（上接B074版）

额，并在保本周期到期日后二十个工作日内将该差额支付给惠利B份额持有人。基金托管人对于保本赔付差额的计算及支付不承担复核义务。

本基金第一个保本周期后各保本周期到期日，如惠利B份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的惠利B份额的可赎回金额低于其过渡期申购保本金额、或从上一保本周期转入当期保本周期的惠利B份额的保本金额，则基金管理人或保本义务人应补足该差额。

惠利B份额持有人在保本周期内申购，或在当期保本周期到期日前赎回或转换转出的惠利B份额或者发生《基金合同》约定的其他不适用保本条款情形的，相应基金份额不适用本条款。

认购保本金额为惠利B份额持有人认购并持有到期的惠利B份额的投资金额，即惠利B份额持有人认购并持有到期的惠利B份额净认购金额、认购费用及募集期间的利息收入之和。

过渡期申购保本金额为惠利B份额持有人过渡期申购并持有到期的惠利B份额的投资金额，即惠利B份额持有人在过渡期内进行申购并持有到期的惠利B份额在过渡期截止日所代表的资产净值及过渡期申购费用之和。

从上一保本周期转入当期保本周期的惠利B份额的保本金额为惠利B份额持有人从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的惠利B份额的投资金额，即惠利B份额持有人将其上一保本周期持有到期的惠利B份额转入当期保本周期并持有到期的，其惠利B份额在过渡期截止日所代表的资产净值。

对于基金份额持有人多次认购或申购、赎回的情况，以后进先出的原则确定持有到期的基金份额。

若本基金惠利B份额不符合保本基金存续条件的，则惠利B份额不再设置保本保障机制。

（二）保本周期

本基金惠利B份额的保本周期每2年为一个周期，保本周期与分级运作周期为同一期间。基金管理人将在保本周期到期前公告的到期处理规则中确定下一个保本周期起始日。基金合同中若无特别所指，保本周期即为惠利B份额的当期保本周期。

本基金第一个保本周期后的各保本周期自基金管理人公告的保本周期起始日起至2个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日或该公历年不存在对应日的，则保本周期到期日为该日前的最后一个工作日。基金管理人将在保本周期到期前公告的到期处理规则中确定下一个保本周期的起始时间。

（三）保本案例

若某投资者投资10,000 元认购本基金惠利B份额 （该认购申请被全额确认）并持有到保本周期到期，认购费率为0.6%。假定募集期间产生的利息为3元，则：

净认购金额＝10,000/（1＋0.6%）＝9,940.36元

认购费用＝10,000－9,940.36＝59.64元

认购份额＝（9,940.36＋3）/1.00＝9,943.36份

1、若保本周期到期日，惠利B份额净值为0.90元。

认购保本金额＝9,940.36＋59.64＋3＝10,003.00元

可赎回金额＝0.90×9,943.36＝8,949.02元

即：可赎回金额＜认购保本金额

保本赔付差额=10,003.00－8,949.02=1053.98元

若保本周期到期日该投资者赎回惠利B份额，则基金管理人将按照认购保本金额向该投资者支付10,003.00元。

2、若保本周期到期日，惠利B份额资产净值为1.20元。

认购保本金额＝9,940.36＋59.64＋3＝10,003.00元

可赎回金额＝1.20×9,943.36＝11,932.03元

即：可赎回金额＞认购保本金额

若保本周期到期日该投资者赎回惠利B份额，则基金管理人将按照可赎回金额向该投资者支付11,932.03元。

（四）适用保本条款的基金份额

1、对于本基金第一个保本周期而言，惠利B份额持有人认购并持有到期的惠利B份额。

2、对于本基金第一个保本周期后的保本周期而言，惠利B份额持有人在本基金过渡期内申购并持有到期的惠利B份额、惠利B份额持有人从本基金上一个保本周期结束后选择或默认选择转入当期保本周期并持有到期的惠利B份额。

（五）不适用保本条款的情形

1、在保本周期到期日，按惠利B份额持有人认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的惠利B份额与到期日惠利B份额净值的乘积不低于其认购保本金额、或过渡期申购保本金额、或从上一保本周期转入当期保本周期的惠利B份额的保本金额；

