

中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

[2012] 第二季度报告

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:二〇一二年七月十九日

§ 1 重要提示
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，于2012年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

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。投资有风险，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。

本报告期基金财产未进行审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中海蓝筹混合
基金代码	399801
交易代码	399801
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月3日
报告期末基金份额总额	71,361,287.39 ^①

通过研究股票市场和债券市场的估值水平，调整股票、固定收益资产的投资比例，优先投资于沪深300指数成份股和精选的中小板中权重较高的基本面较好的股票，重点选择市盈率相对低的上市公司以及收入与成长性相对较高的固定收益品种，同时适当配置具有较好盈利能力的小企业，兼顾本利和当期利息收益，谋求基金资产的长期稳定增值。

一级股权投资，根据股票和债券价值的相对吸引力(ASVVA, A Share Stocks Valuation Model)，动态调整资产的配置比例。

二级股权投资，即投资于一级股权投资的公司。

投资目标 通过股票和债券的组合投资，实现资产的长期稳定增值。

投资策略 一级股权投资，根据股票和债券价值的相对吸引力(ASVVA, A Share Stocks Valuation Model)，动态调整资产的配置比例。

二级股权投资，即投资于一级股权投资的公司。

业绩比较基准 沪深300指数×60%+中债国债指数×40%

风险收益特征 本基金属于混合型证券投资基金，为证券投资基金中的较高风险品种。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -645,148.60

2.本期利润 1,602,929.20

3.加权平均基金份额本期利润 0.0223

4.期末基金资产净值 59,894,247.05

5.期末基金份额净值 0.8393

注1:本期折算2012年4月1日至2012年6月30日，上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金时涉及的费用(申购、赎回费等)，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

注2:本期期间收益率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，本期为0%已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 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

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

过去三个月 2.69% 0.84% 1.12% 0.65% 1.57% 0.19%

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

中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2008年12月3日至2012年6月30日

该图显示了中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金成立以来的累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比情况。

该图显示了中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金成立以来的累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比情况。