

中海能源策略混合型证券投资基金

2012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:2013年1月22日

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2013年1月18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。投资人投资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2012年10月1日起至12月31日止。

\$2 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
基金合同生效日	2007年3月13日
报告期末基金份额总额	5,799,048,689.83份
投资目标	在世界能源短缺和中国经济模式向节能减排的背景下，以能源为投资主题，重点关注具备能源行业属性的上市公司，同时关注经济转型过程中新兴产业。我们将重点关注新型城镇化给城市建设、生活智能、服务升级等相关行业带来的机会，关注经济回暖下部分周期行业的机会以及制度改革红利带来的机会，同时我们将继续强化自下而上的研究，挖掘公司的优秀公司。

4.2 报告期内基金的业绩表现

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资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2012年10月1日起至12月31日止。

\$5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,058,773,430.85	89.80
其中:股票	3,058,773,430.85	89.80	
2 固定收益投资	-	-	
其中:债券	-	-	
货币支持证券	-	-	
3 衍生金融工具	-	-	
4 其他资产	-	-	
其中:卖出断式回购的买入返售基金	-	-	
5 银行存款和结算备付金合计	259,798,345.07	7.63	
6 其他资产	87,660,238.80	2.57	
7 合计	3,406,232,014.72	100.00	

5.2 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	72,037,265.55	2.13	
B 采掘业	179,578,265.06	5.30	
C 制造业	1,178,305,604.73	34.79	
CO 食品、饮料	91,451,511.75	2.70	
CI 纺织、服装、皮革	33,285,043.52	0.98	
CII 木材、家具	-	-	
CM 造纸、印刷	-	-	
CAI 石油、化学、塑胶、塑料	53,042,478.32	1.57	
CMII 电子	207,924,414.70	6.14	
CG 金属、非金属	275,676,142.94	8.14	
CH 机械、设备、仪表	312,589,064.92	9.23	
CIK 医药、生物制品	204,336,108.88	6.03	
CK 环球制造业	-	-	
D 可再生能源、煤气水的生产和供应业	26,932,780.14	0.80	
E 建筑业	226,830,253.81	6.70	
F 交通运输、仓储业	48,389,720.98	1.43	
G 信息技术业	115,972,947.29	3.42	
H 批发和零售贸易	58,600,248.30	1.73	
I 金融、保险业	612,051,360.00	18.07	
J 房地产业	365,186,227.89	10.78	
K 社会服务业	66,698,183.73	1.97	
L 传播与文化产业	108,190,571.39	3.19	
M 公用事业	-	-	
M 合计	3,058,773,430.85	90.32	

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002375	亚厦股份	5,463,917	144,684,522.16	4.27
2	001788	光大证券	7,309,668	103,066,318.80	3.04
3	600111	包钢稀土	2,634,584	98,665,170.80	2.91
4	600048	保利地产	6,897,843	93,810,664.80	2.77
5	000002	万科A	8,991,098	90,989,117.66	2.69
6	600702	沱牌舍得	3,059,054	88,131,345.74	2.60
7	601166	兴业银行	5,252,229	87,664,709.01	2.59
8	000629	攀钢钒钛	20,742,761	85,460,175.32	2.52
9	601699	潞安环能	3,752,484	82,141,874.76	2.43
10	300024	机器人	2,878,339	77,628,802.83	2.29

5.4 报告期按照行业分类的债券投资组合

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002375	亚厦股份	5,463,917	144,684,522.16	4.27
2	001788	光大证券	7,309,668	103,066,318.80	3.04
3	600111	包钢稀土	2,634,584	98,665,170.80	2.91
4	600048	保利地产	6,897,843	93,810,664.80	2.77
5	000002	万科A	8,991,098	90,989,117.66	2.69
6	600702	沱牌舍得	3,059,054	88,131,345.74	2.60
7	601166	兴业银行	5,252,229	87,664,709.01	2.59
8	000629	攀钢钒钛	20,742,761	85,460,175.32	2.52
9	601699	潞安环能	3,752,484	82,141,874.76	2.43
10	300024	机器人	2,878,339	77,628,802.83	2.29

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科企业债	99,989,911.76	2,69	重大事项停牌
2	120305	国债	-	-	-
3	120305	国债	-	-	-
4	120305	国债	-	-	-
5	120305	国债	-	-	-
6	120305	国债	-	-	-
7	120305	国债	-	-	-
8	120305	国债	-	-	-
9	120305	国债	-	-	-
10	120305	国债	-	-	-

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科企业债	99,989,911.76	2.69	重大事项停牌
2	120305	国债	-	-	-
3	120305	国债	-	-	-
4	120305	国债	-	-	-
5	120305	国债	-	-	-
6	120305	国债	-	-	-
7	120305	国债	-	-	-
8	120305	国债	-	-	-
9	120305	国债	-	-	-
10	120305	国债	-	-	-

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科企业债	99,989,911.76	2.69	重大事项