

## 中海稳健收益债券型证券投资基金

## [2014]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:2014年4月19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、完整性、及时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。

本报告期未发生财务费用。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称:中海稳健收益债券

基金主代码:395001

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2008年4月10日

报告期末基金份额总额:93,357,096.82份

投资目标:在充分保障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收益。

1.一级资产配置

(1)一级配置主要采取自上而下的方式,比较固定收益品种和股票等风险资产的配置比例,进行合理的资产配置。

本基金在进行新的申购时,将结合基金工程量化模型,使用中海基金量化等方式对投资组合的资产配置、投资风格、投资品种、投资策略等进行分析,评估申购金额是否在合理范围内,并与网

悉该品种的收益及风险,并定期对新增或调整投资品种进行评估,市场购买的品种是否在合理范围内,并与网

悉该品种的收益及风险,并定期对新增或调整投资品种进行评估,以获得更好的投资回报。

5.其他资产配置

(1)一级配置运用

(2)二级配置运用

6.现金类资产

7.其他资产

8.合计

133,667,977.48

100.00%

5.2 报告期末基金资产构成情况

序号 项目 公允价值(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 - -

2 固定收益投资 - -

3 货币市场基金 - -

4 货币型基金 - -

5 货币衍生品投资 - -

6 银行存款和结算备付金合计 2,598,364.77 1.94

7 其他资产 3,336,403.11 2.50

8 合计 133,667,977.48

100.00%

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 105,869.22 0.05

B 采矿业 529,766.29 0.27

C 制造业 9,673,310.17 50.31

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 1,151,247.94 5.99

E 建筑业 699,399.41 3.64

F 银行业 2,237,798.73 11.64

G 交通运输、仓储和邮政业 1,552,145.34 8.07

H 住宿和餐饮业 33,353.74 0.17

I 信息传输、软件和信息技术服务业 878,793.18 4.57

J 工业 1,369.00 0.01

K 信息技术业 414,586.08 2.16

L 租赁和商务服务业 152,968.67 0.80

M 科学研究和技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 68,688.87 0.36

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 325,968.93 1.70

S 综合 380,273.45 1.98

18,203,866.92 94.19

5.2.3 报告期末按行业分类的债券投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 采矿业 - -

C 制造业 - -

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 银行业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 工业 - -

K 信息技术业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究和技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

18,203,866.92 94.19

5.2.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 105,869.22 0.05

B 采矿业 529,766.29 0.27

C 制造业 9,673,310.17 50.31

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 1,151,247.94 5.99

E 建筑业 699,399.41 3.64

F 银行业 2,237,798.73 11.64

G 交通运输、仓储和邮政业 1,552,145.34 8.07

H 住宿和餐饮业 33,353.74 0.17

I 信息传输、软件和信息技术服务业 878,793.18 4.57

J 工业 1,369.00 0.01

K 信息技术业 414,586.08 2.16

L 租赁和商务服务业 152,968.67 0.80

M 科学研究和技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 68,688.87 0.36

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 325,968.93 1.70

S 综合 380,273.45 1.98

18,203,866.92 94.19

5.2.5 报告期末按行业分类的债券投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 采矿业 - -

C 制造业 - -

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 银行业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 工业 - -

K 信息技术业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究和技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

18,203,866.92 94.19

5.2.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 105,869.22 0.05

B 采矿业 529,766.29 0.27

C 制造业 9,673,310.17 50.31

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 1,151,247.94 5.99

E 建筑业 699,399.41 3.64

F 银行业 2,237,798.73 11.64

G 交通运输、仓储和邮政业 1,552,145.34 8.07

H 住宿和餐饮业 33,353.74 0.17

I 信息传输、软件和信息技术服务业 878,793.18 4.57

J 工业 1,369.00 0.01

K 信息技术业 414,586.08 2.16

L 租赁和商务服务业 152,968.67 0.80

M 科学研究和技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

18,203,866.92 94.19

5.2.7 报告期末按行业分类的债券投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 采矿业 - -

C 制造业 - -

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 银行业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 工业 - -

K 信息技术业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究和技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

18,203,866.92 94.19

5.2.8 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 105,869.22 0.05

B 采矿业 529,766.29 0.27

C 制造业 9,673,310.17 50.31

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 1,151,247.9