2、惠利B份额持有人认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期，但在基金当期保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换转出的惠利B份额；

3、惠利B份额持有人在保本周期内申购或转换转入本基金的惠利B份额；

4、在惠利B份额保本周期内发生《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形；

5、在惠利B份额保本周期到期日之后（不包括该日），基金份额发生的任何形式的净值减少；

6、因不可抗力的原因导致基金投资亏损，或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》规定的其他情形基金管理人或保本义务人免于履行保本义务的；

7、若惠利B份额持有人从本基金上一个保本周期结束后选择或默认选择转入当期保本周期的基金份额所代表的资产净值总额超过保证人提供的当期保本周期担保额度或保本义务人提供的当期保本周期保本额度的，基金管理人按照约定确认的可享受保本条款的基金份额之外的其他部分基金份额。

8、未经保证人书面同意而修改《基金合同》条款，可能加重保证人保证责任的，但根据法律法规要求进行的修改除外。

9、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人不同意继续承担保证责任。

八、基金的投资目标

在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

九、基金的投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、地方政府债、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类金融工具以及经法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等，也不参与一级市场的新股申购或增发新股，但可持有因所持可转换债券转股形成的股票、因投资于可分离交易可转债等金融工具而产生的权证。因上述原因持有的股票，本基金应在其可交易之日起的6个月内卖出；因上述原因持有的权证，本基金应在其可交易之日起的1个月内卖出。

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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

十、基金的投资策略

1、固定收益品种的配置策略

（1）久期配置

本基金基于对宏观经济指标和宏观经济政策的分析，判断宏观经济所处的经济周期，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；同时结合债券市场资金供求分析，最终确定投资组合的久期配置。

（2）期限结构配置

在确定组合久期后，通过研究收益率曲线形态，采用统计和数量分析技术，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收益进行分析，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

在宏观分析和久期及期限结构配置的基础上，本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、市场流动性、市场风险等因素进行分析，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾其基本面分析，综合分析各品种的利差和变化趋势。在信用利差水平较高时持有公司债（企业债）、中小企业私募债、资产支持证券等信用品种，在信用利差水平较低时持有国债、央行票据等利率品种，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。

2、个券的投资策略（可转换债券除外）

个券的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。

（1）利率品种的投资策略

本基金对国债、央行票据等利率品种的投资，是在久期配置策略与期限结构配置策略基础上，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，通过采取利差套利策略、相对价值策略等决定投资品种。

（2）信用品种的投资策略（中小企业私募债除外）

本基金对企业债、公司债和资产支持证券等信用品种采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本基金在久期配置策略与期限结构配置策略基础上，运用数量化分析方法对信用品种的信用风险、流动性风险、市场风险等因素进行分析，对利差走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本基金运用行业和公司基本面研究方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。

本基金将借助公司内部的行业及公司研究员的专业研究能力，并综合参考外部研究机构的研究成果，对发债主体企业进行深入的基本面分析，主要包括经营历史、行业地位、竞争实力、公司治理、股东或地方政府的实力以及支持力度等；并结合债券的发行条款，综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上以确定信用品种的实际信用风险状况及其信用利差水平，投资于信用风险相对较低、信用利差收益相对较大的优质品种。

（3）中小企业私募债投资策略

本基金对中小企业私募债的投资策略主要基于信用品种投资略，在此基础上重点分析私募债的信用风险及流动性风险。首先，确定经济周期所处阶段，研究私募债发行人所处行业在经济周期和政策变动中所受的影响，以确定行业总体信用风险的变动情况，并投资具有积极因素的行业，规避具有潜在风险的行业；其次，对私募债发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力综合分析；最后，结合私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素，综合评价私募债的信用风险和流动性风险，选择风险与收益相匹配的品种进行配置。

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、其它交易策略

（1）杠杆放大策略：即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。

（2）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。

十一、基金的投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%；

（2）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；

（3）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%；

（4）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10%；

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的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%；

（9）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%；

（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%；

（11）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；

（12）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%；

（13）本基金持有的全部中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的20%；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%；

（14）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

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基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（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）向其基金管理人、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者债券；

（6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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。

