

## 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**

**1.1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月17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、勤勉尽责的原则履行管理职责,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

**1.2 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

本基金为主动投资的证券投资基金,在追求基金资产长期增值的前提下,以能源为投资主题,重点投资于具备能源竞争优势的行业和公司,精选个股,并综合运用积极的权益投资策略,谋求基金资产的长期稳定增值。

**1.3 投资策略**

1. 资产配置策略:本基金根据对宏观经济形势的判断,在股票、债券、现金等资产类别之间进行资产配置。ASSM 模型通过对股票市场和债券市场的相关性分析,动态调整股票资产和债券资产的配置比例,在控制风险的前提下,提高基金资产的整体收益水平。

2. 股票投资策略:本基金根据对宏观经济形势的判断,在股票、债券、现金等资产类别之间进行资产配置。ASSM 模型通过对股票市场和债券市场的相关性分析,动态调整股票资产和债券资产的配置比例,在控制风险的前提下,提高基金资产的整体收益水平。

**1.4 业绩比较基准**

沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

本基金采用沪深300指数和上证国债指数作为业绩比较基准,旨在衡量基金资产的整体收益水平。

**1.5 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。本基金采用沪深300指数和上证国债指数作为业绩比较基准,旨在衡量基金资产的整体收益水平。

**1.6 基金管理人**

中海基金管理有限公司

**1.7 基金托管人**

中国工商银行股份有限公司

**1.8 主要财务指标**

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10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

**1.9 基金经理**

王巍

**1.10 基金业绩**

注1:上述任择日期,离任日期指本基金管理人对外披露的任择日期。

注2:证券从业的公告通过行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

**1.11 基金管理人**

中海基金管理有限公司

**1.12 基金托管人**

中国工商银行股份有限公司

**1.13 主要财务指标**

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-3,974,239.54
2.本期利润	-8,246,408.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0728
4.期末基金资产净值	123,952,689.96
5.期末基金份额净值	1.1614

**1.14 基金业绩**

注1:上述任择日期,离任日期指本基金管理人对外披露的任择日期。

注2:证券从业的公告通过行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

**1.15 基金管理人**

中海基金管理有限公司

**1.16 基金托管人**

中国工商银行股份有限公司

**1.17 主要财务指标**

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-3,974,239.54
2.本期利润	-8,246,408.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0728
4.期末基金资产净值	123,952,689.96
5.期末基金份额净值	1.1614

**1.18 基金业绩**

注1:上述任择日期,离任日期指本基金管理人对外披露的任择日期。

注2:证券从业的公告通过行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

**1.19 基金管理人**

中海基金管理有限公司

**1.20 基金托管人**

中国工商银行股份有限公司

**1.21 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.22 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.23 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.24 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.25 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.26 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.27 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.28 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.29 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.30 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.31 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.32 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.33 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.34 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.35 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.36 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.37 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

**1.38 基金产品概况**

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	5,199,356,519.82份

## 中海量化策略股票型证券投资基金

# 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**

**1.1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月17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、勤勉尽责的原则履行管理职责,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

**1.2 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.3 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.4 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.5 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.6 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.7 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.8 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.9 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.10 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.11 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.12 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.13 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.14 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.15 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.16 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.17 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.18 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.19 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.20 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.21 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.22 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.23 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.24 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.25 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.26 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.27 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.28 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式
报告期末基金份额总额	202,765,091.98份

**1.29 基金产品概况**

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	390041
交易代码	390041
基金运作方式	契约开放式</