中海基金管理有限公司关于旗下三十只基金修订基金合同及托管协议的公告

鉴于中国证券监督管理委员会已于 2019 年 7 月 26 日发布了《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(证监会令【第 158 号】,以下简称“《信息披露办法》”),且该《信息披露办法》已于 2019 年 9 月 1 日起施行。故在 2019 年 9 月 1 日之前成立的产品法律文件的相关条款已不符合《信息披露办法》的规定,需要根据上述法规修改。现将主要修订情况公告如下(具体修订详见附件《中海基金管理有限公司旗下三十只基金基金合同和托管协议修订对照表》):

一、修订依据及修订基金范围

基金管理人根据《信息披露办法》对旗下三十只存量基金的基金合同(以下简称“存量基金合同”)进行修订。具体基金明细如下:

序号	产品代码	产品名称
1	398021	中海能源策略混合型证券投资基金
2	395001	中海稳健收益债券型证券投资基金
3	398041	中海量化策略混合型证券投资基金
4	399001	中海上证 50 指数增强型证券投资基金
5	392001	中海货币市场证券投资基金
6	398051	中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金
7	395011	中海增强收益债券型证券投资基金
8	399011	中海医疗保健主题股票型证券投资基金
9	000298	中海纯债债券型证券投资基金
10	001279	中海积极增利灵活配置混合型证券投资基金
11	393001	中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金
12	398011	中海分红增利混合型证券投资基金
13	398031	中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金
14	398061	中海消费主题精选混合型证券投资基金
15	000003	中海可转换债券债券型证券投资基金
16	000597	中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金
17	001574	中海混改红利主题精选灵活配置混合型证券投资基金
18	002214	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金
19	001864	中海魅力长三角灵活配置混合型证券投资基金
20	004219	中海添顺定期开放混合型证券投资基金
21	398001	中海优质成长证券投资基金
22	000316	中海瑞利六个月定期开放债券型证券投资基金
23	002213	中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金
24	163907	中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金(LOF)
25	000878	中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金
26	000166	中海信息产业精选混合型证券投资基金
27	001252	中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金
28	002965	中海合嘉增强收益债券型证券投资基金
29	005252	中海添瑞定期开放混合型证券投资基金
30	005646	中海沪港深多策略灵活配置混合型证券投资基金

二、基金合同修订情况

由于基金类别、运作方式等不同,各基金基金合同修订内容、具体表述等可能存在差异,本公告正文列示的基金合同修订内容并不特别加以区分,各基金基金合同具体修订详见附件。

(一)将存量基金合同中的公募基金信息披露法律法规名称修订为《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》。

(二)由于《信息披露办法》新增“基金产品资料概要”为公开披露的基金信息,相应在基金合同中增加“基金产品资料概要”释义及相关披露要求。关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容,将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

(三)由于《信息披露办法》对招募说明书的更新要求进行了调整,即招募说明书的信息发生重大变更的,基金管理人应当在 3 个工作日内进行更新,其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次,基金合同终止的,基金管理人可以不再更新基金招募说明书。基于此,相应修订存量基金合同中“招募说明书”释义及相关披露要求。

(四)由于《信息披露办法》取消部分信息披露文件的备案,相应修订存量基金合同中有关“信息披露文件备案”的描述。

(五)由于《信息披露办法》取消开放式基金基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前披露基金资产净值,以及半年度和年度末披露基金资产净值的要求,相应修订存量基金合同中有关“基金净值披露”的描述。

(六)由于《信息披露办法》将“基金半年度报告”名称调整为“基金中期报告”,相应修订存量基金合同中有关描述。

(七)按照《信息披露办法》对存量基金合同“基金的信息披露”章节进行整体修订,主要修订内容如下(本处以普通开放式基金修订内容为例,与货币基金、定期开放式基金等不同类别或运作方式的基金在具体修订内容上存在差异。各基金基金合同具体修订详见附件):

1、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

2、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人及其日常机构等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点,按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)及指定互联网网站(以下简称“指定网站”)等媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

3、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

(1)虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;

(2)对证券投资业绩进行预测;