十二、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数。

本基金为债券型基金，主要投资于固定收益类金融工具，强调基金资产的稳定增值，为此，本基金选取中证全债指数作为本基金的业绩比较基准。中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。

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指数时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十三、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

本基金《基金合同》生效后的分级运作周期内，本基金经过基金份额分级后，惠利A份额为较低预期风险、收益相对稳定的基金份额；惠利B份额为中等预期风险、中等预期收益的基金份额。若在分级运作周期内惠利B份额设置保本保障机制的，则惠利B份额为较低预期风险、中等预期收益的基金份额。

十四、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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据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为截至2015年9月30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2015年9月30日，中海惠利纯债分级债券型证券投资基金资产净值为645,289,706.64元，基金份额净值为1.222元，累计基金份额净值为1.236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	－	－
	其中：股票	－	－
2	固定收益投资	1,095,632,577.34	95.57
	其中：债券	1,095,632,577.34	95.57
	资产支持证券	－	－
3	贵金属投资	－	－
4	金融衍生品投资	－	－
5	买入返售金融资产	－	－
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
6	银行存款和结算备付金合计	19,568,815.45	1.71
7	其他资产	31,178,305.49	2.72
8	合计	1,146,379,698.28	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金为纯债基金，不进行股票投资。

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

本基金为纯债基金，不进行股票投资。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	432,864.00	0.07
2	央行票据	－	－
3	金融债券	30,126,000.00	4.67
	其中：政策性金融债	30,126,000.00	4.67
4	企业债券	1,040,947,652.84	161.31
5	企业短期融资券	999,000.00	0.15
6	中期票据	－	－
7	可转债	23,127,060.50	3.58
8	其他	－	－
9	合计	1,095,632,577.34	169.79

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

金额单位：人民币元

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	122972	09绵投控	736,380	74,963,484.00	11.62
2	122984	09六城投	700,000	70,973,000.00	11.00
3	122964	PR武进债	1,293,700	65,642,338.00	10.17
4	122875	10红投02	597,590	62,221,070.80	9.64
5	1480115	14攀国投债	500,000	54,365,000.00	8.42

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、 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。

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）本基金为纯债基金，不进行股票投资。

（3）截至2015年9月30日，本基金的其他资产项目构成如下：

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	49,487.49
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	31,128,818.00
5	应收申购款	－
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	31,178,305.49

（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	113008	电气转债	3,016,450.00	0.47

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金为纯债基金，不进行股票投资。

（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。

十五、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（截止日期2015年9月30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
2014.01.01－2014.12.31	12.85%	0.28%	10.82%	0.09%	2.03%	0.19%
2015.01.01－2015.06.30	6.70%	0.11%	3.17%	0.09%	3.53%	0.02%
2015.07.01－2015.09.30	2.52%	0.42%	2.57%	0.06%	－0.05%	0.36%
自基金合同生效起至今	23.81%	0.27%	17.82%	0.09%	5.99%	0.18%

注：本基金合同生效日为2013年11月21日，基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十六、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、基金的相关账户的开户及维护费用；

8、基金的证券交易费用；

9、基金的银行汇划费用；

10、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。

（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0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.75%÷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，由基金管理人和基金托管人双方核对后，基金托管人于次月前5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0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.2%÷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，由基金管理人和基金托管人双方核对后，基金托管人于次月前5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

基金合同生效日至2013年12月3日，惠利A份额的销售服务费年费率为0.35%，自2013年12月4日起，惠利A份额的销售服务费年费率为0.25%。惠利B份额不收取销售服务费。

惠利A份额销售服务费按前一日惠利A份额基金资产净值的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H＝E×销售服务费年费率÷当年天数

H为惠利A份额每日应计提的销售服务费

E为惠利A份额前一日的基金份额（参考）净值与惠利A份额数的乘积

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人和基金托管人双方核对后，基金托管人于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

4、证券账户开户费

证券账户开户费由托管人在开户时先行垫付，基金在证券账户开户一个月内成立的，经基金管理人和基金托管人双方核对后，自基金账户开户一个月内由基金托管人从基金资产中扣划；如基金账户开户一个月内产品未能成立，由基金管理人在收到基金托管人缴费通知后的5个工作日内支付给托管人，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

