
中海货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要
(2014年第2号)

本基金基金合同于2010年7月28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2014年7月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2014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

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。

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、总裁助理兼资产管理部总经理、副总裁兼资产管理部总经理。

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、董事总经理兼营运总监（亚太区，日本除外）、董事总经理兼法国兴业资产管理新加坡执行长，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，高级会计师。现任中海信托股份有限公司纪委副书记、总稽核兼合规总监、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。

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区副执行总监。

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、总经理助理、综合管理部总经理。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、风险管理部总经理兼风控总监。

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），2014年5月至今兼任本公司代理督察长。

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。

4、基金经理

冯小波先生,上海交通大学管理科学与工程专业硕士。历任华泰保险股份有限公司交易员,平安证券股份有限公司投资经理,兴业银行股份有限公司债券交易员、高级副理。2012年8月进入本公司工作,任职于投研中心。2012年10月至今任中海货币市场证券投资基金基金经理,2014年4月至今任中海纯债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2010年7月28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	2010年7月28日-2012年10月25日
冯小波	2012年10月26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

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 1 号楼 F218

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 158 号 1 号楼 F218

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：李建红

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

(8) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路 12 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：021-61616193

传真：021-63604196

联系人：高天、杨文川

客户服务电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

(9) 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

(10) 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

(11) 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

(12) 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

(13) 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

（14）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

（15）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

（16）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

（17）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

（18）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

（19）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

（20）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

（21）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

（22）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

（23）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

（24）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

（25）中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

办公地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 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

（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）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

（30）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

（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：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 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

(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：0931-8784656、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

(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）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

（37）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

（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

（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：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

（45）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

（46）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

（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

（48）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

（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：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

（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

（51）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

（52）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

（53）中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

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 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

客服电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

（54）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：周嫻旻

联系电话：0571-28829790

客服电话：4000-766-123

公司网址: www.fund123.cn

(55) 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

(56) 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

(57) 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

(58) 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：licaikexun.com

（59）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

（60）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

（61）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

（62）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

（63）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

（64）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：陈攀

联系电话：010-57756019

客服电话：400-786-8868-5

公司网址： www.chtfund.com

（65）深圳市新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

（66）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

联系人：胡璇

联系电话：0571-88911818

客服电话：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

（67）中国国际期货有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、11 层、12 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、11 层、12 层

法定代表人：王兵

联系人：孟夏

联系电话：010-59539861

客服电话：95162、400-8888-160

公司网址：www.cifco.net

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

经办律师：吕红、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

中海货币市场证券投资基金

五、基金的类型

货币市场证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金投资目标是在保证资产安全与资产充分流动性前提下,追求高于业绩比较基准的收益率,为基金份额持有人创造稳定的当期收益。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为:

- (1) 现金;
- (2) 通知存款;
- (3) 短期融资券;
- (4) 一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;
- (5) 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券;
- (6) 期限在一年以内(含一年)的债券回购;
- (7) 期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;
- (8) 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券;
- (9) 中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具,基金管理人可在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天。投资过程按照平衡组合流动性和最大化投资收益的原则对品种的投资比例进行动态调整。

八、基金的投资理念

团队缜密研究、量化系统精确测算，运用现金流管理策略构建短期金融工具投资组合和套利操作，以便在保证基金财产的安全性和流动性的基础上，获得稳定的当期收益。

九、基金的投资策略

1、利率预期策略

根据对宏观经济和利率走势的分析，本基金将制定利率预期策略。如果预期利率下降，将增加组合的久期；反之，如果预期利率将上升，则缩短组合的久期。

2、期限结构配置策略

各类债券资产在期限结构上的配置是本基金所选择的收益率曲线策略在资产配置过程中的具体体现。其做法是，根据对收益率曲线形状的变化预期，采用总收益分析法在下述的三种基础类型中进行选择：

- ☐ 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、类属配置策略

在保持组合资产相对稳定的条件下，根据各类短期金融工具（国债、金融债、央行票据、回购等）的市场规模、收益性和流动性，决定各类资产的配置比例；再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