(3)违规承诺收益或者承担损失;

(4)诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;

(5)登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;

(6)中国证监会禁止的其他行为。

4、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的,以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

5、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

(1)基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

1)《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系,明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序,说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2)基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后,基金招募说明书的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书并登载在指定网站上;基金招募说明书其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金招募说明书。

3)基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4)基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件,用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后,基金产品资料概要的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金产品资料概要,并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点;基金产品资料概要其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金产品资料概要。

基金募集申请经中国证监会注册后,基金管理人在基金份额发售的 3 日前,将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上;基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

(2)基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

(3)《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

(4)基金净值信息

《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

(5)基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

(6)基金定期报告,包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告登载在指定网站上,并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成基金中期报告,将中期报告登载在指定网站上,并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告登载在指定网站上,并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《基金合同》生效不足 2 个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情形,为保障其他投资者利益,基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险。

本基金持续运作过程中,应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

(7)临时报告

本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书,并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件,是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件:

1)基金份额持有人大会的召开及决定的事项;

2)《基金合同》终止、基金清算;

3)转换基金运作方式、基金合并;

4)更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构,基金改聘会计师事务所;

5)基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项,基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项;

6)基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;

7)基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更;

8)基金募集期延长;

9)基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动;

10)基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十,基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十;

11)涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁;

12)基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚,基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚;

13)基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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,或者从事其他重大关联交易事项,但中国证监会另有规定的除外;

14)基金收益分配事项;

15)管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;

16)基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五;

17)本基金开始办理申购、赎回;

18)本基金发生巨额赎回并延期办理;

19)本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项;

20)本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请;

21)本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;

22)基金管理人采用摆动定价机制进行估值;

23)基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

(8)澄清公告

在《基金合同》存续期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动,以及可能损害基金份额持有人权益的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。

(9)清算报告

基金合同终止的,基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

(10)基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会备案,并予以公告。

(11)投资于中小企业私募债券的信息

1)基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后 2 个交易日内,在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。

2)基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

(12)中国证监会规定的其他信息。

6、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度,指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息,应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息,并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外,还可以根据需要在其他公共媒介披露信息,但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息,并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构,应当制作工作底稿,并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

7、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后,基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所,供社会公众查阅、复制。

8、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

(八)对各基金基金合同的“基金合同当事人及权利义务”、“基金份额的申购与赎回”、“基金资产估值”、“基金的会计与审计”、“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”等章节涉及上述修改的内容进行一并调整。

本次法律文件的修改系因相应的法律法规发生变动而进行,不涉及基金份额持有人权利义务关系的变化,对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响,且基金管理人已履行适当程序。

基金管理人根据《信息披露办法》的规定,对各基金托管协议、招募说明书中涉及上述修改的内容也进行了相应更新。

投资者可登录基金管理人网站(www.zhfund.com)和中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)查阅各基金修订后的基金合同、托管协议及招募说明书(更新)。

风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。敬请投资者注意投资风险。投资者办理基金交易等相关业务前,应仔细阅读各基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

投资者可拨打本公司的客户服务电话 400-888-9788(全国统一,免长途话费)咨询相关情况。

特此公告。

中海基金管理有限公司

2020 年 7 月 4 日

(上接 C35 版)

联系人:李丹

电话:4000988511/ 4000888816

传真:010-89189566

客服电话:95118

网址:http://kenterui.jd.com

(81)上海朝阳永续基金销售有限公司

住所:浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室

办公地址:上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼

法定代表人:廖冰

联系人:郑秋月

联系电话:021-802348888-6694

传真:021-80234898

客服电话:4006991888

公司网址:www.998fund.com

(82)中证金牛(北京)投资咨询有限公司

住所:北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人:钱昊旻

联系人:徐英

电话:010-59336539

传真:010-59336500

客服电话:4008-909-998

(83)上海华夏财富投资管理有限公司

住所:上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址:北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人:毛淮平

