

中海能源策略混合型证券投资基金

[2012] 第一季度报告

基金管理人:中海基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一二年四月二十四日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及高级管理人员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。

基金托管人和中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2012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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 中海能源策略混合

基金主代码 398021

基金运作方式 约定定期开放式

基金合同生效日 2009年7月13日

报告期末基金份额总额 6,062,418,388.21份

投资目标 在把握能源短缺和中国经济增长模式下节约型转变的背景下，以能源为投资主题，重点关注具备能源优势的企业和行业，精选个股，并结合积极的权重配置，力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 在把握能源短缺和中国经济增长模式下节约型转变的背景下，以能源为投资主题，重点关注具备能源优势的企业和行业，精选个股，并结合积极的权重配置，力争实现基金资产的长期稳定增值。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

1.本期已实现收益 -664,565,268.91

2.本期利润 -29,771,420.00

3.期末基金财产份额总额 3,605,017,991.00

4.期末基金份额净值 0.5947

注1:本期指2012年1月1日至2012年3月31日，上述基金主要指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如，申购、赎回费用)，计算后收益水平将低于所列数字。

注2:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入、不含公允价值变动收益扣除相关费用后的余额，即为本期已实现收益加上本期初公允价值变动收益。

3.2 本期基金份额净值

3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.3 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.4 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.5 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.6 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.7 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.8 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.9 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.10 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.11 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.12 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.13 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.14 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.15 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.16 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.17 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.18 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.19 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.20 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.21 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.22 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.23 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例

阶段 净值增长 纯净值增长率 基业比较 纯净值增长率

率① 基准收益率 ② ③ ④

过去三个月 -0.85% 1.43% 3.45% 0.99% -4.30% 0.44%

3.2.24 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

例</p