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。

过渡期内本基金不计提管理费、托管费和销售服务费。

（三）不列入基金费用的项目

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；

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）基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费、基金托管费和销售服务费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2个工作日前在指定媒体上刊登公告。

（五）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。

十七、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“申购与赎回的数量限制”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”部分按最新资料进行了更新。

（七）对“惠利B份额的保本保障机制”部分按最新资料进行了更新

（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

二〇一六年一月四日

关于中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金暂停申购(含转换转入及定期定额投资)业务公告

公告送出日期：2016年1月4日

1 公告基本信息

基金名称		中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金
基金简称		中海积极收益混合
基金主代码		000597
基金管理人名称		中海基金管理有限公司
公告依据		《中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停申购起始日	2016年1月5日
	暂停转换转入起始日	2016年1月5日
	暂停定期定额投资起始日	2016年1月5日
	暂停申购（转换转入、定期定额投资）的原因说明	维护现有基金份额持有人的利益，保证基金的平稳运行

2 其他需要提示的事项

(1) 投资者于2016年1月4日15:00后在本基金管理人网上交易系统办理本基金申购业务(含转换转入)，本基金管理人将有权不予确认；

(2) 本基金暂停申购(含转换转入)业务期间，本基金转换转出业务及赎回业务等其他业务仍照常办理；

(3) 本基金恢复申购(含转换转入及定期定额投资)业务的具体时间将另行公告；

(4) 投资者可以通过以下途径咨询有关事项：

①中海基金管理有限公司

客户服务电话：400-888-9788(免长途费)或021-38789788

网址：www.zhfund.com

②代销机构：中国农业银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、国联证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、联讯证券股份有限公司、中信期货有限公司、杭州数米基金销售有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、上海天天基金销售有限公司、万银财富（北京）基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、北京增财基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、中国国际期货有限公司、中期资产管理有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、上海汇付金融服务有限公司、泰诚财富基金销售（大连）有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、北京乐融多源投资咨询有限公司、大泰金石投资管理有限公司、深圳富济财富管理有限公司、上海凯石财富基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司。

中海基金管理有限公司

2016年1月4日

关于中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金暂停申购(含转换转入)业务公告

公告送出日期：2016年1月4日

1 公告基本信息

基金名称		中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金
基金简称		中海进取收益混合
基金主代码		001252
基金管理人名称		中海基金管理有限公司
公告依据		《中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停申购起始日	2016年1月5日
	暂停转换转入起始日	2016年1月5日
	暂停申购（转换转入）的原因说明	维护现有基金份额持有人的利益，保证基金的平稳运行

2 其他需要提示的事项

(1) 投资者于2016年1月4日15:00后在本基金管理人网上交易系统办理本基金申购业务(含转换转入)，本基金管理人将有权不予确认；

(2) 本基金暂停申购(含转换转入)业务期间，本基金赎回业务等其他业务仍照常办理；

(3) 本基金恢复申购(含转换转入)业务的具体时间将另行公告；

(4) 投资者可以通过以下途径咨询有关事项：

①中海基金管理有限公司

客户服务电话：400-888-9788(免长途费)或021-38789788

网址：www.zhfund.com

②代销机构：平安银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、国联证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、渤海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司 、中信证券（山东）有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中信期货有限公司、华西证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、联讯证券股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、上海天天基金销售有限公司、万银财富（北京）基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、北京增财基金销售有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、中期资产管理有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、上海汇付金融服务有限公司、泰诚财富基金销售（大连）有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、北京乐融多源投资咨询有限公司、大泰金石投资管理有限公司、深圳富济财富管理有限公司、上海凯石财富基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司。

中海基金管理有限公司

2016年1月4日

中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金分级运作期届满转型后基金名称变更及转换基准日等事项的公告

《中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于2013年1月7日生效，根据基金合同的有关规定，基金合同生效后3年期届满，中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金（基金简称：中海惠裕分级债券发起式，基金代码：163907，以下简称“本基金”）无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）”。

根据基金合同，本基金转换基准日为2016年1月7日，在转换基准日日终，中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金之惠裕A份额（场内简称：惠裕A，基金代码：163908）、中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金之惠裕B份额（场内简称：惠裕B，基金代码：150114）的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）的基金份额，惠裕B将终止上市。基金管理人将进行注册登记变更、账户更名等操作。

