(上接C37版)

联系电话：020-89629099
传真：020-89629011
客服电话：020-89629066
公司网址：www.yingmi.cn
（83）奕丰基金销售有限公司
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道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人：TEO WEE HOWE
联系人：叶健
联系电话：0755-89460500
传真：0755-21674453
客服电话：400-684-0500
公司网址：www.ifastps.com.cn
（84）安粮期货股份有限公司
住所：安徽省合肥市包河区芜湖路168号同济大厦10-11层
办公地址：安徽省合肥市包河区芜湖路168号同济大厦10-11层（总部）
法定代表人：朱中文
联系人：梁蕾
联系电话：0551-62870125
传真：0551-62870131
客服电话：400 626 9988
公司网址：http://www.alqh.com/
（85）上海联泰基金销售有限公司
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
（86）北京钱景基金销售有限公司
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：陈剑炜
联系电话：010-57418813?
客服电话：400-893-6885
公司网址：www.qianjing.com
（87）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：翟文
客户服务电话：4008188000
公司网址：www.myfund.com
（88）深圳市金斧子基金销售有限公司
住所：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108
办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108
法定代表人：赖任军
电话：0755-29330513
传真：0755-26920530
联系人：刘昕霞
客户服务电话：400-930-0660
公司网址：www.jfzinv.com
（89）北京广源达信基金销售有限公司
住所：北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼浦项中心B座19层
法定代表人：齐剑辉
电话：4006236060
传真：010-82055860
联系人：王英俊
客户服务电话：400-623-6060
公司网址：www.niuniufund.com
（90）上海中正达广基金销售有限公司
住所：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
法定代表人：黄欣
电话：021-33768132
传真：021-33768132-802
联系人：戴珉微
客户服务电话：4006767523
公司网址：www.zhongzhengfund.com
（91）乾道盈泰基金销售(北京)有限公司
办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
住所：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
法定代表人：王兴吉
联系人：高雪超
联系电话：18601207732
传真：010-82057741
客服电话：4000888080
公司网址：www.qiandaojr.com
（92）上海基煜基金销售有限公司
住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人：王翔
联系人：蓝杰
电话：021-65370077-220
传真：021-55085991
客户服务电话：021-65370077
网址：www.jiyufund.com.cn
（93）北京懒猫金融信息服务有限公司
住所：北京市石景山区石景山路31号院盛景国际广场3号楼1119
办公地址：北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区1111号
法定代表人：许现良
电话：010-57649619
传真：010-57649620
联系人：朱翔宇
客户服务电话：010-57649619
公司网址：www.lanmao.com
（94）一路财富(北京)信息科技有限公司
住所：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人：吴雪秀
电话：+86(10)88312877
传真：+86(10)88312877
联系人：徐越
客户服务电话：400-001-1566
公司网址：http://www.yilucaifu.com/
（95）南京苏宁基金销售有限公司
住所：南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人：王锋
电话：025-66996699-887226
传真：025-66008800-887226
联系人：张慧
客户服务电话：95177
公司网址：www.snjijin.com
（96）北京蛋卷基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
电话：010-61840688
传真：010-61840699
联系人：吴季林
客户服务电话：4000618518
公司网址：https://danjuanapp.com
（97）上海景谷基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦402k
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦402k
法定代表人：袁飞
电话：61621602
传真：61621602*819
联系人：袁振荣
客户服务电话：61621602
公司网址：www.g-fund.com.cn
（98）北京汇成基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村大街11号A座1108室
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号A座1108室
法定代表人：王伟刚
电话：010-56251471
传真：010-62680827
联系人：熊小满
客户服务电话：400-619-9059
公司网址：www.hcjijin.com
（99）厦门市鑫鼎盛控股有限公司
住所：厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
法定代表人：陈洪生
电话：0592-3122672
传真：0592-3122701
联系人：梁云波
客户服务电话：400-9180808
公司网址：www.xds.com.cn
（100）北京新浪仓石基金销售有限公司
住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院东区3号楼为明大厦C座
法定代表人：赵芯蕊
电话：010-62675768
传真：010-62676582
联系人：赵芯蕊
客户服务电话：010-62675369
公司网址：www.xincai.com
（101）天津国美基金销售有限公司
住所：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层202-1室
办公地址：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层
法定代表人：丁东华
电话：010-59287984 传真：010-59287825
联系人：郭宝亮
客服电话：400-111-0889
公司网址：www.gomefund.com
（102 上海华信证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址：上海市黄浦区南京西路399号明天广场20楼
法定代表人：郭林
电话：021-63898427
传真：021-68776977-8427
