

## 中海上证50指数增强型证券投资基金更新招募说明书摘要 (2011年第1号)

本基金基金合同于2010年3月25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2011年3月25日，有关财务数据和净值表现截止日为2010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

设立日期：2004 年 3 月 18 日

法定代表人：陈浩鸣

总经理：宋宇（代理总经理）

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

---

注册资本：1.3 亿元

联系人：夏立峰

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	46.923%
国联证券股份有限公司	37.692%
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司	15.385%

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

陈浩鸣先生，代理董事长，董事。硕士。现拟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。

储晓明先生，董事。硕士。现任申银万国证券股份有限公司总裁。历任中国工商银行评估部处长、风险管理部副总经理级干部，中海石油财务有限责任公司副总经理，中海信托股份有限公司常务副总经理、总裁（期间曾兼任中海基金管理有限公司董事长）。

成赤先生，董事。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。

张志伟先生，董事。硕士。现任国联证券股份有限公司总裁。历任无锡国联发展（集团）有限公司金融管理部经理、国联证券股份有限公司投资银行部总经理、国联证券股份有限公司副总裁。

彭焰宝先生，董事。学士。现任国联证券股份有限公司副总裁。历任国联证券交易员、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。

温天先生，董事。硕士。现任法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司执行董事、上海代表处首席代表、中国地区负责人，兼任法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司旗下注册于卢森堡的私募股权基金Orient Express China Fund的董事。历任北京、上海主流新闻媒体财经节目负责人、记者、主编，上海银行支行负责人（短期）、部门总经理，华安基金管理有限公司高级研究员、产品部门负责人、市场部门负责人和公司战略总监。

夏斌先生，独立董事。硕士，研究员，教授。现任国务院发展研究中心金融研究所所长。历任中国人民银行总行处长、副所长，中国证监会交易部主任兼信息部主任，深圳证券交易所总经理，中国人民银行非银行金融机构监管司司长。

陈瑛明先生，独立董事。硕士。现任上海市瑛明律师事务所首席合伙人。历任香港史密夫律师行法律顾问、福建江成律师事务所合伙人、上海市新闵律师事务所专职律师。

李维森先生，独立董事。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。

## 2、监事会成员

朱恩惠女士，监事长。本科。现任中海信托股份有限公司运营总监兼信托事务管理总部总经理、托管部部门经理。曾任职于中信上海信托投资公司财务部。

Humbert GARREAU de LABARRE，监事。法国国籍，硕士。现任法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司私人银行部高级副总裁。历任 Neuflyze, Schlumberger, Mallet 银行 - 荷银集团（法国巴黎）私人银行业务专业银行资产组合经理，Cie Financière 爱德蒙得洛希尔银行（法国巴黎）资产组合经理。

王红女士，职工监事。研究生。现任中海基金管理有限公司总经理助理兼北京分公司总经理。历任辽宁省针棉毛织品进出口公司储运科科员、北京

---

中盛纸业有限公司总经理助理、北京大地投资有限公司总经理助理兼市场营销部经理、湘财证券有限责任公司北京办事处主任。2007年1月进入本公司工作，历任北京管理总部副总经理、北京分公司总经理。2009年1月至今任本公司总经理助理兼北京分公司总经理。

### 3、高级管理人员

宋宇先生，副总经理、代理总经理。复旦大学学士。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，2011年1月至今任本公司代理总经理。

李延刚先生，副总经理，加拿大国籍。南京大学学士，加拿大西蒙弗雷泽大学硕士，注册金融分析师（CFA）。历任中储发展股份有限公司海外业务发展助理、业务发展经理、战略发展总监，伦敦资产管理有限公司投资顾问、基金经理。2007年7月进入本公司工作，历任投资管理部副总经理、投研中心总经理。2009年4月至今任本公司副总经理。2008年1月至2009年6月任中海能源策略混合型证券投资基金基金经理，2008年4月至2009年6月任中海分红增利混合型证券投资基金基金经理，2009年6月至今任中海量化策略股票型证券投资基金基金经理。

