

中海安鑫保本混合型证券投资基金

[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:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2014年4月19日

基金经理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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2014年4月18日复核了本报

告中的财务数据、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。

本报告期内未发生巨额赎回。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§ 1 基金产品概况

基金简称 中海安鑫保本混合型证券投资基金

基金代码 000166

交易代码 000166

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2013/7/31

报告期末基金份额总额 249,912,695.51份

投资目标 通过采用积极的投资策略，在保证本金安全的前提下，力争在保持本基

金内实现规模资产的稳定增值。

本基金主要投资于固定收益类资产，同时适当参与股票、权证等权益类资产的投

资，以期在控制风险的前提下，获得超越业绩基准的稳定回报。

1.CPPR策略：通过CPPR策略对品种进行资产配置和投资组合管理，力争在保

护本金的前提下，实现基金资产的稳定增值。

2.OHBM策略：通过OHBM策略对品种进行资产配置，对安全资产与风险

资产进行动态调整，以期在控制风险的前提下，获得超越业绩基准的稳定回报。

3.风险管理策略：通过风险管理策略对品种进行资产配置，以期在控制风

险的前提下，获得超越业绩基准的稳定回报。

(1)企业债的配置策略：对企业债的配置比例根据宏观经济形势、信用利差

变化、利率走势、企业债的信用评级等因素进行动态调整。

(2)中小企业债的配置策略：对中小企业债的配置比例根据宏观经济形

势、信用利差、利率走势、企业债的信用评级等因素进行动态调整。

(3)可转债的配置策略：对可转债的配置比例根据宏观经济形势、信用利

差变化、利率走势、可转债的信用评级等因素进行动态调整。

4.货币市场基金的配置策略：对货币市场基金的配置比例根据宏观经济

形势、资金面、利率走势、货币市场基金的信用评级等因素进行动态调整。

5.股票型基金的配置策略：通过基本面分析与技术分析相结合的方法

选择行业中具有竞争优势的企业进行投资。

6.权证的配置策略：通过基本面分析与技术分析相结合的方法选择

具有较高弹性的权证品种进行投资。

7.衍生品的配置策略：通过基本面分析与技术分析相结合的方法选

择具有较高弹性的衍生品种进行投资。

8.其他资产的配置策略：通过基本面分析与技术分析相结合的方

法选择具有较高弹性的其他资产品种进行投资。

9.组合管理：通过定期评估和调整资产配置比例，使本基金的资产

配置更符合当前的宏观经济形势。

10.风险管理：通过定期评估和调整资产配置比例，使本基金的资产

配置更符合当前的宏观经济形势。

11.定期报告：定期报告是基金管理人向基金持有人披露基金信

息的定期报告。

12.年度报告：年度报告是基金管理人向基金持有人披露基金信

息的年度报告。

13.半年度报告：半年度报告是基金管理人向基金持有人披露基金信

息的半年度报告。

14.季度报告：季度报告是基金管理人向基金持有人披露基金信

息的季度报告。

15.临时报告：临时报告是基金管理人向基金持有人披露基金信

息的临时报告。

16.基金合同：基金合同是基金管理人与基金持有人就基金的

投资与收益、费用与开支、权利与义务等事项达成的协议。

17.基金招募说明书：基金招募说明书是基金管理人向基金持有人

披露有关基金的信息，说明基金的基本情况，规定基金的投资策

略、投资方向、投资品种、投资比例、费率、收益分配、风险特征、

基金份额的申购与赎回、基金的上市交易、基金的转换、基金的

费用、基金合同当事人各方的权利与义务、基金的募集以及基金的

存续期间的其他安排等事项的文件。

18.基金代销机构：基金代销机构是代销本基金的机构。

19.基金销售网点：基金销售网点是基金代销机构的销售网点。

20.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

21.基金销售代理人：基金销售代理人是代销本基金的机构。

22.基金销售点：基金销售点是基金销售代理人的销售网点。

23.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

24.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

25.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

26.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

27.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

28.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

29.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

30.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

31.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

32.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

33.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

34.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

35.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

36.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

37.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

38.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

39.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

40.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

41.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

42.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

43.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

44.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

45.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

46.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

47.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

48.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

49.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

50.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

51.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

52.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

53.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

54.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

55.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

56.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

57.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

58.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

59.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

60.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

61.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

62.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

63.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

64.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

65.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

66.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

67.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

68.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

69.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

70.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

71.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

72.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

73.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

74.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

75.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

76.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

77.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

78.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

79.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

80.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

81.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

82.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

83.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

84.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

85.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

86.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

87.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

88.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

89.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

90.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

91.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

92.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

93.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

94.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

95.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

96.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

97.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

98.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

99.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

100.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

101.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

102.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

103.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

104.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

105.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

106.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

107.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

108.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

109.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

110.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

111.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

112.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

113.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

114.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

115.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

116.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

117.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

118.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

119.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

120.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

121.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

122.基金销售机构：基金销售机构是代销本基金的机构。

123.基金销售机构：