件对该公司投资价值未产生实质性影响。

(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) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	3,606,767.52
3	应收股利	-
4	应收利息	658,236.22
5	应收申购款	5,629.51
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,270,633.25

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	125709	唐钢转债	2,805,930.80	0.96
2	110003	新钢转债	1,515,155.40	0.52

(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。

#### 十四、基金的业绩

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。

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较(截至2010年3月31日):

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
过去 1 个月	1.93%	0.85%	1.35%	0.74%	0.58%	0.11%
过去三个月	-1.71%	1.07%	-2.98%	0.80%	1.27%	0.27%
自基金合同生 效起至今	32.47%	1.14%	45.59%	1.19%	-13.12%	-0.05%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

## 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、基金合同生效后的信息披露费用。
- 4、基金份额持有人大会费用。
- 5、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费。
- 6、基金的证券交易费用。
- 7、基金财产拨划支付的银行费用。
- 8、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

（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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年管理费率为 } 1.5\%$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.25%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、上述(一)中3到7项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### (四)不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

### (六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 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”和“主要人员情况”进行了更新。

（二）在“基金托管人”部分，对“基金托管人情况”进行了更新。

（三）对“相关服务机构”部分进行了更新。

（四）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。

（五）对“基金的业绩”按最新资料进行了更新。

（六）在“对基金份额持有人的服务”部分，对“网上交易服务”和“定期定额投资计划”部分进行了更新。

（七）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

二〇一〇年七月十六日