联系人:仲秋玥

电话:010-88066632

传真:010-63136184

客服电话:400-817-5666

网址:www.amcfortune.com

(84)武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第七幢 23 层 1 号 4 号

办公地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第七幢 23 层 1 号 4 号

法定代表人:陶捷

联系人:陆锋

客户服务电话:4000279899

公司网址:www.buyfunds.cn

(85)和耕传承基金销售有限公司

住所:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层

办公地址:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层

法定代表人:李淑慧

联系人:罗聪

客户服务电话:0371-85518396

公司网址:www.hgccpb.com

(86)徽商期货有限责任公司

住所:安徽省合肥市芜湖路 258 号 3 号楼 4、6、7 层,6 号楼 1、2 层

办公地址:安徽省合肥市芜湖路 258 号 3 号楼 4、6、7 层,6 号楼 1、2 层

法定代表人:吴国华

联系人:申倩倩

客户服务电话:4008878707

公司网址:www.hsqh.net

(87)北京微动利基金销售有限公司

住所:北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

办公地址:北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人:季长军

联系人:何鹏

客户服务电话:400-819-6665

公司网址:www.buyforyou.com.cn

(88)上海挖财基金销售有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人:冷飞

联系人:李娟

联系电话:021-50810687

客服电话:021-50810673

公司网址:www.wacaijijin.com

(89)上海大智慧基金销售有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

法定代表人:申健

联系人:宋楠

联系电话:021-20219988

客服电话:021-20292031

网址:https://www.wg.com.cn/

(90)北京加和基金销售有限公司

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

(91)北京晟视天下基金销售有限公司

注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21 层&28 层

法定代表人:蒋煜

联系人:刘聪慧/徐晓荣

电话:010-58170905/010-58170876

传真:010-58100800

客户服务电话:400-818-8866

网址:www.shengshiview.com.cn

(92)北京格上富信基金销售有限公司

住所:北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址:北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人:李悦章

联系人:曹庆展

客户服务电话:400-066-8586

公司网址:www.igesafe.com

(93)北京电盈基金销售有限公司

住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室

办公地址:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室

法定代表人:程刚

联系人:赵立芳

客户服务电话:400-100-3391

公司网址:http://www.dianyingfund.com/

(94)万家财富基金销售(天津)有限公司

住所:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址:北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人:李修辞

联系人:邵玉磊

客户服务电话:010-59013825

公司网址:http://www.wanjiawealth.com/

(95)深圳前海财厚基金销售有限公司

住所:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址:广东省深圳市南山区高新南十道深圳湾科技生态园三区 11 栋 A 座 3608 室

法定代表人:杨艳平

联系人:胡闻智

客户服务电话:400-128-6800

公司网址:www.caiho.cn

(96)东方财富证券股份有限公司

住所:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址:上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人:陈宏

联系人:付佳

联系电话:021-23586603

客服电话:95357

公司网址:http://www.18.cn

(97)北京百度百盈基金销售有限公司

住所:北京市海淀区上地十街 10 号百度大厦

办公地址:北京市海淀区上地信息路甲 9 号奎科科技大厦

法定代表人:张旭阳

联 系 人:孙博超

电 话:010-61952703

客服电话: 95055-4

公司网址: www.baiyingfund.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代理销售本基金,并及时公告。

(二)登记机构

名称:中海基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路 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:杨皓鹏

总经理:杨皓鹏

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:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址:北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人:毛鞍宁

联系电话:010-58153000

传真:010-58153000

联系人:徐艳

经办会计师:徐艳、蔺育化

四、基金的名称

中海纯债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

在严格控制投资风险的基础上,追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。

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固定收益类金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、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、超级短期融资券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、次级债券、可分离交易可转债的纯债部分、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相关规定)。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证和可转换债券等,也不参与一级市场新股申购、新股增发和可转换债券申购,但可分离交易可转债的纯债部分除外。

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:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%,现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

八、基金的投资策略

本基金在综合判断宏观经济周期、货币及财政政策方向、市场资金供需状况、各类固定收益类资产估值水平对比的基础上,结合收益率水平曲线形态分析和类属资产相对估值分析,优化债券组合的期限结构和类属配置;在符合本基金相关投资比例规定的前提下,在严谨深入的信用分析基础上,综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,精选预期风险可控、收益率较高的债券,以获取较高的债券组合投资收益。