朱冰峰先生，督察长。华东政法学院学士。历任长江律师事务所律师、华虹（集团）有限公司法律顾问、锦天城律师事务所律师、上海证监局副处级职务。2009年10月进入本公司工作，曾任总经理助理。2010年12月至今任本公司督察长。

### 4、基金经理

陈明星先生，中国科学技术大学硕士。历任安徽省公路运输管理局职员、中科大上海研究发展中心有限公司项目经理、平安资产管理有限公司分析师。2007年10月进入本公司工作，曾任金融工程分析师兼基金经理助理，现任金融工程总监。2010年3月至今任中海上证50指数增强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3月25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
陈明星	2010年3月25日-至今

## 6、投资决策委员会成员

李延刚先生，主任委员。现任中海基金管理有限公司副总经理、基金经理。

吕晓峰先生，委员。现任中海基金管理有限公司投研中心总经理、投资总监。

骆泽斌先生，委员。现任中海基金管理有限公司研究总监。

陶林健先生，委员。现任中海基金管理有限公司投资副总监、基金经理。

杨济如女士，委员。现任中海基金管理有限公司基金经理。

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。

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 334,018,850,026 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：陈浩鸣

总经理：宋宇（代理总经理）

电话：021-68419518

传真：021-68419328

联系人：周颖

客服电话：400-888-9788 或 021-38789788

公司网址：[www.zhfund.com](http://www.zhfund.com)

###### (2) 中海基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 158 号远洋大厦 F218

电话：010-66493583

传真：010-66425292

联系人：邹意

客户服务电话：400-888-9788

公司网站：[www.zhfund.com](http://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：010-66107914

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：项俊波

联系人：滕涛

传真：010-85109219

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

（3）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：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

公司网址：www.bankcomm.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：郭树清

联系电话：010-67596093

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：傅育宁

传真：0755-83195049

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

公司网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(6) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

客户服务电话：95558

公司网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.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：010-57092615

传真：010-57092611

联系人：董云巍

客户服务电话：95568

公司网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(8) 深圳发展银行股份有限公司

住所：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

联系电话：0755-82088888

传真电话：0755-82080714

联系人：张青



---

客户服务电话：95501

公司网址：[www.sdb.com.cn](http://www.sdb.com.cn)

（9）上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 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：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：倪苏云、虞谷云

客户服务电话：95528

公司网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

（10）温州银行股份有限公司

住所：温州市车站大道华海广场 1 号楼

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：0577-96699

公司网址：[www.wzbank.cn](http://www.wzbank.cn)

（11）国联证券股份有限公司

住所：无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市县前东街 168 号

法定代表人：雷建辉

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：徐欣

客户服务电话：0510-82588168

---

公司网址：[www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

(12) 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](http://www.95579.com)

(13) 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](http://www.htsec.com)

(14) 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：顾伟国

电话：010-66568047

传真：010-66568536

联系人：李洋

客户服务电话：4008-888-888

公司网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

---

(15) 中信建投证券有限责任公司

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：张佑君

联系人：权唐

开放式基金咨询电话：400-888-8108

开放式基金业务传真：010-65182261

公司网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(16) 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](http://www.gtja.com)

(17) 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：丁国荣

电话：021-54033888

联系人：李清怡

客户服务电话：021-962505

公司网址：[www.sw2000.com.cn](http://www.sw2000.com.cn)

(18) 广发证券股份有限公司

住所：广东广州天河北路大都会广场 43 楼

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 36、38、41 和 42 楼

---

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888

传真：020-87555305

联系人：黄岚

客户服务电话：95575

公司网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

（19）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](http://www.xcsc.com)

（20）兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

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：021-38565783

联系人：谢高得

客户服务电话：400-8888-123

公司网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

（21）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： 025-84457777

传真： 025-84579763

联系人： 万鸣

客户服务电话： 95597

公司网址： [www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

（22）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：王益民

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](http://www.dfzq.com.cn)

