中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要

（2016年第1号）

本基金基金合同于2013年1月7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2016年1月7日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年12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

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

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

黄晓峰先生,董事长。中国人民大学硕士,高级经济师。现任中海信托股份有限公司总裁、党委书记。历任湖北省计划管理干部学院助教,国家海洋局管理司主任科员,中国海洋石油总公司计划项目处、经济评价处干部、保险处保险主管,中海石油有限公司税收保险岗、代理融资岗位经理、资金部副总监、代理总监、总监,中海石油财务有限责任公司总经理。

庞建先生,董事。中国人民大学本科学历,高级会计师。现任中国海洋石油总公司（有限公司）资金部总经理。历任渤海石油公司对外合作部计划财务部外事会计,渤海13/03合作区联管会财务专业代表,10/15、11/19、06/17合作区联管会财务专业代表,中国海洋石油总公司审计部干部,中海会计审计公司第三业务处干部、审计业务三部经理（副处级）,中国海洋石油总公司审计部审计三处处长、项目审计经理、审计监察部投资项目审计调查经理、内审岗经理,中国海洋石油有限公司审计监察部总经理,中国海洋石油总公司（有限公司）审计监察部副总经理兼审计中心主任,中国海洋石油国际有限公司副总经理。

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。

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、稽核审计部经理。

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。

康铁祥先生,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。历任山东省招远市绣品厂财务科科员,上海浦发银行外汇业务科科员,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。历任沈阳东软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

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,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、监察稽核部副总经理、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,现任固定收益部总监。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1月7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	2013年1月7日-2013年1月11日
江小震、陆成来	2013年1月12日-2015年5月25日
江小震	2015年5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。

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。

许定晴女士,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）基金托管人概况

1、基本情况

名称:招商银行股份有限公司（以下简称"招商银行"）

设立日期:1987年4月8日

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本:252.20亿元

法定代表人:李建红

行长:田惠宇

资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号

电话:0755—83199084

传真:0755—83195201

资产托管部信息披露负责人:张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿A股,4月9日在上交所挂牌（股票代码:600036）,是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股,9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码:3968）,10月5日行使H股超额配售,共发行了24.2亿H股。截止2015年9月30日,本集团总资产5.2223万亿元人民币,高级法下资本充足率12.79%,权重法下资本充足率12.14%。

2002年8月,招商银行成立基金托管部;2005年8月,经报中国证监会同意,更名为资产托管部,下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室,现有员工60人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月,正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行,拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立"因势而变、先您所想"的托管理念和"财富所托、信守承诺"的托管核心价值,独创"6S托管银行"品牌体系,以"保护您的业务、保护您的财富"为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品:在业内率先推出"网上托管银行系统"、托管业务综合系统和"6心"托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只"1+N"基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。

经过十三年发展,招商银行资产托管规模快速壮大。2015年招商银行加大高收益托管产品营销力度,截止12月末新增托管公募开放式基金61只,新增首发公募开放式基金托管规模990.05亿元。克服国内证券市场震荡的不利形势,托管费收入、托管资产均创出历史新高,实现托管费收入35.66亿元,同比增长68.83%,托管资产余额7.16万亿元,同比增长101.97%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人,成功签约"壹基金"公益资金托管,为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索,该项目荣获2012年中国金融品牌「金象奖」"十大公益项目"奖;四度蝉联获《财资》"中国最佳托管专业银行"。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

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: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、场外代销机构

（1）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

（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

联系人:杨菲

客户服务电话:95588

公司网址:www.icbc.com.cn

（3）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.abchina.com

（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:王洪章

联系人:何奕

客户服务电话:95533

公司网址: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: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

（6）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

（7）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

（8）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

（9）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

（10）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

（11）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

（12）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

（13）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

（14）国泰君安证券股份有限公司

注册地址:中国（上海）自由贸易试验区商城路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:杨德红

电话:021-38676161

传真:021-38670161

联系人:芮敏祺

客户服务电话:400-888-8666/95521

公司网址:www.gtja.com

（15）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

（16）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

（17）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

（18）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

（19）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

（20）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:stock.pingan.com

（21）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

（22）中泰证券股份有限公司

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

（23）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

（24）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:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼

