中海可转换债券债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2015年第2号）

本基金基金合同于2013年3月20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2015年9月20日，有关财务数据和净值表现截止日为2015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

邮政编码：200120

成立日期：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）

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2004]24号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：壹亿肆仟陆佰陆拾陆万陆仟柒佰元人民币

存续期间：持续经营

联系人：兰嵘

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	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、党委书记。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财务管理部总经理。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、中国海洋石油总公司资金管理部总经理。

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。

彭绍宜先生，董事。南华大学学士。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副总裁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）上海梅岭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。

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。

张军先生，独立董事。复旦大学博士。现任复旦大学经济学院院长、中国经济研究中心主任、复旦大学“当代中国经济”长江学者特聘教授、复旦发展研究院副院长、博士生导师。

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、信托事务管理总部总经理。历任北京石油交易所交易部副经理，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岗位经理，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。

谢铁祥先生，职工监事。博士。现任中海基金管理有限公司风控稽核部总经理。历任山东省招远市锦晶厂财务科科员，上海浦发银行外汇业务部科员，中海基金管理有限公司风险管理部助理风控经理、风控经理、风险管理部总经理助理、风险管理部总经理兼风控总监。

张奇先生，职工监事。学士。现任中海基金管理有限公司信息技术部总经理。历任沈阳联正科技有限公司技术部经理，北京致达赛都科技有限公司网络部经理，上海致达信息产业股份有限公司技术支持部经理，中海基金管理有限公司信息技术部工程师、信息技术部总经理助理、信息技术部副总经理。

3、高级管理人员

陈浩鸣先生，董事长。简历同上。

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，常务副总经理。复旦大学数理统计专业学士，经济师。历任天潼市统计局秘书，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，历任本公司督察长、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2014年10月兼任本公司代理督察长），2015年4月至今任本公司常务副总经理。

王莉女士，督察长。华东政法学院国际经济法专业学士。历任中银国际证券有限责任公司研究部翻译，上海源泰律师事务所律师助理。2006年9月进入本公司工作，历任监察稽核部监察稽核经理、监察稽核部部门负责人、督察长兼监察稽核部总经理兼信息披露负责人。2015年5月至今任本公司督察长兼信息披露负责人。

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，历任固定收益小组负责人、固定收益部副总监，现任固定收益部总经理。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，2014年8月至今任中海惠祥分级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2013年3月20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
周其源	2013年3月20日—2014年3月20日
周其源、江小震	2014年3月21日—2014年4月30日
江小震	2014年5月1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。

夏春晖先生，委员。现任中海基金管理有限公司投研中心副总经理、首席策略分析师、基金经理。

许定炳女士，委员。现任中海基金管理有限公司代理投资总监、投资副总监、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总经理、基金经理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

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

法定代表人：刘士余

成立日期：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010—66060069

传真：010—68121816

联系人：林葛

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，中国农业银行拥有不断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》入评为中国“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。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

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，内设券老金管理中心、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）基金份额发售机构

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：周颖

客户服务电话：400—888—9788（免长途话费）或021—38789788

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）

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：刘士余

传真：（010）85109219

联系人：蒋浩

客户服务电话：95599

公司网址：www.abc.china.com

（2）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

（3）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

（4）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

（5）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

（6）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：施传荣

电话：（021）38576666

传真：（021）50105124

客户服务电话：（021）962999

公司网站：www.srcb.com

（7）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7—9层

办公地址：无锡市太湖新城金融一街8号7—9层

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

（8）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

（9）海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路689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

（10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

（11）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城路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：丙敏祖

客户服务电话：400—888—8666

公司网址：www.gtja.com

（12）申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

电话：021—33389888

传真：021—33388224

联系人：黄莹

客户服务电话：95523或4008895523

公司网址：www.swhysc.com

（13）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

（14）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层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

