

# 中海量化策略股票型证券投资基金

## 2010 年 度 报 告 摘 要

业绩持续超预期的成长将会有所表现。量化基金将积极把握市场的各种机会。我们将继续优化我们的量化模型,结合大量资产配置模型、量化行业配置模型、量化风格轮动模型和数量化选股模型,积极运作,以期在2011年取得较好的把握市场给我们创造的各种机会。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品进行估值。本基金管理人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所存在估值错误导致基金资产净值的变化在0.25%以上时所未采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确估值工作的顺利开展,建立了负责估值工作的决策和执行机构估值小组,小组成员包括督察长、风险控制总监、监察稽核负责人及基金会计负责人等,成员均具有多年丰富从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。负责估值核算的小组成员不包括投资总监及基金经理,但对于非活跃投资品种,投资总监及基金经理可以向估值核算小组提供估值建议。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大分歧。

4.7 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明

根据法律法规以及基金合同的相关规定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为10次,每次收益分配比例不得低于期末可供分配利润的10%;本基金本报告期末未可供分配利润为46,574,120.33元;报告期内实施利润分配1次,实际分配金额为19,589,923.42元;本基金于2011年3月7日实施利润分配1次。

5.1 报告期内本基金托管人履职情况

2010年,本基金托管人在对中海量化策略股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对于报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010年,中海量化策略股票型证券投资基金的托管人——中国工商银行有限公司在中海量化策略股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,中海量化策略股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了两次利润分配,分配金额为19,589,923.42元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中海基金管理有限公司编制和披露的中海量化策略股票型证券投资基金2010年年度报告中财务报告、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

江苏公证天业会计师事务所有限公司对本基金出具了无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

7.1 资产负债表

资产主体:中海量化策略股票型证券投资基金

报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产:			
银行存款		52,798,829.32	193,522,835.39
结算备付金		5,143,487.44	8,813,805.00
存出保证金		1,868,534.53	5,254,753.88
交易性金融资产		545,175,300.27	1,161,542,293.08
其中:股票投资		545,175,300.27	1,161,542,293.08
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		2,964,576.64	23,392,638.98
应收利息		10,867.33	47,147.77
应收股利		-	-
应收申购款		219,209.08	509,576.81
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		608,180,804.61	1,393,083,050.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,602,225.97	7,517,232.21
应付赎回款		245,696.15	14,549,378.96
应付管理人报酬		809,479.65	1,997,992.95
应付托管费		134,913.28	332,498.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,067,108.74	4,188,588.21
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		-	-
负债合计		100,555.64	320,337.22
所有者权益		9,959,979.43	28,906,528.36
实收基金		55,646,704.85	1,309,863,099.51
未分配利润		54,574,120.33	54,313,423.04
所有者权益合计		598,220,825.18	1,364,176,522.55
负债和所有者权益总计		608,180,804.61	1,393,083,050.91

注:1.报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

2.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

3.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

4.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

5.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

6.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

7.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

8.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

9.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

10.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

11.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

12.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

13.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

14.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

15.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

16.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

17.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

18.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

19.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

20.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

21.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

22.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

23.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

24.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

25.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

26.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

27.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

28.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

29.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

30.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

31.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

32.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

33.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

34.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

35.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

36.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

37.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

38.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

39.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

40.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

41.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

42.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

43.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

44.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

45.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

46.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

47.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

48.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

49.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

50.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

51.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

52.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

53.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

54.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

55.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

56.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

57.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

58.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

59.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

60.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

61.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

62.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

63.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

64.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

65.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

66.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

67.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

68.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

69.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

70.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

71.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

72.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

73.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

74.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

75.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

76.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

77.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

78.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

79.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

80.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

81.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

82.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

83.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

84.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

85.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

86.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

87.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

88.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

89.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

90.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

91.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

92.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

93.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

94.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

95.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

96.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

97.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

98.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

99.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

100.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

101.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

102.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

103.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

104.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

105.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

106.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

107.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

108.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

109.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

110.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

111.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

112.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

113.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

114.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

115.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

116.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

117.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

118.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

119.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

120.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

121.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

122.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

123.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

124.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

125.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

126.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

127.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

128.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

129.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

130.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

131.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

132.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。

133.1.2 本报告期末基金份额净值1.084元,基金份额总额551,646,704.85份。