（23）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](http://www.dwzq.com.cn)

（24）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.com.cn](http://www.jyzq.com.cn)

（25）东海证券有限责任公司

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：李涛

客户服务电话：400-888-8588

公司网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

（26）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](http://www.newone.com.cn)

（27）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：唐新宇

电话：021-68604866

---

传真：021-50372474

联系人：张静

客户服务电话：400-620-8888

公司网址：www.bocichina.com

（28）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：400-881-6168

公司网址：www.pingan.com

（29）华泰联合证券有限责任公司

住所：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层

法定代表人：马昭明

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

联系人：盛宗凌、庞晓芸

客户服务电话：95513

公司网址：www.lhzq.com

（30）西南证券股份有限公司

住所：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 座 22-25 层

法定代表人：王珠林

电话：023-63786922

---

传真：023-63786215

联系人：陈诚

客户服务电话：400-8096-096

公司网址：www.swsc.com.cn

（31）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

（32）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：徐浩明

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

客户服务电话：400-888-8788 或 10108998

公司网址：www.ebscn.com

（33）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：0931-4890100

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

（34）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

（35）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

（36）第一创业证券有限责任公司

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

(37) 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

(38) 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：010-88085338

传真：010-88085240

客户服务电话：4008-000-562

公司网址：www.hysec.com

(39) 中国建银投资证券有限责任公司

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 层至 21 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 18 层至 21 层

法定代表人：杨明辉

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

联系人：刘毅

---

客户服务电话：400-600-8008

公司网址：www.cjis.cn

（40）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

（41）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

（42）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

（43）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

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

（44）中信证券股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

法定代表人：王东明

联系电话：010-84683343

传真：010-84865560

联系人：张于爱

公司网址：www.cs.ecitic.com

（45）方正证券有限责任公司

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

（46）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

法定代表人：矫正中

联系人：潘锴

电话：0431-85096709

客户服务电话：4006000686

公司网址：www.nesc.cn

---

(47) 广发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、8、10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

联系电话：0591-87841160

传 真：0591-87841150

客户服务电话：0591-96326

公司网址：www.gfhfzq.com.cn

(48) 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：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

客户服务电话：400-8888-993

公司网址：www.dxzq.net.cn

(49) 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：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

电话：010-66045446

传真：010-66045500

联系人：潘鸿

客户服务电话：010-66045678

公司网址：www.txsec.com

(50) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

---

法定代表人： 陈林  
联系人： 陈康菲  
电话： 021-50122485  
传真： 021-50122200  
客服电话： 021-38929908  
网址： www.cnhbstock.com

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： 陈浩鸣  
总经理： 宋宇（代理总经理）  
成立日期： 2004 年 3 月 18 日  
电话： 021-38429808  
传真： 021-68419328  
联系人： 曹伟

## (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：秦悦民、王利民

(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有限公司

住所：无锡市新区开发区旺庄路生活区

办公地址：无锡市梁溪路 28 号

法定代表人：张彩斌

电话：0510-85888988 85887801

传真：0510-85885275

经办注册会计师：沈岩、华可天

---

#### 四、基金名称

中海上证 50 指数增强型证券投资基金

#### 五、基金的类型

股票型证券投资基金

#### 六、基金的投资目标

本基金为股票指数增强型基金，在被动跟踪标的指数的基础上，加入增强型的积极手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%。在控制基金组合跟踪误差的前提下力争取得高于业绩基准的稳定收益，追求长期的资本增值。

#### 七、基金的投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括上证 50 指数成份股及其备选成份股、新股、债券，以及中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种（如股指期货等），基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于上证 50 指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，现金或者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、基金的投资理念

