中海积极收益混合型证券投资基金招募说明书更新招募说明书摘要

（2016年第2号）

本基金基金合同于2014年5月26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。

本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

本基金投资中小企业私募债券,中小企业私募债券是指中小微型企业在中国境内以非公开方式发行和转让,约定在一定期限还本付息的公司债券,其发行人是非上市中小微企业,发行方式为面向特定对象的私募发行。因此,中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大,从而增加了本基金整体的债券投资风险。

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2016年5月26日,有关财务数据和净值表现截止日为2016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: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(有限公司)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总裁。历任无锡市证券公司(国联证券前身)交易员,国联证券有限责任公司投资经理,无锡市国联投资管理咨询有限公司投资经理,香港锡州国际有限公司投资部经理,中海基金管理有限公司投资管理部总经理兼投资总监 (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、副总裁。

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,爱德蒙得洛希尔银行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。

孙奇先生,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

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

刘俊先生,复旦大学金融学专业博士。历任上海申银万国证券研究所有限公司策略研究部策略分析师、海通证券股份有限公司战略合作与并购部高级项目经理。2007年3月进入本公司工作,曾任产品开发总监。2010年3月至2015年8月任中海稳健收益债券型证券投资基金基金经理,2012年6月至今任中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2013年7月至今任中海安鑫保本混合型证券投资基金基金经理,2014年5月至今任中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年4月至今任中海安鑫宝1号保本混合型证券投资基金基金经理, 2015年12月至今任中海顺鑫保本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2014年5月26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
刘俊	2014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。

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)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
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.abcchina.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)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)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

(9)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

(10)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:范力
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

(11)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

(12)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

(13)华龙证券股份有限公司
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:0931-4890628
联系人:李昕田
客户服务电话:400-689-8888
公司网址:www.hlzqgs.com

(14)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

(15)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

(16)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

(17)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:95321
公司网址:www.cindasc.com

(18)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

(19)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

(20)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

(21)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

(22)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

(23)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

(24)中经北证(北京)资产管理有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼一层
办公地址:北京市西城区北礼士路甲129号文化创新工场四层404
法定代表人: 徐福星
联系人:李美
电话: 010-68292940
传真: 010-68292964
客户服务电话:400-600-0030
网址:www.bzfunds.com

(25)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

(26)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

(27)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

(28)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

(29)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

(30)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

(31)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

(32)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

(33)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

(34)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: 史丽丽
联系电话:010-67000988
客服电话:400-001-8811
公司网址:www.zcvc.com.cn

(35)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

(36)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

(37)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

(38)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

(39) 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

(40) 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

(41)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

(42)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

(43)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
客服电话:4006411999
公司网址:www.taichengcaifu.com

(44) 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

(45)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

(46)北京乐融多源投资咨询有限公司
住所:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
办公地址: 北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
法定代表人:董浩
联系人:张婷婷
联系电话:18510450202
传真:010-56580660
客服电话:4000681176
公司网址:www.jimufund.com

(47) 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

(48)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

(49)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

(50)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

(51)上海联泰资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层
法定代表人:燕斌
联系人: 陈东
联系电话:021-52822063
传真:021-52975270
客服电话:4000-466-788
公司网址:www.66zichan.com

(52) 奕丰金融服务(深圳)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(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115、1116、1307室
法定代表人:TAN YIK KUAN
联系人:项晶晶
联系电话:0755-8946 0507
传真:0755 2167 4453
客服电话:4006846500/4006840500
公司网址:www.ifastps.com.cn

(53)北京钱景财富投资管理有限公司
住所:北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
办公地址:北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
法定代表人:赵荣春
联系人:盛海娟
联系电话:010-57418813
客服电话:400-893-6885
公司网址: www.qianjing.com

(54)北京展恒基金销售股份有限公司
住所:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人: 闫振杰
电话:010-59601366
传真:010-62020355
联系人:马林
客户服务电话:4008188000
公司网址:www.myfund.com