1、资产配置策略

(1)久期配置

本基金根据对市场利率变动趋势的预测,相应调整债券组合的久期配置,以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。当预期收益率曲线下移时,适当提高组合久期,以分享债券市场上涨的收益;当预期收益率曲线上移时,适当降低组合久期,以规避债券市场下跌的风险。

(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。

(3)债券类属配置策略

本基金通过对不同类型固定收益金融工具的收益率、流动性、税赋水平、信用风险和风险溢价、回售以及市场偏好等因素的综合评估,研究各类型投资品种的利差和变化趋势,制定债券类属配置策略,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

2、信用品种投资策略

本基金将重点投资于企业债、公司债、金融债、地方政府债、短期融资券、中期票据、可分离交易可转债的纯债部分及资产支持证券等信用债券,以提高组合的收益水平。

本基金将在内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下,运用行业研究方法和公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,精选预期风险可控、收益率较高的债券,结合适度分散的行业配置策略,构造和优化债券投资组合,为投资人获取较高的投资收益。

(1)信用类债券的个券选择及行业配置

1)根据宏观经济环境及各行业的发展状况,确定各行业的优先配置顺序;

2)研究债券发行人的产业发展趋势、行业政策、公司背景、盈利状况、竞争地位、治理结构、特殊事件风险等基本面信息,分析企业的长期运作风险;

3)运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、现金流水平等方面进行综合评价,度量发行人财务风险;

4)利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息,估算债券发行人的违约率及违约损失率;

5)综合发行人各方面分析结果,确定信用利差的合理水平,利用市场的相对失衡,选择溢价偏高的品种进行投资。

(2)杠杆放大策略

杠杆放大操作即以组合现有债券为基础,利用买断式回购、质押式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。

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基于信用品种投资策略,在此基础上重点分析中小企业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,研究中小企业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,对中小企业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,结合中小企业私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素,综合评价中小企业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。针对流动性风险,本基金在控制信用风险的基础上,对中小企业私募债投资,主要采取分散投资,控制个债持有比例。

4、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上,对资产证券化产品的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析,评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。

九、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)本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%;

(2)保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3)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%;

(4)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%;

(5)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%;

(6)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%;

(7)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%;

(8)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;

(9)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%;

(10)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%;

(11)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%;

(12)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(13)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(14)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(8)、(12)、(13)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

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

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)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)法律法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中证全债指数。

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

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则,在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后,适当调整业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十一、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较低风险品种,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。

十二、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 2020 年 3 月 31 日报告期末的一季报数据。

1、基金资产组合情况

截至 2020 年 3 月 31 日,中海纯债债券型证券投资基金 A 类资产净值为 1,804,876.82 元,基金份额净值为 1.124 元,累计基金份额净值为 1.264 元;C 类资产净值为 25,319,173.33 元,基金份额净值为 1.100 元,累计基金份额净值为 1.240 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,458,450.30	96.24
	其中:债券	30,458,450.30	96.24
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	138,221.56	0.44
8	其他资产	1,052,544.04	3.33
9	合计	31,649,215.90	100.00

2、期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

3、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

本基金本报告期末未持有股票。

4、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	25,489,546.20	93.97
	其中:政策性金融债	25,489,546.20	93.97
4	企业债券	4,968,904.10	18.32
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,458,450.30	112.29

5、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	018008	国开 1802	226,920	23,753,985.60	87.58
2	1480124	14 鸠江建投债	50,000	2,087,000.00	7.69
3	1580079	15 沪闵行债	30,000	1,866,900.00	6.88
4	108602	国开 1704	17,340	1,735,560.60	6.40
5	122866	10 杭交投	10,000	1,014,800.00	3.74

6、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、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.1 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。

9.2 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。

9.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

10、投资组合报告附注

10.1 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。

10.2 本基金为纯债基金,不进行股票投资。

10.3 截至 2020 年 3 月 31 日,本基金的其他资产项目构成如下:

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,595.61
2	应收证券清算款	99,823.29
3	应收股利	-
4	应收利息	875,319.86
5	应收申购款	72,805.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,052,544.04

10.4 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。

10.5 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。

10.6 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。

十三、基金的业绩

本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。基金业绩数据截至 2020 年 3 月 31 日。

基金 A 类本期净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2014.04.23-2014.12.31	5.70%	0.20%	7.23%	0.10%	-1.53%	0.10%
2015.01.01-2015.12.31	8.33%	0.14%	8.74%	0.08%	-0.41%	0.06%
2016.01.01-2016.12.31	-1.96%	0.21%	2.00%	0.09%	-3.96%	0.12%
2017.01.01-2017.12.31	1.62%	0.09%	-0.34%	0.06%	1.96%	0.03%
2018.01.01-2018.12.31	5.89%	0.07%	8.85%	0.07%	-2.96%	0.00%
2019.01.01-2019.12.31	4.05%	0.06%	4.96%	0.05%	-0.91%	0.01%
2020.1.1-2020.3.31	1.81%	0.12%	2.92%	0.11%	-1.11%	0.01%
自基金合同生效起至今	27.96%	0.14%	39.36%	0.08%	-11.40%	0.06%

基金 C 类本期净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2014.04.23-2014.12.31	5.30%	0.20%	7.23%	0.10%	-1.93%	0.10%
2015.01.01-2015.12.31	8.07%	0.14%	8.74%	0.08%	-0.67%	0.06%
2016.01.01-2016.12.31	-2.26%	0.21%	2.00%	0.09%	-4.26%	0.12%
2017.01.01-2017.12.31	1.33%	0.09%	-0.34%	0.06%	1.67%	0.03%
2018.01.01-2018.12.31	5.56%	0.07%	8.85%	0.07%	-3.29%	0.00%
2019.01.01-2019.12.31	3.64%	0.06%	4.96%	0.05%	-1.32%	0.01%
2020.1.1-2020.3.31	1.66%	0.11%	2.92%	0.11%	-1.26%	0.00%
自基金合同生效起至今	25.35%	0.14%	39.36%	0.08%	-14.01%	0.06%

十四、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 0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.70 %÷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 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.20%÷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 A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%,销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.4%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.40%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额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介上刊登公告。

(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。

十五、对招募说明书更新部分的说明

(一) 在“重要提示”部分,对相关内容进行补充。

(二) 在“绪言”部分,对相关法律法规的名称进行了更新。

(三) 在“释义”部分,对相关释义进行了补充和更新。

(四) 在“基金管理人”部分,对“基金管理人的职责”的相关内容进行了更新。

(五) 在“基金份额的申购和赎回”部分,对“申购与赎回场所”、“申购与赎回的开放日及时间”、“申购与赎回的原则”、“申购与赎回的数额限制”、“申购费用和赎回费用”、“拒绝或暂停申购的情形”、“巨额赎回的情形及处理方式”、“暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告”的相关内容进行了更新。

(六) 在“基金的收益分配”部分,对“收益分配方案的确定、公告与实施”的相关内容进行了更新。

(七) 在“基金的费用与税收”部分,对“基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整”的相关内容进行了更新。

(八) 在“基金的会计与审计”部分,对“基金的年度审计”的相关内容进行了更新。

(九) 在“基金的信息披露”部分,对“信息披露义务人”、“本基金信息披露义务人信息披露承诺”、“本基金公开披露的信息应采用中文文本”、“公开披露的基金信息”、“信息披露事务管理”、“信息披露文件的存放与查阅”的相关内容进行了更新。

(十) 在“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”部分,对“基金合同的变更”、“基金财产的清算”的相关内容进行了更新。

(十一)在“基金合同的内容摘要”部分按最新《中海纯债债券型证券投资基金基金合同》进行了更新。

(十二)在“基金托管协议的内容摘要”部分按最新《中海纯债债券型证券投资基金托管协议》进行了更新。

(十三)在“其他应披露的事项”中,披露了本期间本基金的公告信息。

中海基金管理有限公司

二〇二〇年七月四日