电话：021—20333333

传真：021—50498871

联系人：梁旭

客户服务电话：400—888—8588

公司网址：www.longone.com.cn

（15）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

（16）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.boci.com.cn

（17）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

（18）第一创业证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼

法定代表人：刘学民

联系人：吴军

电话：0755—23838751

传真：0755—82485081

客户服务电话：400—888—1888

公司网址：www.firstcapital.com.cn

（19）申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室（邮编：830002）

法定代表人：许建平

电话：010—88085858

传真：010—88085195

联系人：李巍

客户服务电话：400—800—0562

网址：www.hysec.com

（20）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

（21）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

（22）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

（23）中信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心二路8号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：北京市朝阳区光马路甲46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.csc.ecitic.com

（24）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

（25）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

（26）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

（27）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

（28）华林证券有限责任公司

住所：深圳市福田区民田路178号华融大厦5—6楼

法定代表人：薛荣年

联系人：王开平

联系电话：0755—82707705

客服电话：400—188—3888

公司网址：http://www.chinalions.com

（29）华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元

办公地址：上海市肇嘉浜路750号

法定代表人：俞洋

联系人：陈敏

业务联系电话：021—64339000—807

客服热线：021—32109999；029—68918888；4001099918

公司网址：www.zfsc.com.cn

（30）杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室

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：韩爱彬

客服电话：4000—766—123

公司网址：www.fund123.cn

（31）深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

联系电话：0755—33227950

客服电话：4006—788—887

公司网址：www.zlfund.cn?及?www.jjmmw.com

（32）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

联系人：邓阳华

联系电话：021—20691831

客服电话：400—820—2899

公司网址：www.erichfund.com

（33）?诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市虹口区“虹桥303弄9号3724室

?办公地址：上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12层

?法定代表人：汪静波

联系人：徐诚?

??联系电话：021—38509639

??客服电话：400—821—5399

??公司网址：www.noah-fund.com

（34）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：吴卫东

联系电话：021—20835787

客服电话：400—920—0022/ 021—20835588

公司网址：licaike.hexun.com

（35）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：朱玉

联系电话：021—54509998

客服电话：400—1818—188

公司网址：www.1234567.com.cn

（36）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：王翠

联系人：李亚洁

联系电话：010—53300532

客服电话：400—059—8888

公司网址：www.wy-fund.com

（37）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

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

（38）上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路475号1033室

办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：沈继伟

联系人：吴鸿飞

联系电话：021—50583533

客服电话：400—005—6355

公司网址：www.leadfund.com.cn

（39）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：罗昶安

联系人：史丽丽

联系电话：010—67000988

客服电话：400—001—8811

公司网址：www.zcvc.com.cn

（40）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：周斌

联系电话：010—57756019

客服电话：400—786—8868—5

公司网址：www.chtfund.com

（41）深圳市前海三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：北京市西城区宣武门外大街10号庄胜广场中央办公楼东翼7层727室

法定代表人：杨静

联系人：刘宝文

联系电话：010—63130889—8369

客服电话：400—166—1188

公司网址：8.jrj.com.cn

（42）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?

客服电话：0571—88911818

客服电话：4008—773—772

公司网址：www.5ifund.com

（43）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

（44）中期资产管理有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号中期大厦8层

法定代表人：姜新

联系人：方艳美

联系电话：010—65807865

客服电话：010—65807865

公司网址：www.cifcofund.com

（45）浙江金观诚财富管理有限公司

住所：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

办公地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

法定代表人：陈峰

联系人：周立枫

联系电话：0571—88337788

客服电话：400—068—0058

公司网址：www.jincheng-fund.com

（46）上海汇付金融服务有限公司

住所：上海市黄浦区西藏中路336号1807—5室

办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼

法定代表人：张晶

联系人：周丹

联系电话：021—33323999*8318

客服电话：400—820—2819

公司网址：fund.bundtrade.com

（47）中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301—1305室、14层??

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301—1305室、14层??

法定代表人：张皓?

联系人：洪诚 ??

电话：0755—23953913??

传真：0755—83217421 ??