4、流动性管理策略

在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下，通过基金资产安排（包括

现金库存、资产变现、剩余期限管理或以其他措施），在保持基金资产高流动性的前提下，确保基金的稳定收益。

5、套利策略

本基金的套利策略主要分为正回购与银行同业存款之间的套利策略、正回购与逆回购之间的套利策略、跨市场套利策略以及跨期限套利策略四大类：

正回购与银行同业存款之间的套利

所谓正回购与银行同业存款之间的套利，指的是以低于金融同业存款利率的价格融入资金后，再以金融同业存款利率存放银行，从而获得收益。

正回购与逆回购之间的套利

□ 同一市场异日正回购与逆回购之间的套利

所谓同一市场异日正回购与逆回购之间的套利，指的是在同一市场第T天以低于金融同业存款利率的成本融入资金，而在T天后选定的交易日以高于金融同业存款利率的价格融出资金，从而获取收益。

□ 同日正回购与逆回购之间的套利

所谓同日正回购与逆回购之间的套利，指的是第T天以低于金融同业存款利率的成本融入资金，同时在该天以高于金融同业存款利率的价格在同一品种上融出资金，从而获取收益。

跨市场套利

所谓跨市场套利指的是在利率低的市场融入资金同时在利率高的市场融出去，从而获取收益；

□ 跨市场异日正回购与逆回购之间的套利

所谓跨市场异日正回购与逆回购之间的套利，指的是第T天在一个市场以较低的成本融入资金，而在T天后选定的交易日在另一个市场以高于成本的价格融出资金，从而获取收益。

□ 回购与债券之间的套利

所谓在回购与债券之间的套利是指在利率低的市场融入资金，投资在收益率较高的债券（含央行票据）市场上，从而获取收益。

跨期限套利

跨期限套利是指在满足货币基金投资平均剩余期限的条件下，当较短期回购利率低于较长期回购利率时，进行较短期滚动正回购操作和较长期逆回购操作而实现跨期限套利；或当较短期回购利率高于较长期回购利率时，进行较长期正回购操作和较短期滚动逆回购操作而实现跨期限套利。

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）本基金不得投资于以下金融工具：

- 1) 股票；
- 2) 可转换债券；
- 3) 剩余期限超过397 天的债券；
- 4) 信用等级在AAA 级以下的企业债券；
- 5) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但市场条件发生变化后另有规定的，从其规定；
- 6) 非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券；
- 7) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

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。

（2）本基金的投资组合将遵循以下比例限制：

- 1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120 天；
- 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，不得超过该证券发行总规模的10%；
- 3) 本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的30%；
- 4) 本基金持有的剩余期限不超过397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%；

本基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动债券；

- 5) 本基金买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过397 天；
- 6) 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款, 不得超过基

金资产净值的30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的5%；

7) 本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的10%；

8) 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%；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，不得超过基金资产净值的10%；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) 除发生巨额赎回的情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%；因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的，基金管理人应当在5个交易日内进行调整；

10) 在全国银行间债券市场债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的百分之四十。在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

11) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：

A、国内信用评级机构评定的A-1级或相当于A-1级的短期信用级别；

B、根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级应具备下列条件之一：

A) 国内信用评级机构评定的AAA级或相当于AAA级的长期信用级别；

B) 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。

同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。本基金持有的短期融资券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起20个交易日内对其予以全部减持；

12) 中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。

除上述第（9）条和（11）外，因基金规模或市场变化导致本基金投资组

合不符合以上比例限制的，基金管理人应在10 个交易日内进行调整，以达到上述标准。法律法规另有规定时，从其规定。

（3）本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的AAA 级或相当于AAA级的信用级别。

本基金持有的资产支持证券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起3 个月内对其予以全部卖出。

（4）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。

若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，基金管理人履行适当程序后，本基金可相应调整投资限制规定。法律法规或中国证监会取消该等限制的，基金管理人履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

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其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；

（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）本基金不得与基金管理人的股东进行交易，不得通过交易上的安排人为降低投资组合的平均剩余期限的真实天数；

（9）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。

如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：同期 7 天通知存款利率（税后）

通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期 7 天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

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，经基金管理人和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

本基金属货币市场证券投资基金，为证券投资基金中的低风险品种。

本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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 8 月 19 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 2014 年 06 月 30 日报告期末的第二季

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

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	960,241,420.71	47.44
	其中：债券	960,241,420.71	47.44
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	351,001,046.50	17.34
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	606,256,813.60	29.95
4	其他资产	106,542,441.90	5.26
5	合计	2,024,041,722.71	100.00

2、 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	3.02	
	其中：买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	218,199,442.20	12.09
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

3、 基金投资组合平均剩余期限

3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
----	----

报告期末投资组合平均剩余期限	108
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	128
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	68