联系人：徐璐
客户服务电话：400-820-5999
公司网址：www.shhxzq.com
（103）凤凰金信（银川）基金销售有限公司
住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402
办公地址：北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园18号楼
法定代表人：程刚
电话：010-58160168
传真：010-58160173
联系人：张旭
客户服务电话：400-810-5919
公司网址：www.fengfd.com
（104）上海云湾基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
办公地址：上海市浦东新区锦康路308号6号楼6楼
法定代表人：戴新装
电话：021-20538888
传真：021-20538999
联系人：江辉
客户服务电话：400-820-1515
公司网址：www.zhengtongfunds.com
（105）南京途牛基金销售有限公司
注册地址：南京市玄武区玄武大道699-1号
办公地址：南京市玄武区玄武大道699-1号
法定代表人：宋时琳
联系人：张士帅
联系电话：025-86853969
客服电话：4007-999-999
公司网址：http://jr.tuniu.com
（106）上海万得基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人：王廷富
联系人：徐亚丹
联系电话：021-51327185
传真：021-50710161
客服电话：400-821-0203
公司网址：www.520fund.com.cn
（107）杭州科地瑞富基金销售有限公司
住所：杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址：杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼
法定代表人：陈刚
联系人：张丽琼
联系电话：0571-85262700
传真：0571-85269200
客服电话：0571-86915761
公司网址：www.cd121.com
（108）北京植信基金销售有限公司
住所：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67
办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号
法定代表人：杨纪锋
联系人：吴鹏
电话：010-56075718
传真：010-67767615
客服电话：400-680-2123
网址：www.zhixin-inv.com
（109）北京肯特瑞基金销售有限公司
住所：北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157
办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部A座15层
法定代表人：王苏宁
联系人：李丹
电话：4000988511/ 4000888816
传真：010-89189566
客服电话：95118
网址：http://kenterui.jd.com
（110）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
（111）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
（112）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
（113）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
（114）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
（115）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
（116）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?
（117）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
（118）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/
（119）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
（120）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
（121）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
（122）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/
（123）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/
（124）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
（125）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
（126）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，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：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：021-68419525
联系人：周琳
（三）出具法律意见书的律师事务所
名称：上海源泰律师事务所
住所：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼
办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼
法定代表人：廖海
电话：021-51150298
传真：021-51150398
经办律师：廖海、田卫红
（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
中海稳健收益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较高的稳定收益。
七、基金的投资范围
本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以通过参与新股、可转债、可分离转债首发的投资方式来获取收益，提高基金收益水平。
本基金投资组合的资产配置：债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 不低于基金资产的80%，股票、权证类资产不超过基金资产的20%，权证资产占基金资产净值的0—3%。本基金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。本基金80%以上的基金资产投资于债券类金融工具。
八、基金的投资理念
本基金的投资理念是基于宏观经济周期趋势性变化，进行自上而下的主动性投资。在规避风险的前提下，为投资者提供较高的稳定收益。
九、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。比较固定收益品种与一级市场申购预期收益率，确定进行一级市场申购的资产比例，进行大类资产配置。
本基金在进行新股申购时，将结合金融工程数量化模型，使用中海基金估值模型等方法评估股票的内在价值，充分借鉴合作券商等外部资源的研究成果，对于拟发行上市新股（或增发新股）等权益类资产价值进行深入发掘。同时分析新股（或增发新股）等权益类资产融资规模、市场申购资金规模等条件，评估申购中签率水平，从而综合评估申购收益率，确定申购资金在不同品种之间、网上与网下之间的资金分配，对申购资金进行积极管理，制定相应申购策略以获取较好投资收益。
