中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金

【2014】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:2015年1月20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2015年1月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中海环保新能源混合
基金主代码	398061
交易代码	398061
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月9日
报告期末基金份额总额	180,475,743.77份
投资目标	在全球环境状况不断恶化、气候逐渐变暖以及我国节能减排压力日益突出的背景下,以环保为投资主题,重点关注具有环保责任和环保意识,并同时具有成长潜力的环保产业和新能源产业以及具有环保竞争优势的行业和企业,充分分享国内环保业和新能源产业发展带来的投资机会,并精选个股,结合积极地权重配置,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、一级资产配置 一级资产配置主要采取自上而下的方式。在资产配置中,主要考虑宏观经济周期状况,宏观政策情况,市场价值,市场情绪等四方面因素。通过对各种因素的综合分析,增加该的投下市场表现优于其他资产类别的资产的配置,减少市场表现相对较差的资产类别的配置,以期超成分散市场风险,提高基金经风险调整后的收益。 2、行业/久期配置 行业配置:本基金以环保行业配置和新能源行业配置为主,其中环保行业配置采取以行业环保水平为主要配置原则的侧金字塔环保行业配置。 久期配置:债券组合的久期配置采用自上而下的方法。 3、股票投资 本基金80%以上的股票资产投资于环保与新能源主题类股票。本基金采用自上而下与自下而上相结合的选股策略。 4、债券投资 本基金债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的,在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上,采取积极主动的投资策略,投资于国债、金融债、企业债、可转债、央票、短期融资券以及资产证券化产品,在获取较高利息收入的同时兼顾资本利得,谋取超额收益。 5、权证投资策略 本基金在证券合允许的范围内适度投资权证。在权证投资中,本基金将对权证标的证券的基本面进行研究,利用Black-Scholes-Merton模型、二叉树模型及其它权证定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值,权证投资策略主要从价值投资的角度出发。
业绩比较基准	沪深300指数涨跌幅×60%+中国债券总指数涨跌幅×40%
风险收益特征	本基金属混合型证券投资基金,为证券投资基金中的中高风险品种。 本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年10月1日 - 2014年12月31日)
1.本期已实现收益	40,326,998.71
2.本期利润	51,666,979.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.2104
4.期末基金资产净值	190,947,531.92
5.期末基金份额净值	1.058

注 1:本期指2014年10月1日至2014年12月31日,上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

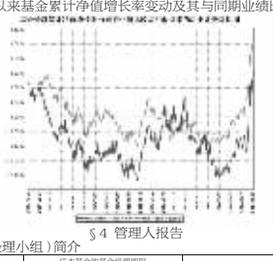
注 2:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	26.56%	1.79%	26.41%	0.99%	0.15%	0.80%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许文明	本基金基金经理	2014年7月9日	-	6	许文明先生,复旦大学世界经济专业硕士。历任亿通国际股份有限公司软件工程师,索科思软件测试上海有限公司测试主管,毕马威恒信会计事务所上海分所风险咨询顾问,光大证券股份有限公司行业分析师、策略分析师、策略研究院副总经理。2012年5月进入东分司工作,曾任研究部总监兼首席策略分析师、基金经理助理。2014年7月至今任中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注1:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

注2:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为,不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确的定。公司通过制定研究、交易等相关制度,要求公司各组合研究成果共享,投资交易指令统一下达至交易室,由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易,使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实;同时,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的同日反向交易。对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易,由公司风险管理部对相关交易价格进行事前审核,风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况,对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况,风险管理部均根据制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留痕。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年全年经济增速下滑,工业增加值增速从8%回落至7.2%,汇丰PMI指数一路下滑至49.6的荣枯线下方。针对低迷的经济增速,央行货币政策动作不断,除了已经使用过的手段一降低公开市场正回购利率之外,还首创中期借贷便利(简称MLF),期限3个月,利率3.5%,9月和10月,央行通过MLF向国有商业银行、股份制商业银行、较大规模的城市商业银行和农村商业银行等分别投放基础货币5000亿元和2695亿元。同时,央行还确认通过补充贷款工具(PSL)为开发性金融支持棚户区改造提供了长期稳定、成本适当的资金额度。另外,本季度央行还祭出降息的大招,自2014年11月22日起下调金融机构人民币贷款和存款基准利率。金融机构一年期贷款基准利率下调0.4个百分点至5.6%;一年期存款基准利率下调0.25个百分点至2.75%,同时结合推进利率市场化改革,将金融机构存款利率浮动区间的上限由存款基准利率的1.1倍调整为1.2倍;其他各档次贷款和存款基准利率相应调整,并对基准利率期限档次作适当简并。在各种宽松的货币政策刺激下,债券市场一路高歌,10年期国债收益率从4%下滑至年底2.60%附近,10年期国开债收益率从4.73%下滑至年底的4.05%附近,本季度成为今年债券收益率下降幅度最大的一个季度。市场资金面从11月中旬开始出现较大的转折,货币市场利率持续走高,这也是造成债券市场年底调整的主要因素。