法定代表人:张建军

电话:020-37865070

联系人:王鑫

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

（25）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

（26）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

（27）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

（28）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

（29）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

（30）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

（31）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

（32）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

（33）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

（34）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

（35）长城国瑞证券有限公司

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:王勇

联系人:赵钦

客户服务电话:0592-5163588

公司网站:www.xmzq.cn

（36）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

（37）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:王叶平

联系电话:0755-82707705

客服电话:400-188-3888

公司网址:http://www.chinalions.com

（38）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.cfsc.com.cn

（39）中国国际金融股份有限公司

住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人:丁学东

联系人:杨涵宇

联系电话:01065051166

客服电话:4009101166

公司网址:www.cicc.com.cn

（40）联讯证券股份有限公司

注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人:徐刚

联系人:彭莲

电话:0752-2119700

传真:0752-2119660

客户服务电话:95564

网址:www.lxsec.com

（41）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

（42）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

（43）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:郑茵华

联系电话:021-20691831

客服电话:400-820-2899

公司网址:www.erichfund.com

（44）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所:上海市虹口区飞虹路360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

（45）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

（46）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

（47）万银财富（北京）基金销售有限公司（仅代销A类份额）

住所:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201

办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08

法定代表人:李招弟

联系人:付少帅

联系电话:010-59497361

客服电话:400-059-8888

公司网址:www.wy-fund.com

（48）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

（49）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

（50）北京恒天明泽基金销售有限公司（仅代销A类份额）

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

（51）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:杨懿

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

（52）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

(53) 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: 陈峥

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

（54）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

（55）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

(56) 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:周志茹

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

（57）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

(58) 大泰金石投资管理有限公司

住所:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室

办公地址:上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼

法定代表人:袁顾明

联系人:何庭宇

联系电话:13917225742

传真:021-22268089

客服电话:021-22267995/400-928-2266

公司网址:www.dtfunds.com

（59）深圳富济财富管理有限公司

住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址:深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室

法定代表人:齐小贺

联系人:陈勇军

联系电话:0755-83999907-806

传真:0755-83999926

客服电话:0755-83999913

公司网址:www.jinqianwo.cn

(60)上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人:陈继武

联系人:李晓明

联系电话:021-63333319

传真:021-63332523

客服电话:4000178000

公司网址:www.lingxianfund.com

(61)珠海盈米财富管理有限公司

住所:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法定代表人:肖雯

联系人:黄敏嫦

联系电话:020-89629099

传真:020-89629011

客服电话:020-89629066

公司网址:www.yingmi.cn

3、场内代销机构

惠裕B基金份额办理场内认购业务的发售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）。尚未取得相应业务资格,但属于深圳证券交易所会员的其他机构,可在惠裕B基金份额上市后,代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与惠裕B基金份额的上市交易。

基金管理人可根据有关法律法规的要求,增加其他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:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京市西城区太平桥大街17号

办公地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:周明

电话:010-59378856

传真:010-59378907

联系人:崔巍

（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:赵钰

经办会计师:薛竞、赵钰

四、基金的名称

基金合同生效之日起3年内,本基金名称为"中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金";基金合同生效后3年期届满,本基金转换为上市开放式基金（LOF）后,本基金名称为"中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）"。

五、基金的类型

债券型

六、基金份额的分级

（一）基金份额的分级

本基金的基金份额分为惠裕A、惠裕B两类,所募集的基金资产合并运作。

1、基金份额配比

本基金募集设立时,惠裕A、惠裕B的份额配比将不超过7:3。本基金基金合同生效之日起3年内的每一个开放日,经注册登记机构确认后的惠裕A、惠裕B的份额配比原则上不超过7:3。

本基金基金合同生效之日起3年内,惠裕A自基金合同生效之日起每满6个月开放一次,惠裕B封闭运作并上市交易。在惠裕A的每次开放日,基金管理人将对惠裕A进行基金份额折算（但《基金合同》生效之日起3年内第六个惠裕A的开放日惠裕A不折算）,惠裕A的基金份额净值调整为1.000元,基金份额持有人持有的惠裕A份额数按折算比例相应增减。在惠裕A的单个开放日,如果惠裕A没有赎回或者赎回份额极小,惠裕A、惠裕B在该次开放日后的份额配比可能会出现大于7:3的情形;如果惠裕A的净赎回份额较多,惠裕A、惠裕B在该次开放日后的份额配比可能会出现小于7:3的情形。

2、惠裕A的运作

（1）收益率

惠裕A根据基金合同的规定获取约定收益,其收益率将在每个开放日设定一次并公告。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%