(55)深圳市金斧子投资咨询有限公司
住所:深圳市南山区南山街道科苑路18号东方科技大厦18F
办公地址:深圳市南山区南山街道科苑路18号东方科技大厦18F
法定代表人:何昆鹏(已变更)
电话:0755-84034499
传真:0755-84034477
联系人:陈姿儒
客户服务电话:4009500888
公司网址:www.jfzinv.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,变更或增减其他符合要求的机构销售本基金,并及时公告。

(二)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
负责人:韩炯
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:孙睿
经办律师:黎明、孙睿

(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

中海积极收益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

在充分重视本金长期安全的前提下,力争为基金份额持有人创造积极收益。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为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(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)等权益类资产、债券等固定收益类资产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相关规定)。

本基金固定收益类资产主要投资于国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、次级债券、可转换债券、中小企业私募债、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具等金融工具。

本基金权益类资产主要投资于股息率高、分红潜力强或具有核心竞争力的优质上市公司。

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:本基金投资于股票的比例占基金资产的0-95%,本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

1、一级资产配置

一级资产配置主要采取自上而下的方式。

本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策分析判断,采取自上而下的分析方法,比较不同证券子市场和金融产品的收益及风险特征,动态确定基金资产在固定收益类和权益类资产的配置比例。

2、债券投资策略

(1)久期配置:基于宏观经济趋势性变化,自上而下的资产配置。

利用宏观经济分析模型,确定宏观经济的周期变化,主要是中长期的变化趋势,由此确定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,即债券市场顺周期、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。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析,根据收益率模型为各种固定收益类金融工具进行风险评估,最终确定投资组合的久期配置。

(2)期限结构配置:基于数量化模型,自上而下的资产配置。

在确定组合久期后,通过研究收益率曲线形态,采用收益率曲线分析模型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。通过优化资产配置模型选择预期收益率最高的期限段进行配比组合,从而在子弹组合、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。

本基金根据国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、资产支持证券之间的相对价值,以其历史价格关系的数量分析为依据,同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析,综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、可转换债券、资产支持证券等信用债券,在信用利差水平较低时持有国债,从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。

个券选择:基于各个投资品种具体情况,自下而上的资产配置。

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。

(4)其它交易策略

a、短期资金运用:在短期资金运用上,如果逆回购利率较高,选择逆回购融出资金。

b、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。随着交易所固定收益综合电子平台的推出,交易所债券市场流动性日益增强,这使得跨市场套利策略成为可能。本基金将利用两市场相同公司债券交易价格的差异,锁定其中的无风险收益进行跨市场套利,增加持有人收益。

3、中小企业私募债投资策略

本基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

本基金对中小企业私募债的投资策略主要重点分析中小企业私募债的信用风险及流动性风险。

4、股票投资策略

本基金股票投资主要采用定量与定性的方式精选股票。

(1)定量方式

本基金主要通过现金股息率、3年平均分红额等指标进行综合评价以反映上市公司过去分红强度、持续性、稳定性及分红投资回报。同时通过对经营能力、盈利能力、负债情况等财务指标的分析,判断企业未来的分红能力及意愿,从而精选出现金股息率高、分红潜力强的优质上市公司。

(2)定性方式

本基金主要通过实地调研等方法,综合考察评估公司的核心竞争优势,重点投资具有较高进入壁垒、在行业中具备比较优势的公司,并坚决规避那些公司治理混乱、管理效率低下的公司,以确保最大程度地规避投资风险。

本基金管理人重点考察上市公司的竞争优势包括:公司管理竞争优势、技术或产品竞争优势、品牌竞争优势、规模优势等方面。

九、基金的投资决策依据和决策流程

(一)投资决策依据

1、依据投资研究人员对国内宏观经济、政策、行业和上市公司的综合分析研究进行决策;

2、依据对国内证券市场的阶段表现、活跃程度和发展趋势的判断进行决策;

3、依据国家有关法律、法规和《基金合同》的规定进行决策;

