

中海能源策略混合型证券投资基金

[2013]第四季度报告

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:2014年1月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事和高级管理人员已阅读并理解了本报告,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已阅读并理解了本报告,同意本报告的内容,并对报告中的财务指标、净值表现、组合报告等事项的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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。

§ 2 报告期基本情况

报告期起止日期:2013年1月1日至2013年12月31日。

§ 3 基金产品概况

基金简称:中海能源策略混合

基金代码:398021

交易代码:398021

基金运作方式:契约型开放式

报告期起止日期:2009年7月1日至2013年12月31日。

报告期末基金份额总额:5,199,365,198.22份

投资目标:在把握能源行业和中国经济增长模式向弱周期转化的背景下,以能源为投资主线,精选具有稳定现金流和持续增长的企业,精选个股,并结合行业的配置,寻求基金资产的长期稳定增值。

§ 4 报告期末基金资产组合情况

报告期起止日期:2013年1月1日至2013年12月31日。

报告期末基金份额总额:5,199,365,198.22份

基金资产配置:股票360,049,528.57元,占基金总资产的74.09%;债券343,224,135.60元,占基金总资产的10.77%;货币市场基金34,901,006.75元,占基金总资产的11.14%。

其中:股息投资326,049,528.57元,占基金总资产的74.09%;固定收益投资343,224,135.60元,占基金总资产的10.77%;货币市场基金34,901,006.75元,占基金总资产的11.14%。

报告期末持有的处于转股期的可转换债券基金0元,占基金总资产的0%。

报告期末持有的股票投资0元,占基金总资产的0%。

报告期末持有的债券投资343,224,135.60元,占基金总资产的10.77%。

报告期末持有的货币市场基金34,901,006.75元,占基金总资产的11.14%。

报告期末持有的其他资产0元,占基金总资产的0%。

报告期末持有的资产总计81,625,440.92元,占基金总资产的2.56%。

报告期末持有的其他资产45,771,250.93元,占基金总资产的1.44%。

报告期末持有的货币总计3,185,571,362.77元,占基金总资产的100.00%。

§ 5 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期起止日期:2013年1月1日至2013年12月31日。

报告期末基金份额总额:5,199,365,198.22份

投资目标:在把握能源行业和中国经济增长模式向弱周期转化的背景下,以能源为投资主线,精选具有稳定现金流和持续增长的企业,精选个股,并结合行业的配置,寻求基金资产的长期稳定增值。

§ 6 一、一级配置:本基金将能源类和消费类的行业划分为一级配置。

(ASVM, A Share Value Model), 依据宏观经济分析和股票基本面分析,结合对宏观经济的判断,对一级配置的行业进行估值,根据股票的估值配置,投资于具备为本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。

§ 7 报告期内基金资产组合情况

报告期起止日期:2013年1月1日至2013年12月31日。

报告期末基金份额总额:5,199,365,198.22份

基金资产配置:股票360,049,528.57元,占基金总资产的74.09%;债券343,224,135.60元,占基金总资产的10.77%;货币市场基金34,901,006.75元,占基金总资产的11.14%。

其中:股息投资326,049,528.57元,占基金总资产的74.09%;固定收益投资343,224,135.60元,占基金总资产的10.77%;货币市场基金34,901,006.75元,占基金总资产的11.14%。

报告期末持有的处于转股期的可转换债券基金0元,占基金总资产的0%。

报告期末持有的股票投资0元,占基金总资产的0%。

报告期末持有的债券投资343,224,135.60元,占基金总资产的10.77%。

报告期末持有的货币市场基金34,901,006.75元,占基金总资产的11.14%。

报告期末持有的其他资产0元,占基金总资产的0%。

报告期末持有的资产总计81,625,440.92元,占基金总资产的2.56%。

报告期末持有的其他资产45,771,250.93元,占基金总资产的1.44%。

报告期末持有的货币总计3,185,571,362.77元,占基金总资产的100.00%。

§ 8 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年1月1日 - 2013年12月31日)

1.本期已实现收益 7,989,447.61

2.本期利润 -88,091,329.65

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0167

4.期末基金资产净值 3,159,777,007.27

5.期末基金份额净值 0.6077

注1:本期自2013年1月1日至2013年12月31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所产生的费用,计算费用后实际收益低于所列数字。

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,即为可供分配收益。

注3:期末基金资产净值=期末总资产-期末总负债。

注4:本基金的业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金所产生的费用,计算费用后实际收益低于所列数字。

注5:3.主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标和基金净值表现

3.1.1 主要财务指标

3.1.2 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.3 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.4 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.5 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.6 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.7 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.8 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.9 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.10 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.11 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.12 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.13 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.14 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.15 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.16 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.17 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.18 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.19 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.20 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.21 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.22 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.23 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.24 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.25 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.26 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.27 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.28 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.29 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.30 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.31 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.32 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.33 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.34 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.35 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.36 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.37 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.38 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.39 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.40 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.41 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.42 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.43 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.44 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.45 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.46 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.47 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.48 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.49 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.50 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.51 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.52 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.53 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.54 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.55 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.56 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.57 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.58 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.59 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.60 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.61 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.62 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.63 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.64 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.65 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.66 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.67 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.68 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.69 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.70 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.71 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.72 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.73 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.74 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.75 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.76 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.77 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.78 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.79 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.80 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.81 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.82 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.83 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.84 报告期基金份额净值增长率及其与同期基准收益的比较

3.1.85 报