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。

在基金合同生效日当日,基金管理人将根据届时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设定惠裕A的首次年收益率,该收益率即为惠裕A基金合同生效后最初6个月的年收益率,适用于基金合同生效日（含）到第1个开放日（含）的时间段;在惠裕A的每个开放日（最后1个开放日除外）,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,该收益率即为惠裕A接下来6个月的年收益率,适用于该开放日（不含）到下个开放日（含）的时间段;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。

例:在本基金基金合同生效日,如果1年期银行定期存款利率为3.00%,则惠裕A的年收益率（单利）为:惠裕A的年收益率（单利）=3.00%+1.4%=4.40%

（2）开放日

惠裕A在基金合同生效后3年内每满6个月（该6个月,下称为"惠裕A开放周期"）开放一次,接受投资人的申购与赎回。

惠裕A的开放日为自基金合同生效之日起3年内每满6个月的最后一个工作日。惠裕A的第n（@）个开放日为基金合同生效满n*6个月的最后一个工作日。

因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回的,开放日为不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日。

惠裕A的第一次开放日为基金合同生效日至满6个月的日期,如该日为非工作日,则为该日之前的最后一个工作日;第二次开放日为基金合同生效之日至12个月满的日期,如该日为非工作日,则为该日之前的最后一个工作日;以此类推。如基金合同的生效日为2012年10月7日,基金合同生效之日起满6个月、满12个月、满18个月的日期分别为2013年4月6日、2013年10月6日、2014年4月6日,以此类推。假设2013年4月6日为非工作日,在其之前的最后一个工作日为2013年4月5日,则第一次开放日为2013年4月5日。其他各个开放日的计算类同。

（3）基金份额折算

本基金基金合同生效之日起3年内每满6个月的最后一个工作日,基金管理人将对惠裕A进行基金份额折算（但《基金合同》生效之日起3年内第六个惠裕A的开放日惠裕A不折算）,惠裕A的基金份额净值调整为1.000元,基金份额持有人持有的惠裕A份额数按折算比例相应增减。惠裕A的基金份额折算基准日与开放日为同一个工作日（但《基金合同》生效之日起3年内第六个惠裕A的开放日惠裕A不折算）。

惠裕A的基金份额折算具体见招募说明书第九部分以及基金管理人届时发布的相关公告。

（4）规模限制

基金合同生效之日起3年内的每个开放日,经注册登记机构确认后的惠裕A的份额余额较惠裕B的份额余额原则上不得超过7/3。具体规模限制及其控制措施见基金份额发售公告以及基金管理人发布的其他相关公告。

3、惠裕B的运作

（1）惠裕B封闭运作,封闭期内不接受申购与赎回。

惠裕B的封闭期为自基金合同生效之日起至3年后对应日止。如该对应日为非工作日,则顺延至下一个工作日。

（2）本基金基金合同生效后3个月内,在符合基金上市交易条件下,惠裕B将申请在深圳证券交易所上市交易。

（3）本基金在扣除惠裕A的应计收益后的全部剩余收益归惠裕B享有,亏损以惠裕B的资产净值为限由惠裕B承担。基金管理人并不承诺或保证惠裕A的约定应得收益,即如在本基金资产出现极端损失情况下,惠裕A仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险,此时惠裕B剩余资产可能为0。

（二）基金份额净值的计算

1、本基金基金份额净值的计算

本基金的基金份额净值计算公式如下:

T日基金份额净值=T日闭市后的基金资产净值/T日基金份额的余额数量

基金合同生效之日起3年内,T日基金份额的余额数量为惠裕A和惠裕B的份额总额;基金合同生效后3 年期届满并转为上市开放式基金（LOF）后,T日基金份额的余额数量为该LOF 基金的份额总额。

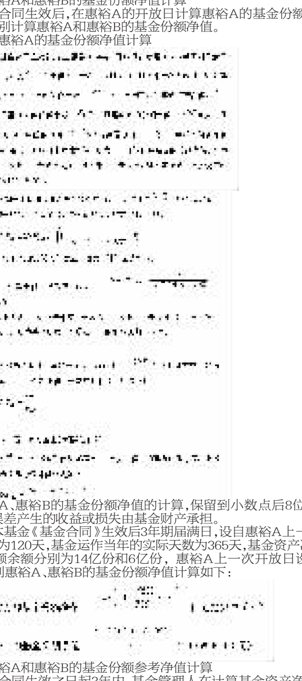
本基金基金份额净值的计算,保留到小数点后3 位,小数点后第4 位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