采用增强型指数化投资的理念，以跟踪上证 50 指数为主，辅以适度增强的投资以追求对标的指数的适当超越，使投资者充分分享中国经济增长所带来的良好收益。

#### 九、基金的投资策略

本基金将采用“指数化投资为主、主动增强投资为辅”的投资策略，在



---

完全复制标的指数的基础上有限度地调整个股，从而最大限度降低由于交易成本等因素造成的股票投资组合相对于标的指数的偏离，并力求投资收益能够有效跟踪并适度超越标的指数。

### 1、资产配置策略

为实现有效跟踪标的指数并力争超越标的指数的投资目标，本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于上证 50 指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%。本基金将采用完全复制为主，增强投资为辅的方式，按标的指数的成份股权重构建被动组合，同时辅以主动增强投资，对基金投资组合进行适当调整，力争本基金投资目标的实现。

### 2、股票投资策略

本基金被动投资组合采用完全复制方法进行构建，对于法律法规规定不能投资的股票将选择其它品种予以替代。主动投资主要采用自上而下与自下而上相结合的方法，依据宏微观研究与个股研究，在上证 50 指数中配置有正超额收益预期的成份股；同时，根据研究员的研究成果，适当的选择部分上证 50 指数成份股以外的股票作为增强股票库，构建主动型投资组合。

#### （1）指数化投资

本基金指数化投资部分不低于基金资产的 80%，主要采用完全复制标的指数的被动投资策略，按照成份股在标的指数中的基准权重来被动构建股票投资组合，从而有效跟踪标的指数，控制跟踪误差。

#### （2）主动增强投资

在指数化投资过程中，由于交易成本的存在，完全复制的被动投资策略可能很难有效跟踪标的指数。因此，本基金将采用适度的主动性投资策略对指数化投资进行修正，以求降低由于交易成本等因素导致的对标的指数跟踪的影响，并力争适度超越标的指数，获取超额收益。主动增强投资部分不超过基金资产的 15%。

#### 1) 在成份股内进行适度增强

---

本基金将在充分进行宏微观经济研究与个股深度研究的基础上，结合自上而下与自下而上两种策略对成份股进行多维度的深度研究，在综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后，将适度地配置价值低估或者成长性良好的蕴含正超额收益预期的成份股。

## 2) 对非成份股进行适度增强

本基金将基于投研团队充分的调研与全面的研究论证，进行以下三种具体操作：

a.合理替代部分流动性缺失的成份股。标的指数部分成份股可能因为长期停牌、被列入本公司禁止投资股票以及交易量不足等因素，使得本基金无法依照标的指数权重购买成份股。因此，本基金管理人将在综合考虑跟踪偏离度、跟踪误差和投资者利益的基础上，决定是否买入相关的替代性股票。本基金将首选与该成份股行业属性一致、相关性高的其他成份股进行替代；若成份股中没有符合要求的替代品种，本基金将在成份股之外选择行业属性一致、相关性高且基本面优良的股票作为替代品种。

b.前瞻性纳入部分备选成份股。如果预期标的指数的成份股将会发生调整，本基金管理人将在综合考虑跟踪偏离度、跟踪误差和投资者利益的基础上，决定是否提前纳入部分备选成份股。

c.精选部分蕴含投资价值的非成份股。本基金管理人将采用数量化分析与基本面判断相结合的研究方法，在综合考虑跟踪偏离度、跟踪误差和投资者利益的基础上，决定适度买入部分具有增长潜力、蕴含投资价值的非成份股。

此外，本基金还将积极把握一级市场的新股申购与增发的盈利机会，以求提高资金运用效率。

## 3、债券投资策略

本基金将根据国际与国内宏微观经济形势、债券市场资金状况以及市场利率走势来预测债券市场利率变化趋势，并对各债券品种收益率、流动性、信用风险和久期等进行综合分析，评定各债券品种的投资价值，同时着重考

---

考虑基金的流动性管理需要，主要选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。

#### 4、投资组合调整策略

##### （1）投资组合调整原则

本基金为指数增强型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等因素，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与业绩比较基准的跟踪偏离度和跟踪误差最优化。

