

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
报告日期:2015年3月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性及完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经于二〇一五年三月二十五日经公司董事会审核通过。

基金托管人的法定代表人、托管部门负责人及从事基金托管业务的高级管理人员在本年度报告上签字确认,并声明不存在虚假记载、误导陈述或者重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表未来表现,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及其更新。

本基金报告期自2014年1月1日起至2014年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 中海安鑫保本混合
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年7月31日
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
报告期末基金份额总额 159,593,929.65份
基金净值公告期 不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 通过采用保本投资策略,在保证本金安全的前提下,力争为持有人带来稳定的收益。

1.CPPR策略:投资于货币市场工具,通过设置仓位限制,对安全资产与风险资产按比例进行动态调整,降低整体风险。

2.OPI策略:主要投资于股票的稳定收益,在该策略中同时买入股票、债券、货币市场工具等资产,以期获得股票的稳定收益,可执行股票申购、当期股息分配时,则选择执行股票卖出。

3.组合化投资策略:

(1)久期匹配策略:根据市场利率变化趋势,适时调整组合久期,从而达到久期匹配的目的。

(2)期限匹配策略:通过研究收益率曲线形态,在子弹组合、杠铃组合和梯子组合中选取风险收益比最高的投资策略。

4.个贷投资策略:

5.股票投资策略:在股票投资方面,选择具有稳定收益的品种,选择价值低估的股票,并根据股票的市盈率、市净率、市现率等指标进行筛选,进而选择买入股票并长期持有。

(6)信用债投资策略:选择具有较高信用级别的债券品种,选择信用利差较大的品种,并根据信用利差的变化进行择时操作。

(7)可转债投资策略:选择具有较好转股价值的可转债品种,然后根据可转债的条款进行分析,形成对基础股票的评价结论,并结合评价后将两者结合在一起,选择市场低估的品种,以合理的价格买入并长期持有。

6.新股申购策略:选择具有较好新股申购条件的上市公司进行投资。

7.定期存款策略:选择具有较好定期存款条件的银行进行投资。

8.货币市场工具策略:选择具有较好货币市场工具投资条件的品种,选择流动性强的品种,并根据品种的收益率变化进行择时操作。

9.其他投资策略:选择具有较好投资条件的品种,并根据品种的收益率变化进行择时操作。

投资策略

选择具有较好投资条件的品种,并根据品种的收益率变化进行择时操作。

10.国债逆回购策略:选择具有较好国债逆回购条件的品种,并根据品种的收益率变化进行择时操作。

11.股票质押回购策略:选择具有较好股票质押回购条件的品种,并根据品种的收益率变化进行择时操作。

12.企业债投资策略:选择具有较好企业债投资条件的品种,并根据品种的收益率变化进行择时操作。

13.可分离债投资策略:选择具有较好可分离债投资条件的品种,并根据品种的收益率变化进行择时操作。

14.股票期权策略:选择具有较好股票期权投资条件的品种,并根据品种的收益率变化进行择时操作。

15.股指期货策略:选择具有较好股指期货投资条件的品种,并根据品种的收益率变化进行择时操作。

16.国债期货策略:选择具有较好国债期货投资条件的品种,并根据品种的收益率变化进行择时操作。

17.商品期货策略:选择具有较好商品期货投资条件的品种,并根据品种的收益率变化进行择时操作。

18.黄金期货策略:选择具有较好黄金期货投资条件的品种,并根据品种的收益率变化进行择时操作。

19.期权策略:选择具有较好期权投资条件的品种,并根据品种的收益率变化进行择时操作。

20.其他策略:选择具有较好其他投资条件的品种,并根据品种的收益率变化进行择时操作。

21.基金基本概念

基金的基本概念是投资人通过购买基金,获得基金的收益,并承担基金的风险。

22.基金产品说明

投资目标 通过采用保本投资策略,在保证本金安全的前提下,力争为持有人带来稳定的收益。

23.基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 中海基金管理有限公司 上海浦东发展银行股份有限公司