本基金在四季度仍然是基于流动性的考虑来安排日常投资,在结构上相对均衡,银行间短期融资券和银行存款为主要投资品种。在操作上,各资产类别严格按照法规要求,没有出现流动性风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,报告期内本基金A净值收益率为1.0424%,高于业绩比较基准0.7166个百分点;报告期内本基金B净值收益率为1.1037%,高于业绩比较基准0.7779个百分点。

§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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	150,015,128.86	67.39
	其中:股票	150,015,128.86	67.39
2	固定收益投资	38,677,331.03	17.37
	其中:债券	38,677,331.03	17.37
	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:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,304,311.63	5.08
7	其他资产	22,622,252.47	10.16
8	合计	222,619,023.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	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	41,448,962.48	21.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,651,648.70	4.53
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	861,840.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	48,142,016.01	25.21
K	房地产业	41,441,667.75	21.70
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	192,200.00	0.10
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	9,276,793.92	4.86
	合计	150,015,128.86	78.56

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	600030	中信证券	337,500	11,441,250.00	5.99
2	000024	招商地产	404,800	10,682,672.00	5.59
3	600376	首开股份	1,028,171	10,363,963.68	5.43
4	600895	张江高科	696,456	9,276,793.92	4.86
5	600383	金地集团	783,109	8,935,273.69	4.68
6	000338	潍柴动力	282,800	7,717,612.00	4.04
7	000951	中国重汽	372,621	7,705,802.28	4.04
8	601179	中国西电	988,100	7,677,537.00	4.02
9	600048	保利地产	691,059	7,477,258.38	3.92
10	601318	中国平安	92,200	6,888,262.00	3.61

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,000,000.00	10.47
	其中:政策性金融债	20,000,000.00	10.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	18,677,331.03	9.78
8	其他	-	-
9	合计	38,677,331.03	20.26

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五名债券投资明细

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	140213	14国开13	200,000	20,000,000.00	10.47
2	110027	东方转债	46,360	7,937,295.60	4.16
3	110018	国电转债	24,090	4,966,153.50	2.60
4	128005	齐翔转债	17,210	2,232,963.08	1.17
5	110020	南山转债	14,410	2,011,780.10	1.05

5.6 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金报告期期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	248,008.81
2	应收证券清算款	21,113,764.50
3	应收股利	-
4	应收利息	508,484.02
5	应收申购款	751,995.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,622,252.47

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110018	国电转债	4,966,153.50	2.60
2	128005	齐翔转债	2,232,963.08	1.17
3	110020	南山转债	2,011,780.10	1.05
4	128006	长青转债	1,529,138.75	0.80

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	264,455,944.03
报告期期间基金总申购份额	20,418,283.02
减:报告期期间基金总赎回份额	104,398,483.28
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	180,475,743.77

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内,基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准募集中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金的文件

2、中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同

3、中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议

4、中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

8.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话:(021)38789788或400-888-9788

公司网址:http://www.zhfund.com

中海基金管理有限公司
2015年1月20日

中海货币市场证券投资基金

【2014】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:2015年1月20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2015年1月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中海货币
基金主代码	392001
交易代码	392001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年7月28日
报告期末基金份额总额	2,584,953,309.03份
投资目标	在保证资产安全与资产充分流动性前提下,追求高于业绩比较基准的收益率,为基金份额持有人创造稳定的当期收益。
投资策略	1、利率预期策略 根据对宏观经济和利率走势的分析,本基金将制定利率预期策略。如果预期利率下降,将增加组合的久期;反之,如果预期利率将上升,则缩短组合的久期。 2、期限结构配置策略 各类债券资产在期限结构上的配置是本基金所选择的收益率曲线策略在资产配置过程中的具体体现,本基金采用总收益分析法在子弹组合、杠铃组合、梯形组合等三种基础类型中进行选择。 3、类属配置策略 根据各类短期固定收益类金融工具的市场规模、收益性和流动性,决定各类资产的配置比例,再通过评估各类资产的流动性和收益性利差,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。 4、流动性管理策略 在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下,通过基金资产安排(包括现金库存、资产变现、债券期限管理或以其他融资),保证基金资产的高流动性。 5、�息利策略 本基金的剥利策略主要是利用不同市场、不同期限和不同品种之间的收益率差异,通过融入和融出的资金安排,获取无风险的利差收益。
业绩比较基准	同期7天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属货币市场证券投资基金,为证券投资基金中的低风险品种。 本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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
下属两级基金的基金简称	中海货币A / 中海货币B
下属两级基金的交易代码	392001 / 392002
报告期末下属两级基金的份额总额	289,299,993.07份 / 2,295,653,315.96份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年10月1日 - 2014年12月31日)	
	中海货币A	中海货币B
1. 本期已实现收益	4,301,849.46	20,383,070.93
2. 本期利润	4,301,849.46	20,383,070.93
3. 期末基金资产净值	289,299,993.07	2,295,653,315.96