2、惠裕A和惠裕B的基金份额净值计算

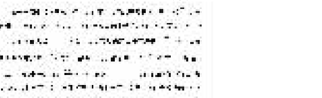
基金合同生效后,在惠裕A的开放日计算惠裕A的基金份额净值;在惠裕B的封闭期届满日分别计算惠裕A和惠裕B的基金份额净值。

（1）惠裕A的基金份额净值计算



惠裕A、惠裕B的基金份额净值的计算,保留到小数点后8位,小数点后第9位四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

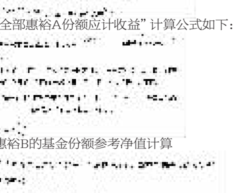
例:本基金《基金合同》生效后3年期届满日,设自惠裕A上一次开放日和折算日起的运作天数为120天,基金运作当年的实际天数为365天,基金资产净值为21亿元,惠裕A、惠裕B的份额余额分别为14亿份和6亿份, 惠裕A上一次开放日设定的惠裕A年收益率为4.65%。则惠裕A、惠裕B的基金份额净值计算如下:



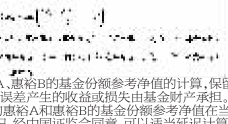
3、惠裕A和惠裕B的基金份额参考净值计算

基金合同生效之日起3年内,基金管理人在计算基金资产净值的基础上,采用"虚拟清算"原则分别计算并公告惠裕A和惠裕B的基金份额参考净值,其中,惠裕A的基金份额参考净值计算日不包括惠裕A的开放日。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算,并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

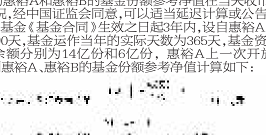
（1）惠裕A的基金份额参考净值计算



"T日全部惠裕A份额应计收益"计算公式如下:



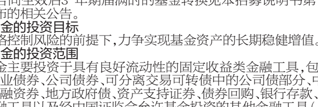
（2）惠裕B的基金份额参考净值计算



惠裕A、惠裕B的基金份额参考净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

T日的惠裕A和惠裕B的基金份额参考净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

例:本基金《基金合同》生效之日起3年内,设自惠裕A上一次开放日和折算日起的运作天数为90天,基金运作当年的实际天数为365天,基金资产净值为21亿元,惠裕A、惠裕B的份额余额分别为14亿份和6亿份, 惠裕A上一次开放日设定的惠裕A年收益率为4.65%。则惠裕A、惠裕B的基金份额参考净值计算如下:



（三）基金合同生效后3年期届满时的基金份额转换

基金合同生效后3年期届满, 本基金将按照基金合同约定转换为上市开放式基金（LOF）,惠裕A、惠裕B的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金（LOF）份额,并办理基金的申购、赎回业务。

基金合同生效后3 年期届满时的基金转换见本招募说明书第十二部分及基金管理人届时发布的相关公告。

七、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。

八、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,包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、可分离交易可转债中的公司债部分、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、可转债等,也不参与一级市场的新股、可转债申购或增发新股。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种, 基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的80%, 其中投资于中小企业私募债券的比例不高于基金资产净值的20%,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%。

九、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（包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等）和宏观经济政策（包括货币政策、财政政策和产业政策等）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骑乘收益进行分析,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/个券选择:主要依据信用利差分析,自上而下的资产配置。

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金融债、公司债（企业债）、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。

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。

2、信用品种的投资策略（中小企业私募债除外）

本基金对金融债、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。

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、基金的投资限制

1、组合限制

基金的投资组合将遵循以下限制:

（1）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;

（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10%;

（3）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%;

（4）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10%;

（5）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%;

（6）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%;

（7）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%;

（8） 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）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;

（10）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%;

（11）基金管理人管理的全部公募基金投资于一家企业发行的单期中期票据合计不超过该期证券的10%;

（12）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%;本基金持有的中小企业私募债券的剩余期限不得超过惠裕B的剩余封闭运作期;

（13）本基金投资不得违反法律法规、监管部门及基金合同规定的其他限制。

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。

如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的,以变更后的规定为准,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。

十一、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。

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比较基准时,本基金管理人可以在与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案后变更本基金业绩比较基准并及时公告,而无需基金份额持有人大会审议。

