

信息披露 Disclosure

中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

注：上述基金按市场利率计算，已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。
实际交易金额=股票成交金额×0.1%—股票交易经手费—股票交易印花税—证券结算风险基金（按管理费机构收取）
因联证券符合中国证监会选择证券经营机构，使用其席位作为基金专用交易席位的标准，与其签订的席位租用合同是在正常业务中按照一般商业条款订立的。其为本基金提供证券经纪服务研究成果和市场信息服务。
6.4.3.2 关联方交易
6.4.8.2.1 基金管理费

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,814,390.41	2,794,243.98
其中：支付销售机构的客户维护费	712,264.45	1,024,784.14

注：基金管理费按前一日的基础资产净值值的1.5%的年费率计提，计算方法如下：
H= E×0.25%÷当年天数（H为每日应支付的基金管理费，E为前一日的基础资产净值）
基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。
6.4.8.2.2 基金托管费

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	302,388.37	460,707.28

注：基金托管费按前一日的基础资产净值值的0.25%的年费率计提，计算方法如下：
H= E×0.25%÷当年天数（H为每日应支付的基金托管费，E为前一日的基础资产净值）
基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。
6.4.8.2.3 与关联方交易
注：本基金报告期内与关联方交易的情况
注：本报告期末及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。
6.4.8.3 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
注：本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。
6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
工商银行	32,934,155.63	83,780,085
招商银行	52,903,155.63	83,780,085

注：本基金报告期内与关联方交易的情况
6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
注：本基金在报告期内及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。
6.4.9 期末，2014年6月30日，本基金持有的流通受限证券
6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
注：本基金在报告期内未认购新发/增发证券而持有流通受限证券。
6.4.9.2 期末持有的限售股股票数量及受限原因

股票代码	证券名称	停牌日期	停牌原因	数量(股)	期末成本/元	期末公允价值/元	备注
000522	汇通能源	2014年4月21日	重大事项停牌	6.36	2014年8月13日	7.00	950,000

股票代码	证券名称	停牌日期	停牌原因	数量(股)	期末成本/元	期末公允价值/元	备注
300379	东方网	2014年6月21日	重大事项停牌	62.17	2014年8月13日	67.39	48,300

股票代码	证券名称	停牌日期	停牌原因	数量(股)	期末成本/元	期末公允价值/元	备注
300369	绿盟科技	2014年6月26日	重大事项停牌	61.27	-	-	37,837

股票代码	证券名称	停牌日期	停牌原因	数量(股)	期末成本/元	期末公允价值/元	备注
002638	光电子	2014年10月10日	重大事项停牌	14.15	2014年7月15日	14.75	128,041

6.4.9.3 期末债券资产公允价值中所作抵押的债券
6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购
注：本基金在报告期内未进行银行间市场债券正回购，因此无抵押债券。
6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购
注：本基金在报告期内未进行交易所市场债券正回购，因此无抵押债券。
6.4.9.4 期末资产组合情况

项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1 权益投资	132,540,909.09	60.71
其中：股票	132,540,909.09	60.71
2 固定收益投资	49,974,000.00	22.89
其中：债券	49,974,000.00	22.89
资产支持证券	-	-
3 贵金属投资	-	-
4 金融衍生品投资	-	-
5 买入返售金融资产	-	-
其中：买入返售金融资产-买入返售金融资产	-	-
6 银行存款和结算备付金合计	33,927,562.65	15.54
7 其他资产	1,874,426.65	0.86
8 合计	218,316,898.39	100.00

金额单位:人民币元			
代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,406,275.30	1.11
B	采矿业	-	-
C	制造业	43,937,628.87	20.22

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	649,500	6,514,485.00	3.00
2	000963	华鲁恒升	118,184	3,881,936.00	2.94
3	002524	齐星铁塔	950,000	6,042,000.00	2.78
4	600000	浦发银行	658,200	5,956,710.00	2.74
5	601766	中国国旅	1,420,345	5,491,552.50	2.53
6	600594	蓝盾股份	124,400	5,116,572.00	2.35
7	600168	华鲁恒升	280,700	4,493,088.78	2.07
8	600198	大唐电信	2,250,710	4,254,770.00	1.93
9	600015	华夏银行	512,700	3,280,140.00	1.53
10	600408	保利地产	803,100	2,963,370.00	1.83

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,381,428.71	16.28
J	金融业	16,675,335.00	7.67
K	房地产业	6,830,732.25	3.14

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	3,772,175.00	1.74
S	综合	—	—

合计			132,540,909.09		61.00	
3 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						金额单位：人民币元
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)	
1	002475	立讯精密	19,994,914.85	7.13		
2	300030	维信诺	14,607,091.27	5.34		
3	300017	国瑞科技	13,252,267.00	4.99		
4	002219	恒康医疗	11,778,360.00	4.29		
5	002410	广联达	11,371,642.22	4.22		
6	300022	聚友股份	10,535,681.00	3.84		
7	300332	海康威视	10,236,101.96	3.73		
8	002550	千禧生物	10,096,058.04	3.68		
9	300146	佳讯传媒	10,015,989.72	3.65		
10	300157	恒泰医药	9,270,726.76	3.38		