##### （2）投资组合调整方法

###### 1) 对标的指数的跟踪调整

本基金所构建的指数化投资组合将根据上证 50 指数成份股的调整而进行相应的跟踪调整。

###### 定期调整

根据上证 50 指数成份股定期调整结果，基于本基金的投资组合调整原则，对投资组合进行相应调整。

###### 不定期调整

当上证 50 指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据上证 50 指数临时调整公告，基于本基金的投资组合调整原则，对投资组合进行相应调整。

###### 2) 限制性调整

###### 投资比例限制调整

根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定，当基金投资组合中按基准权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时，本基金将对其进行实时的被动性卖出调整，并相应地对其他资产类别或个股进行微调，以保证基金合法规范运行。

###### 大额赎回调整

---

当发生大额赎回超过现金保有比例时，本基金将对股票投资组合进行同比例的被动性卖出调整，以保证基金正常运行。

## 十、基金的投资决策依据和决策程序

### 1、投资决策依据：

- (1) 国家有关法律、法规和本基金基金合同等的相关规定；
- (2) 宏微观经济运行趋势和证券市场走势；
- (3) 标的指数的编制方法及其变更。

### 2、投资决策流程：

本基金投资决策流程主要包括：

- 投资决策委员会决定大类资产配置比例范围：投资决策委员会依据研究部策略分析师和投资决策委员会成员讨论后形成的一致意见，决定大类资产配置的范围。
- 基金经理依据投资决策委员会决议决定指数复制部分、增强投资部分和债券投资部分的投资策略和投资计划：中海上证50指数增强型证券投资基金基金经理根据其本人对宏微观经济和大势的判断，在投资决策委员会决定的大类资产配置范围内，决定本基金的大类资产配置比例。
- 投资操作性方案的制定：基金经理依据金融工程部的数量化选股结合投研研究成果以及金融工程部提出的跟踪误差控制方案，决定指数复制部分、增强投资部分和债券投资部分的具体操作性方案。
- 合规性检查：基金经理的投资操作在日常工作中接受实时的合规性检查。
- 投资操作性方案的执行：基金经理在决定本基金的投资操作性方案后，在日常工作中进行下单交易。
- 风险实时监控：交易过程受风险控制部实时监控。
- 基金事务部清算：基金事务部负责基金的清算。

绩效评估与跟踪误差控制：金融工程部定期对本基金进行绩效评估和跟

---

踪误差计算，并分析跟踪误差产生的原因，当跟踪误差超过约定数值时，金融工程部提供降低跟踪误差的建议。

## 十一、基金的投资限制

1、本基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%。

(2) 本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%。

(3) 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%。

(4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，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%，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%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定。

(5) 现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

(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) 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) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

(10) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定。

(11) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金投资不受上述限制。

---

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规、监管部门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。

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，但法律法规另有规定的除外。

(5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券。

(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、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动。

(8) 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。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，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：

上证50指数×95%+一年期银行定期存款利率（税后）×5%。

如果基金所跟踪的标的指数被中证指数有限公司停止发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为标的指数，

或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人在履行适当程序后，可以变更基金的跟踪目标和投资对象，并在变更前提前2 个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

### 十三、基金的风险收益特征

本基金属指数增强型证券投资基金，为证券投资基金中的较高风险较高预期收益品种。

### 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。基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2011年4月18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2010年12月31日报告期末的第四季度报告数据，其中所列财务数据未经审计。

#### 1、基金资产组合情况

截至2010年12月31日，中海上证50指数增强型证券投资基金资产净值为404,406,871.91元，基金份额净值为0.857元，累计基金份额净值为0.857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	373,468,107.67	89.89
	其中：股票	373,468,107.67	89.89
2	固定收益投资	2,978,290.40	0.72
	其中：债券	2,978,290.40	0.72
	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	37,903,494.02	9.12
6	其他资产	1,131,850.23	0.27
7	合计	415,481,742.32	100.00