此外，为保证股票资产比例不超过基金资产的20%，本基金在存在锁定期的交易品种所形成的股票资产合计达到基金资产净值的10%时，将不再申购存在锁定期的交易品种。当通过发行市场申购、可转债转股所形成的股票资产合计达到基金资产净值的18%时，将不再申购新股。
2、久期配置 / 期限结构配置
（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。
利用中海宏观经济分析模型，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。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析，根据一定的收益率模型为各种固定收益投资品种进行风险评估，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AAM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。
3、债券类别配置：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、可分离可转债、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、可分离可转债、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。
本基金对于投资品种信用等级的投资限制如下：国债、央行票据、政策性金融债无限制；企业债券、公司债券等信用债券投资范围限制为AA以上（含AA）的投资品种，信用评级低于AA的信用债券不得投资。（本基金信用评级体系参见附录四）
4、做市策略：基于各个投资品种具体情况，自下而上的交易策略。
为增加投资者利益和改善交易所债券市场的流动性，本基金将根据自身持仓的公司债券的具体情况，对一些公司债券的交易采取做市策略。
为适应中国固定收益市场快速发展的环境，提高固定收益市场流动性，上海证券交易所建设了“固定收益电子信息平台”，引入一级交易商做市机制。提高证券交易的效率和市场流动性，为国债等固定收益产品提供了高效、低成本的批发交易平台。
本基金将在上海证券交易所固定收益综合电子平台上选择公司债券进行双边报价。国内外各金融市场做市交易策略的实证研究表明，做市交易策略可获得稳定的收益回报。
因此，本基金对于部分公司债券采取做市策略交易，一方面可以实现一定利润；另一方面可以增加公司债券的流动性。
5、其它交易策略
（1）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。
（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。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。
十、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）本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%。
（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）本基金不得在二级市场买入权证。在一级市场申购可分离转债所持有的权证只能单向卖出，不得买入。基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。
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5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
（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80%以上的基金资产投资于债券类金融工具。
（11）因通过发行市场申购、可转债转股所形成的股票资产合计低于基金净值的20%。
（12）本基金不得在二级市场买入股票。
（13）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、上市公司股票停牌、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。
（14）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。
（15）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。
（16）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。
如关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。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。
除上述第5）、13）、14）项另有规定外，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。其中因交易品种存在锁定期的原因，当通过发行市场申购、可转债转股所形成的股票资产合计超过基金净值的20%，基金管理人将在相关交易品种锁定期满后10个交易日内调整，以达到标准。法律法规、监管部门另有规定的从其规定。
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，但法律法规或中国证监会另有规定的除外。
（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。
十一、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准：中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中国债券总指数收益率×100%。中国债券总指数由中央债券登记结算中心于2003年1月1日编制发布，样本涵盖交易所、银行间市场记帐式国债（固定、浮动利率）、金融债。中央国债登记结算有限公司将中国债券总指数情况于中国债券信息网（www.chinabond.com.cn）上公开发布。
本基金选择中国债券总指数作为业绩比较基准的原因如下：
第一，从投资范围看，本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法公开发行和上市的国债、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债等债券。而中国债券总指数是目前涵盖范围最广的公开指数，涵盖了中国债券市场整体价格和投资回报情况；且指数样本是采集市场上真正在交易品种所制定出来的，有利于基金管理人以此总指数为基准进行投资组合的配置。迄今为之，这一指数已经为包括社保基金和许多债券基金在内的很多机构采用，而且使用范围正不断扩大。
第二，从发布主体看，中央国债登记结算公司是全国债券市场内提供国债、金融债、企业债和其他固定收益证券的登记、托管、交易结算等服务的国有独资金融机构，是财政部唯一授权主持建立、运营全国国债托管系统的机构，是中国人民银行指定的全国银行间债券市场债券登记、托管、结算机构和商业银行柜台记账式国债交易的一级托管人。因此从发布主体上保证中国债券总指数比较客观和专业。
第三，从编制规则看，中债总指数在样本券选择上使用合理的双边报价、合理和结算价、跨公司债券价格处理等价格源，且具有财富、全价、净价三组总值，指数按待偿期分段提供了12个指标值为一组的多组指标值。因此中债总指数的编制规则较为全面科学。
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基准的股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
十二、基金的风险收益特征
本基金属债券型证券投资基金，为证券投资基金中的较低风险品种。
本基金长期平均的风险和预期收益低于混合型基金，高于货币市场基金。
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日报告期末的第三季度报告数据，其中所列财务数据未经审计。