十二、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》生效之日起3年内,本基金经过基金份额分级后,惠裕A为低风险、收益相对稳定的基金份额;惠裕B为较高风险、较高收益的基金份额。

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12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2015年12月31日, 中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金资产净值为698,280,348.26元,基金份额净值为1.243元,累计基金份额净值为1.282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	894,841,579.20	95.31
	其中:债券	894,841,579.20	95.31
	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	11,951,554.94	1.27
7	其他资产	32,118,755.00	3.42
8	合计	938,911,889.14	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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	35,703,570.00	5.11
	其中:政策性金融债	35,703,570.00	5.11
4	企业债券	754,466,009.20	108.05
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	104,672,000.00	14.99
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	894,841,579.20	128.15

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	124209	13三门峡	900,000	93,843,000.00	13.44
2	124131	13安国资	600,000	62,382,000.00	8.93
3	124240	13合工投	600,970	62,020,104.00	8.88
4	1180085	11晨鸣控股债	500,000	52,590,000.00	7.53
5	124159	13绍城改	500,000	52,310,000.00	7.49

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序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股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

10、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。

11、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12月31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	2,011.61
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	32,116,743.39
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	32,118,755.00

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

（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2015年12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	2015 ③	②-④
2013.01.07-2013.12.31	-0.55%	0.13%	-1.04%	0.10%	0.49%	0.03%
2014.01.01-2014.12.31	15.24%	0.26%	10.82%	0.09%	4.42%	0.17%
2015.01.01-2015.12.31	12.68%	0.12%	8.74%	0.08%	3.94%	0.04%
自基金合同生效起至今	29.13%	0.18%	19.25%	0.09%	9.88%	0.09%

注:本基金合同生效日为2013年1月7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、基金上市初费和上市月费;

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

在基金合同生效之日起3年内或基金合同生效后3年期届满转为上市开放式基金（LOF）后,基金管理人的管理费均按基金资产净值的0.7%年费率计提。

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.7%÷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。经基金管理人和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月首日起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、休息日,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在基金合同生效之日起3年内或基金合同生效后3年期届满转为上市开放式基金（LOF）后,基金托管人的托管费均按基金资产净值的0.2% 年费率计提

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

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月首日起5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、公休日等,支付日期顺延。

3、基金销售服务费

基金合同生效之日起3年内,惠裕A的销售服务费年费率为0.35%,惠裕B不收取销售服务费。

惠裕A销售服务费按前一日惠裕A基金资产净值的0.35%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H=E×0.35%÷当年天数

H为惠裕A每日应计提的销售服务费

E为惠裕A前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人和基金托管人双方核对后,由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。

基金合同生效后3年期届满自动转换为 "中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）"后,不再收取销售服务费。

上述"（一）基金费用的种类中第4-10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

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、基金合同生效前的律师费、会计师费和信息披露费用等相关费用;

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。

十六、对招募说明书更新部分的说明

（一）在"基金管理人"部分进行了更新。

（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"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

二〇一六年二月二十日

中海基金管理有限公司关于中海魅力长三角灵活配置混合型证券投资基金参与国联证券股份有限公司认购费率优惠的公告

为了更好满足投资者的理财需求,经中海基金管理有限公司（以下简称"本公司"）与国联证券股份有限公司（以下简称"国联证券"）协商一致,决定自2016年2月22日起至基金募集截止日对通过国联证券认购中海魅力长三角灵活配置混合型证券投资基金（基金代码:001864,以下简称"本基金"）的个人投资者实行费率优惠。现将有关事项公告如下:

一、认购费率优惠时间

本基金募集期间内。

二、认购费率优惠内容

投资者通过国联证券认购本基金,认购费率如下:

认购金额（M）	标准费率	国联证券认购费率优惠
M＜100万	1.20%	0.12%
100万≤M＜300万	0.80%	0.08%
300万≤M＜500万	0.40%	0.04%
M≥500万	每笔1000元	每笔1000元

三、重要提示

认购费率优惠期间,业务办理的业务规则和流程以国联证券的安排和规定为准。具体规定如有变化,以国联证券的最新公告内容为准,敬请投资者关注。

四、投资者可通过以下途径咨询有关详情:

1、国联证券

客户服务电话:95570

公司网址:www.glsc.com.cn

2、本公司

客服电话:400-888-9788

公司网址:www.zhfund.com

特此公告。

中海基金管理有限公司

2016年2月20日