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2014 年 4 月 10 日	121	正回购到期	1
2	2014 年 5 月 27 日	123	正回购到期	5
3	2014 年 5 月 28 日	122	正回购到期	4
4	2014 年 5 月 29 日	128	正回购到期	3
5	2014 年 5 月 30 日	124	正回购到期	2
6	2014 年 6 月 3 日	120	正回购到期	1

注：报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 180 天的情况。

根据本基金基金合同规定，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，下同。

3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	37.48	12.09
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	5.49	-
2	30 天(含)-60 天	13.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	9.98	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	16.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.64	-
5	180 天(含)-397 天(含)	28.89	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

合计	106.26	12.09
----	--------	-------

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	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	158,576,608.12	8.79
	其中：政策性金融债	158,576,608.12	8.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	801,664,812.59	44.43
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	960,241,420.71	53.21
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	128,620,604.67	7.13

5、 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	041458021	14 山钢 CP001	1,000,000	100,323,241.21	5.56
2	130306	13 进出 06	1,000,000	99,049,546.61	5.49
3	041460027	14 湘高速 CP001	800,000	80,259,609.66	4.45
4	041464005	14 郑煤 CP001	700,000	70,437,961.43	3.90
5	011480002	14 尧矿 SCP002	700,000	70,067,880.26	3.88
6	041364040	13 澄星 CP003	700,000	70,000,054.26	3.88
7	011415001	14 中铝业 SCP001	500,000	50,230,155.72	2.78
8	041459017	14 云工投 CP001	500,000	50,219,262.45	2.78
9	041452019	14 西王	500,000	50,057,402.95	2.77

		CP003			
10	041455011	14 苏交通 CP003	500,000	50,003,959.88	2.77

6、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	27
报告期内偏离度的最高值	0.3347%
报告期内偏离度的最低值	0.1234%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2410%

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十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8、投资组合报告附注

8.1 本基金估值采用摊余成本法估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提收益。

8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，未发生该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

8.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	18,760,863.15
4	应收申购款	87,781,578.75

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	106,542,441.90

8.5 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

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。

基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较（截止日期2014年6月30日）：

1、A级基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
2010.07.28- 2010.12.31	0.7081%	0.0026%	0.5888%	0.0000%	0.1193%	0.0026%
2011.01.01- 2011.12.31	3.8521%	0.0075%	1.4713%	0.0001%	2.3808%	0.0074%
2012.01.01- 2012.12.31	3.8537%	0.0074%	1.4083%	0.0002%	2.4454%	0.0072%
2013.01.01- 2013.12.31	3.8570%	0.0059%	1.3224%	0.0000%	2.5346%	0.0059%
2014.01.01- 2014.06.30	2.5141%	0.0087%	0.6472%	0.0000%	1.8669%	0.0087%
自基金合同 生效起至今	15.6435%	0.0073%	5.5537%	0.0002%	10.0898%	0.0071%

2、B级基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
2010.07.28— 2010.12.31	0.8134%	0.0026%	0.5888%	0.0000%	0.2246%	0.0026%
2011.01.01— 2011.12.31	4.1012%	0.0075%	1.4713%	0.0001%	2.6299%	0.0074%
2012.01.01— 2012.12.31	4.1035%	0.0074%	1.4083%	0.0002%	2.6952%	0.0072%
2013.01.01— 2013.12.31	4.1074%	0.0059%	1.3224%	0.0000%	2.7850%	0.0059%
2014.01.01— 2014.06.30	2.6362%	0.0087%	0.6472%	0.0000%	1.9890%	0.0087%
自基金合同 生效起至今	16.7405%	0.0073%	5.5537%	0.0002%	11.1869%	0.0071%

注：本基金合同生效日为2010年7月28日，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、基金销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费。
- 6、基金份额持有人大会费用。
- 7、基金的证券交易费用。
- 8、基金的银行汇划费用。
- 9、按照法律法规有关规定和《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）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 0.33% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，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 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，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、基金销售服务费

本基金 A 级基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，B 级基金份额的销售服务费年费率为 0.01%。各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为每日该级基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该级基金份额的基金资产净值

R 为该级基金份额的年销售服务费率

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划付基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第 4—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。

（三）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。

（四）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人费率、基金托管费率、基金销售服务费等相关费率。

调高基金管理人费率、基金托管费率或基金销售服务等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理人费率、基金托管费率或基金销售服务等费率，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上公告。

（五）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”部分按最新资料进行了更新。
- （六）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

二〇一四年九月十日