注1:本报告期是指自2014年10月1日至2014年12月31日。

注2:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

注3:本基金收益分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

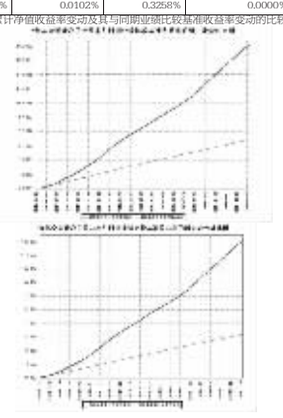
中海货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0424%	0.0102%	0.3258%	0.0000%	0.7166%	0.0102%

中海货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1037%	0.0102%	0.3258%	0.0000%	0.7779%	0.0102%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯小波	本基金基金经理、中海纯债债券型证券投资基金基金经理	2012年10月26日	-	12	冯小波先生,上海交通大学管理科学与工程专业硕士。历任华泰保险股份有限公司交易员,平安证券股份有限公司投资经理,兴业银行股份有限公司债券交易员、高级副理。2012年8月进入本公司工作,任职于投研中心。2012年10月至今任中海货币市场证券投资基金基金经理,2014年4月至今任中海纯债债券型证券投资基金基金经理。

注1:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

注2:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为,不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度,要求公司各组合研究成果共享,投资交易指令统一下达至交易室,由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易,使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实;同时,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的同日反向交易。对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易,由公司风险管理部对相关交易价格进行事前审核,风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,进行了相关的假设检验,对于相关溢价金额对组合收益率的贡献进行了重要性分析,并针对交易占优次数进行了时间序列分析。多维度的公平交易监控指标使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期,公司根据制度要求,对不同组合不同时间段的反向交易进行了统计分析,对于出现的公司制度中规定的异常交易,均要求相关当事人和审批人按照公司制度要求予以留痕。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况,对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况,风险管理部均根据制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留痕。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度经济基本面没有较大变化,宏观经济数据表现仍然疲弱,工业增加值、固定资产投资等数据都比较低迷,物价数据也处于较低区间,通货紧缩的压力有所显现。随着经济和通胀再度下行,政策宽松力度随之加大,SLF、MLF、PSL、下调正回购利率等措施轮番上阵,央行突然降息超出市场预期,宽松的流动性导致了建筑、银行、券商、保险、交通运输等低估值蓝筹板块快速估值修复的上涨行情,其他跟随改革方向和国家政策指向的比如"一路一带"、国企改革、"京津冀一体化"等行业和个股品种表现强劲。A股市场指数四季度表现靓丽,上证综指、深成指分别在四季度录得36.84%、31.31%的季度涨幅。

50指数增强基金在本季度主要以跟踪指数为目标,基金业绩4季度基本跟住基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金份额净值1.053元(累计净值1.053元)。报告期内本基金净值增长率为55.31%,低于业绩比较基准0.57个百分点。

§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	271,731,322.48	92.12
	其中:股票	271,731,322.48	92.12
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	14,860,758.85	5.04
7	其他资产	8,368,285.41	2.84
8	合计	294,960,366.74	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	738,052.08	0.25
B	采矿业	8,357,041.29	2.88
C	制造业	48,603,082.15	16.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,658,166.88	2.64
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,019,396.66	2.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,791,189.98	2.00
J	金融业	180,570,815.96	62.22
K	房地产业	4,604,753.96	1.59
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	1,530,704.00	0.53
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	1,507,450.12	0.52
	合计	265,380,653.08	91.45

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	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	采掘业	2,223,200.00	0.77
C	制造业	4,127,469.40	1.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
	合计	6,350,669.40	2.19

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

5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	334,608	24,998,563.68	8.61
2	600016	民生银行	1,898,532	20,656,028.16	7.12
3	600036	招商银行	1,152,598	19,121,600.82	6.59
4	600030	中信证券	548,931	18,608,760.90	6.41
5	600837	海通证券	565,517	13,606,339.02	4.69
6	601166	兴业银行	784,400	12,942,600.00	4.46
7	600000	浦发银行	765,379	12,008,796.51	4.14
8	601818	光大银行	1,627,467	7,942,038.96	2.74
9	601668	中国建筑	1,051,946	7,658,166.88	2.64
10	601328	交通银行	1,088,464	7,401,555.20	2.55

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600259	广晟有色	40,000	2,223,200.00	0.77
2	600420	现代制药	69,940	1,462,445.40	0.50
3	000831	五矿稀土	40,000	1,199,600.00	0.41
4	300034	钢研高纳	34,950	752,124.00	0.26
5	002347	泰尔重工	70,000	713,300.00	0.25

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金报告期期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	45,650.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,981.91
5	应收申购款	8,319,653.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,368,285.41

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	236,710,159.59
报告期期间基金总申购份额	224,765,965.56
减:报告期期间基金总赎回份额	186,003,432.95
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	275,472,692.20

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内,基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准募集中海上证50指数增强型证券投资基金的文件

2、中海上证50指数增强型证券投资基金基金合同

3、中海上证50指数增强型证券投资基金托管协议

4、中海上证50指数增强型证券投资基金财务报表及报表附注

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

8.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话:(021)38789788或400-888-9788

公司网址:http://www.zhfund.com

中海基金管理有限公司
2015年1月20日

中海上证50指数增强型证券投资基金

【2014】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:2015年1月20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2015年1月16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