1、 报告期末基金资产组合情况
截至2020年3月31日，中海稳健收益债券型证券投资基金资产净值为114,392,437.22元，基金份额净值为1.139元，累计基金份额净值为1.729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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	123,965,183.53	89.54
	其中：债券	123,965,183.53	89.54
	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	1,500,000.00	1.08
	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	10,934,897.33	7.90
8	其他资产	2,045,049.97	1.48
9	合计	138,445,130.83	100.00

2、 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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
本基金本报告期末未持有股票。
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	5,625,334.60	4.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,505,930.40	13.56
	其中：政策性金融债	15,505,930.40	13.56
4	企业债券	18,195,378.10	15.91
5	企业短期融资券	40,143,000.00	35.09
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	44,495,540.43	38.90
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	123,965,183.53	108.37

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	018008	国开1802	119,280	12,486,230.40	10.92
2	011901785	19南京地铁SCP004	100,000	10,049,000.00	8.78
3	011902385	19厦路桥SCP006	100,000	10,037,000.00	8.77
4	011902088	19海通恒信SCP005	100,000	10,032,000.00	8.77
5	011902830	19厦翔业SCP009	100,000	10,025,000.00	8.76

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
本基金报告期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。
10、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2020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	4,030.57
2	应收证券清算款	463,996.20
3	应收股利	-
4	应收利息	1,561,479.27
5	应收申购款	15,543.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,045,049.97

（4） 报告期末持有的处于转股期的可转债明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132015	18中油EB	8,537,607.00	7.46
2	132013	17宝武EB	6,068,405.00	5.30
3	110053	苏银转债	1,772,286.00	1.55
4	127005	长证转债	1,376,573.60	1.20
5	132009	17中油EB	1,208,880.00	1.06
6	110057	现代转债	1,147,368.80	1.00
7	127012	招路转债	1,082,016.36	0.95
8	132007	16凤凰EB	1,020,000.00	0.89
9	128075	远东转债	929,832.00	0.81
10	113025	明泰转债	906,265.80	0.79
11	113021	中信转债	889,700.00	0.78
12	110045	海澜转债	821,440.00	0.72
13	113022	浙商转债	809,200.00	0.71
14	113534	鼎胜转债	807,757.70	0.71
15	128067	一心转债	720,244.38	0.63
16	132008	17山高EB	648,945.00	0.57
17	113011	光大转债	644,050.00	0.56
18	110048	福能转债	586,250.00	0.51
19	113508	新凤转债	452,721.60	0.40
20	110058	永鼎转债	430,730.00	0.38
21	113014	林洋转债	425,840.00	0.37
22	113017	吉视转债	396,529.00	0.35
23	128065	雅化转债	394,574.22	0.34
24	110033	国贸转债	390,985.00	0.34
25	127006	敖东转债	389,806.89	0.34
26	110043	无锡转债	382,842.40	0.33
27	110051	中天转债	352,410.00	0.31
28	110042	航电转债	340,866.00	0.30
29	128032	双环转债	340,547.13	0.30
30	110047	山鹰转债	339,150.00	0.30
31	113519	长久转债	333,090.00	0.29
32	113504	艾华转债	323,797.60	0.28
33	113012	骆驼转债	298,794.40	0.26
34	128045	机电转债	294,576.00	0.26
35	113013	国君转债	294,075.00	0.26
36	113525	台华转债	283,218.00	0.25
37	128071	合兴转债	242,191.25	0.21
38	128028	赣锋转债	218,435.00	0.19
39	128035	大族转债	215,460.00	0.19
40	128058	拓邦转债	121,795.24	0.11
41	123004	铁汉转债	109,530.00	0.10
42	113544	桃李转债	106,921.50	0.09
43	113542	好客转债	66,984.00	0.06
44	123023	迪森转债	20,073.50	0.02
45	110056	亨通转债	18,246.00	0.02
46	132012	17巨化EB	17,391.00	0.02
47	110052	贵广转债	11,875.00	0.01

（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
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
2008.04.10-2008.12.31	11.79%	0.18%	11.28%	0.23%	0.51%	-0.05%
2009.01.01-2009.12.31	6.56%	0.24%	-1.24%	0.10%	7.80%	0.14%
2010.01.01-2010.12.31	8.54%	0.21%	1.92%	0.10%	6.62%	0.11%
2011.01.01-2011.12.31	-3.23%	0.24%	5.72%	0.11%	-8.95%	0.13%
2012.01.01-2012.12.31	5.82%	0.13%	2.51%	0.07%	3.31