4、风险控制贯穿投资过程各环节。

(二)投资决策流程

为明确投资各环节的业务职责,防范投资风险,基金管理人建立规范的投资流程。

1、投资决策委员会定期召开会议确定股票/债券资产投资比例,形成基金投资的投资决议。

2、研究部和金融工程部等提出个股、行业选择、数量化投资方案,为基金经理和投资决策委员会提供投资参考依据。

3、基金经理根据投资决策委员会的决议,在研究部和金融工程部等提出的方案的基础上构建投资组合。

4、交易部依据基金经理的指令,执行交易,交易进行过程中,交易员及时反馈市场信息。

5、风险管理部对基金投资组合的风险进行跟踪、评估、控制,对投资组合的绩效进行分析。

十、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)本基金对股票的投资比例占基金资产的0-95%;

(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)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(8)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%;

(9)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%;

(10)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%;

(11) 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%;

(12)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;

(13)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;

(14)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%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(15) 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5%;

(16)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。法律法规另有规定的,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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,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或按调整后的规定执行。

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)违反规定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,但是中国证监会另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资;

(6)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;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定,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。

十一、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)+2%。

其中,一年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构一年期人民币存款基准利率。

本基金以实现积极收益作为投资目标,力争在混合型基金的投资限定之下,追求较好的投资回报。一年期银行定期存款作为收益稳定的产品,较符合本基金的收益预期。因此,本基金采用一年期银行定期存款利率(税后)+2%作为业绩比较基准,与本基金追求的预期收益水平相符。

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。

十二、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

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2016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2016年3月31日, 中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金资产净值为238,693,108.55元,基金份额净值为1.137元,累计基金份额净值为1.137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	8,356,071.80	3.49
	其中:股票	8,356,071.80	3.49
2	固定收益投资	669,000.00	0.28
	其中:债券	669,000.00	0.28
	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	190,000,385.00	79.34
	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	40,251,863.76	16.81
7	其他资产	200,812.47	0.08
8	合计	239,478,133.03	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	498,139.42	0.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		
E	建筑业	3,897,432.00	1.63
F	批发和零售业	257,750.48	0.11
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	2,252,169.90	0.94
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,450,580.00	0.61
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	8,356,071.80	3.50

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	002663	普邦园林	585,200	3,897,432.00	1.63
2	002712	思美传媒	14,500	1,450,580.00	0.61
3	300496	中科创达	6,560	1,265,948.80	0.53
4	300494	盛天网络	6,251	525,709.10	0.22
5	002777	久远银海	4,264	460,512.00	0.19
6	002786	银宝山新	9,630	343,405.80	0.14
7	002780	三夫户外	3,566	257,750.48	0.11
8	603027	千禾味业	2,904	80,440.80	0.03
9	002790	瑞尔特	1,763	74,292.82	0.03

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	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	669,000.00	0.28
8	其他	-	-
9	合计	669,000.00	0.28

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	113010	江南转债	6,690	669,000.00	0.28

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) 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)截至2016年3月31日,本基金的其他资产项目构成如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	115,476.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	78,187.94
5	应收申购款	7,148.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	200,812.47

(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换债券。

(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。

(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(截止日期2016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
2014.05.26-2014.12.31	4.80%	0.16%	2.99%	0.00%	1.81%	0.16%
2015.01.01-2015.12.31	5.73%	0.07%	4.00%	0.01%	1.73%	0.06%
2016.01.01-2016.03.31	2.62%	0.27%	0.81%	0.01%	1.81%	0.26%
自基金合同生效起至今	13.70%	0.14%	7.97%	0.01%	5.73%	0.13%

注:本基金合同生效日为2014年5月26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0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E\times0.80\%\div$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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E\times0.25\%\div$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

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times0.25\%\div$当年天数

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提,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销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人,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;

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、基金托管费和基金销售服务费,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

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"按最新资料进行了更新。

(六)对"其他应披露的事项",披露了本期间本基金的公告信息。

中海基金管理有限公司

二〇一六年七月九日