## 2、 期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	18,469,201.36	4.57
C0	食品、饮料	2,161,684.00	0.53
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	428,652.00	0.11
C5	电子	8,038,256.00	1.99
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	3,042,847.36	0.75
C8	医药、生物制品	4,797,762.00	1.19
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	16,593,511.50	4.10
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-



J	房地产业	1,098,720.00	0.27
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	36,161,432.86	8.94

(2) 指数投资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	55,871,221.33	13.82
C	制造业	43,910,579.48	10.86
C0	食品、饮料	9,876,687.92	2.44
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	15,749,731.06	3.89
C7	机械、设备、仪表	18,284,160.50	4.52
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	10,464,808.39	2.59
E	建筑业	15,595,404.17	3.86
F	交通运输、仓储业	13,017,530.72	3.22
G	信息技术业	6,611,824.25	1.63
H	批发和零售贸易	4,265,353.44	1.05
I	金融、保险业	179,701,283.51	44.44

J	房地产业	7,868,669.52	1.95
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	337,306,674.81	83.41

### 3、 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1) 期末指数投资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

金额单位：人民币元

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	601318	中国平安	505,798	28,405,615.68	7.02
2	600036	招商银行	1,861,762	23,849,171.22	5.90
3	601328	交通银行	3,093,924	16,954,703.52	4.19
4	600016	民生银行	3,300,452	16,568,269.04	4.10
5	601166	兴业银行	625,958	15,054,289.90	3.72
6	600000	浦发银行	1,059,088	13,122,100.32	3.24
7	600030	中信证券	1,019,859	12,840,024.81	3.18
8	601088	中国神华	496,655	12,272,345.05	3.03
9	601601	中国太保	504,080	11,543,432.00	2.85
10	600519	贵州茅台	53,701	9,876,687.92	2.44

(2) 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

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	600502	安徽水利	1,229,149	16,593,511.50	4.10
2	002038	双鹭药业	81,318	4,797,762.00	1.19
3	002106	莱宝高科	61,400	4,067,750.00	1.01

4	300111	向日葵	165,300	3,970,506.00	0.98
5	300124	汇川技术	17,600	2,461,888.00	0.61

#### 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	2,978,290.40	0.74
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	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	2,978,290.40	0.74

#### 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	010112	21国债(12)	29,570	2,978,290.40	0.74

#### 6、报告期末按公允价值占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权证投资  
明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、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) 其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	965,534.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,383.06
5	应收申购款	146,932.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,131,850.23

(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) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(6) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

(7) 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2010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	①-③	②-④
过去3个月	4.77%	1.65%	3.27%	1.69%	1.50%	-0.04%
过去6个月	10.15%	1.44%	8.39%	1.44%	1.76%	0.00%
自基金合同 生效起至今	-14.30%	1.47%	-12.90%	1.54%	-1.40%	-0.07%

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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。
  - 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费。
  - 5、基金份额持有人大会费用。
  - 6、基金的证券交易费用。
  - 7、基金的银行汇划费用。
  - 8、基金的指数使用费。
  - 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 0.85% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.85\% \div \text{当年天数}$$

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 0.17% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.17\% \div \text{当年天数}$$

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、 基金的指数使用费

本基金作为指数基金, 需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下, 指数使用费按前一日基金资产净值的 0.016%的年费率计提, 且收取下限为每季度(包括基金成立当季)人民币 5 万元。该下限超出正常指数使用基点费的部分(即: 每季指数许可使用基点费下限-该季指数许可使用基点费)由基金管理人自行承担, 不得作为基金费用从基金财产中列支。计算方法如下:

$$H=E \times 0.016\% / \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计算, 逐日累计。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令, 经基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

上述一、基金费用的种类中第 3-8 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费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施前按照《信息披露办法》在指定媒体上公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 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“基金管理人概况”以及“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“基金业绩”按最新资料进行了更新。

（六）对“对基金份额持有人的服务”部分进行了更新。

（七）在“其他应披露事项”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

二〇一一年五月六日