在基金管理人办理注册登记信息完成后，本基金的基金份额将使用变更后的基金名称和对应的基金代码。自2016年1月8日起，本基金基金名称变更为“中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）”。

本基金转换前基金份额持有人持有的场内惠裕B基金份额将转换为中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）场内份额，仍登记在证券登记结算系统。上述中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）的基金简称为“中海惠裕债券发起式（LOF）”，基金代码为163907，其场内简称为“中海惠裕”。

在本基金转换完成后，投资者可通过销售机构查询转换后持有的基金份额，具体时间将另行公告。

投资者可登陆本公司网站（www.zhfund.com）或拨打客服电话021-38789788或400-888-9788（免长途话费）咨询相关信息。

特此公告。

中海基金管理有限公司

2016年1月4日

中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金之惠裕A份额开放申购赎回期间惠裕B份额（150114）交易风险提示公告

《中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）已于2013年1月7日生效。根据《基金合同》的规定，中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金（场内简称：中海惠裕，基金代码：163907，以下简称“本基金”）自生效之日起3年内，基金份额分为惠裕A份额（基金代码：163908）和惠裕B份额（基金代码：150114）。根据《基金合同》的有关规定，基金合同生效后3年期届满，无需召开基金份额持有人大会，本基金将不再进行基金份额分级，并转换为上市开放式基金（LOF）份额。惠裕A自基金合同生效之日起3年内起每满6个月开放申购与赎回一次。2016年1月6日为惠裕A的第六个开放日（即基金合同生效后3年期届满基金份额转换前的最后一个开放日），接受投资者的申购与赎回。现就惠裕B的风险提示如下：

1、惠裕B收益分配变化的风险。根据《基金合同》规定，在惠裕A的最后1个开放日，基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率重新设定惠裕A的年收益率，该收益率适用于该开放日（不含）到基金合同生效后3年期届满日（含）的时间段。计算公式为：惠裕A的年收益率（单利）＝1年期银行定期存款基准利率+1.4%。

其中，1年期银行定期存款基准利率为本次惠裕A开放日（2016年1月6日）中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率，惠裕A的年收益率计算按照四舍五入的方法保留到以百分比计算的小数点后第2位。惠裕A的约定年收益率按照上述方式调整后，惠裕B的收益分配将相应调整。（2016年1月7日交易结束前本基金仍划分为惠裕A、惠裕B两级份额。）

根据本基金《基金合同》的规定，本基金基金合同生效后3年期届满，无需召开基金份额持有人大会，本基金将不再进行基金份额分级，并转换为上市开放式基金（LOF）份额，故原持有惠裕B的基金份额持有人的风险收益特征将发生一定的变化。惠裕B为较高风险、较高收益的基金份额。在本基金转换为上市开放式基金（LOF）份额之后，转换后的上市开放式基金（LOF）为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金管理人再次提醒投资者注意基金份额转换后的风险收益特征变化。

2、惠裕B杠杆率变动的风险。目前，惠裕A与惠裕B的份额配比为0.24639739:3。本次开放日内惠裕A的申购赎回可能会引发惠裕A、惠裕B份额配比发生变化，进而导致惠裕B份额杠杆率变动风险。

基金管理人将向深圳证券交易所申请惠裕B自2016年1月4日上午自开市至10:30分停牌1小时。本次惠裕A实施基金份额折算及开放赎回结束后，本基金管理人将对惠裕A基金份额折算及开放赎回的结果进行公告。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》等相关法律文件。

中海基金管理有限公司

2016年1月4日

中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金之惠裕A份额开放申购和赎回业务公告

公告送出日期：2016年1月4日

1公告基本信息

基金名称	中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金	
基金简称	中海惠裕分级债券发起式（场内简称：中海惠裕）	
基金主代码	163907	
基金运作方式	契约型。基金合同生效后三年内，惠裕A份额每满六个月开放申购和赎回一次；惠裕B份额封闭运作，不开放申购和赎回，但可在深圳证券交易所上市交易。基金合同生效后三年期届满，本基金将转换为LOF，并不再进行基金份额分级。	
基金合同生效日	2013年1月7日	
基金管理人名称