姓名 王莉 邓丽

信息披露负责人 联系电话 021-38429808 021-61188888

电子邮箱 wangli@zifund.com Liao@sdifund.com.cn

客户服务电话 400-888-9788-021-38798788 9528

传真 021-68419525 021-63602540

24.信息披露方式

基金管理人通过互联网发布正式的管理人互联网网址 www.zifund.com

基金年度报告备置地点 上海市浦东新区银城中路698号2908-2908室及30层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1 本期期间数据和指标 2014年 2013年7月31日至2014年12月31日 2012年

本期已实现收益 17,479,982.42 2,044,884.08 -

本期利润 23,540,545.79 -67,884.34 -

加权平均基金份额本期利润 0.1071 -0.0023 -

本期基金份额净值增长率为 11.43% -0.30% -

3.1.2 期末可供分配利润 2014年末 2013年末 2012年末

期末可供分配基金份额利润 0.1029 -0.0025 -

期末基金资产净值 177,307,070.50 266,347,465.45 -

期末可供分配基金份额净值 1.111 0.997 -

注:1.本基金报告期自2014年1月1日至2014年12月31日。
注:2.以上所列基金的基本指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如,申购、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于不计费用的水平。
注:3.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。
注:4.本期利润是指基金在报告期已实现收益减去基金的管理费后的余额。

§ 4 报告期内基金的利润分配情况

§ 5 评估结果

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

审计报告文号 是 审计报告日期 2014年6月20日

审计类型 标准无保留意见

审计报告编号 普华永道中天审字(2014)第21428号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题 审计报告

审计报告收件人 中海安鑫保本混合型证券投资基金全体持有人

审计报告出具日期 2014年6月20日

审计报告披露日期 2014年6月20日

审计报告提醒事项 无

6.3 审计报告的主要内容

6.3.1 基本事项

6.3.2 审计意见

6.3.3 管理层和注册会计师的责任

6.3.4 审计报告使用者的范围

6.3.5 审计报告的日期和报告者

6.3.6 其他事项

6.4 审计报告的附录

6.5 审计报告的披露

6.6 审计报告的复核

6.7 审计报告的比较数据

6.8 审计报告的附录

6.9 审计报告的附录

6.10 审计报告的附录

6.11 审计报告的附录

6.12 审计报告的附录

6.13 审计报告的附录

6.14 审计报告的附录

6.15 审计报告的附录

6.16 审计报告的附录

6.17 审计报告的附录

6.18 审计报告的附录

6.19 审计报告的附录

6.20 审计报告的附录

6.21 审计报告的附录

6.22 审计报告的附录

6.23 审计报告的附录

6.24 审计报告的附录

6.25 审计报告的附录

6.26 审计报告的附录

6.27 审计报告的附录

6.28 审计报告的附录

6.29 审计报告的附录

6.30 审计报告的附录

6.31 审计报告的附录

6.32 审计报告的附录

6.33 审计报告的附录

6.34 审计报告的附录

6.35 审计报告的附录

6.36 审计报告的附录

6.37 审计报告的附录

6.38 审计报告的附录

6.39 审计报告的附录

6.40 审计报告的附录

6.41 审计报告的附录

6.42 审计报告的附录

6.43 审计报告的附录

6.44 审计报告的附录

6.45 审计报告的附录

6.46 审计报告的附录

6.47 审计报告的附录

6.48 审计报告的附录

6.49 审计报告的附录

6.50 审计报告的附录

6.51 审计报告的附录

6.52 审计报告的附录

6.53 审计报告的附录

6.54 审计报告的附录

6.55 审计报告的附录

6.56 审计报告的附录

6.57 审计报告的附录

6.58 审计报告的附录

6.59 审计报告的附录

6.60 审计报告的附录

6.61 审计报告的附录

6.62 审计报告的附录

6.63 审计报告的附录

6.64 审计报告的附录

6.65 审计报告的附录

6.66 审计报告的附录

6.67 审计报告的附录

6.68 审计报告的附录