客户服务电话：400—990—8826

网址：www.citicsf.com

(48) 华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：阎志茹

电话：028—86135991

传真：028—86150040

客户服务电话：95584和4008—888—818

公司网址：http://www.hx168.com.cn

（49）上海陆金所资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

联系电话：021—20665952

传真：021—22066653

客服电话：4008219031

公司网址：www.lufunds.com

（50）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

住所：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人：林卓

联系人：薛长平

联系电话：0411—88891212

传真：0411—84396536

客服电话：4006411999

公司网址：www.taichengcaifu.com

基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实情，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构，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

成立日期：2004年3月18日

电话：021—38429808

传真：021—68419328

联系人：周琳

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

（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：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

执行事务合伙人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：赵廷

经办会计师：薛竞、赵廷

四、基金的名称

中海可转换债券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

本基金以可转换债券为主要投资目标，在严格控制投资组合风险的基础上，充分挖掘可转换债券兼具股性和债性的风险收益特征，实现基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资范围

本基金主要投资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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资的固定收益类资产包括国债、央行票据、中期票据、金融债、公司债、企业债、政府机构债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、中小企业私募债、债券回购、短期融资券、次级债、银行存款、资产支持证券等金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具；

2、股票等非固定收益类资产的投资比例不超过基金资产的20%；

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、本基金与由本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%；

5、进入全国银行间同业市场的债券回购最大资金余额不得超过基金资产净值的40%。债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

6、本基金参与股票发行申购，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报发行股票公司本次发行股票的总量；

7、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；

8、本基金投资权证，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%，本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；

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%；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，不得超过本基金资产净值的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，其市值不得超过本基金资产净值的20%；

10、本基金投资的资产支持证券信用级别评级为BBB级以上含BBB)或相当于BBB级，在本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；

11、本基金持有的全部中小企业私募债券，其市值不得超过固定收益类基金资产的20%；本基金持有单只中小企业私募债券的比例，其市值不得超过基金资产净值的10%；

12、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；

13、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、股权分置改革中支付对价等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述各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。

十二、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

中信标普可转债指数收益率×70%＋中证综合债券指数收益率×20%＋上证红利指数×10%。

中信标普可转债指数由中信标普指数公司推出，最大限度地涵盖了在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的可转换债券，市场覆盖面广、代表性高。

中证综合债券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。该指数是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券及一年期以下的国债、金融债和企业债，于2008年11月12日正式发布，以更加全面地反映中国债券市场整体价格变动趋势。

上证红利指数是由上海证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数。该指数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，能够反映上海证券市场高红利股票的整体状况和走势。该指数于2004年12月31日正式发布。

由于本基金为债券型基金，在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法以及指数与本基金投资范围、投资理念的吻合度后，本基金认为，以上业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的业绩比较基准。

如果今后市场出现更具代表性的业绩比较基准，或者指数编制单位停止编制该指数，或有更具权威、更科学的复合指数权重比例，在与基金托管人协商一致后，本基金管理人可以在报中国证监会备案后调整或变更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的中低风险、中低预期收益品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型、混合型基金，高于货币市场基金。

本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

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股份有限公司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2015年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

截至2015年6月30日，中海可转换债券债券型证券投资基金A类资产净值为46,274,331.76元，基金份额净值为0.935元，累计基金份额净值为1.145元；C类资产净值为42,617,318.93元，基金份额净值0.945元，累计基金份额净值为1.155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	22,553,001.20	17.19
	其中：股票	22,553,001.20	17.19
2	固定收益投资	92,306,018.32	70.36
	其中：债券	92,306,018.32	70.36
	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	9,260,682.74	7.06
6	其他资产	7,066,075.80	5.39
7	合计	131,185,778.06	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	–	–
B	采掘业	–	–
C	制造业	11,843,180.00	10.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	347.20	0.00
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,385,700.00	3.84
J	金融业	206,040.00	0.18
K	房地产业	6,117,734.00	5.36
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	22,553,001.20	19.76

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

代码	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	600240	华业地产	400,900	6,117,734.00