

中海量化策略股票型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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7月20日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员保证本基金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承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，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。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	中海量化策略股票	
基金代码	399041	
交易代码	399041	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年6月24日	
报告期末基金份额总额	100,469,161.67份	
报告期末基金资产净值	人民币100,469,161.67元	
报告期末基金份额净值	人民币1.00元	
报告期末基金份额净值增长率	12.28%	
报告期末基金份额净值增长率标准差	2.24%	
报告期末基金份额净值增长率最大回撤	9.11%	
报告期末基金份额净值增长率年度化波动率	20.09%	
报告期末基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率之差	3.17%	
报告期末基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率之差的标准差	0.16%	

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	820,000.00	0.08	
B 制造业	194,260.75	0.17	
C 制造业	36,817,093.22	39.71	
D 电子、通信、计算机应用	236,260.00	0.26	
E 建筑业	6,369,115.80	5.81	
F 制造业和修理	106,264.00	0.12	
G 交通运输、仓储和邮政业	3,179,100.00	3.43	
H 食品、饮料和烟草	-	-	
I 信息技术、软件和信息技术服务业	26,329,101.00	28.40	
J 金融业	14,236,737.00	15.36	
K 地产行业	110,189.75	0.12	
L 租赁和商务服务业	40,869.35	0.04	
M 科学研究和技术服务业	-	-	
N 环境保护、公共设施管理业	20,654.00	0.02	
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	41,060.00	0.04	
S 合计	-	-	
报告期末按行业分类的股票投资组合	87,465,060.00	100.00	

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	820,000.00	0.08	
B 制造业	194,260.75	0.17	
C 制造业	36,817,093.22	39.71	
D 电子、通信、计算机应用	236,260.00	0.26	
E 建筑业	6,369,115.80	5.81	
F 制造业和修理	106,264.00	0.12	
G 交通运输、仓储和邮政业	3,179,100.00	3.43	
H 食品、饮料和烟草	-	-	
I 信息技术、软件和信息技术服务业	26,329,101.00	28.40	
J 金融业	14,236,737.00	15.36	
K 地产行业	110,189.75	0.12	
L 租赁和商务服务业	40,869.35	0.04	
M 科学研究和技术服务业	-	-	
N 环境保护、公共设施管理业	20,654.00	0.02	
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	41,060.00	0.04	
S 合计	-	-	
报告期末按行业分类的股票投资组合	87,465,060.00	100.00	

报告期末按行业分类的股票投资组合

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	600400	国阳新能	200,000	4,136,000.00	4.40
2	002439	三维丝	120,000	4,116,000.00	4.44
3	000831	五矿稀土	160,000	4,092,800.00	4.41
4	000720	韶能A	360,000	3,614,000.00	3.90
5	300089	硕贝德	70,000	3,570,000.00	3.95
6	600000	中行证券	320,000	3,229,000.00	3.49
7	300013	丽珠集团	320,000	3,109,200.00	3.36
8	000697	深信泰丰	100,000	2,956,000.00	3.19
9	300296	三川智慧	25,000	2,894,750.00	3.11
10	000961	中广核技	94,542	2,815,400.76	3.04
报告期末按行业分类的股票投资组合	87,465,060.00	100.00			

报告期末按行业分类的股票投资组合

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	600400	国阳新能	200,000	4,136,000.00	4.40
2	002439	三维丝	120,000	4,116,000.00	4.44
3	000831	五矿稀土	160,000	4,092,800.00	4.41
4	000720	韶能A	360,000	3,614,000.00	3.90
5	300089	硕贝德	70,000	3,570,000.00	3.95
6	600000	中行证券	320,000	3,229,000.00	3.49
7	300013	丽珠集团	320,000	3,109,200.00	3.36
8	000697	深信泰丰	100,000	2,956,000.00	3.19
9	300296	三川智慧	25,000	2,894,750.00	3.11
10	000961	中广核技	94,542	2,815,400.76	3.04
报告期末按行业分类的股票投资组合	87,465,060.00	100.00			

报告期末按行业分类的股票投资组合

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	600400	国阳新能	200,000	4,136,000.00	4.40
2	002439	三维丝	120,000	4,116,000.00	4.44
3	000831	五矿稀土	160,000	4,092,800.00	4.41
4	000720	韶能A	360,000	3,614,000.00	3.90
5	300089	硕贝德	70,000	3,570,000.00	3.95
6	600000	中行证券	320,000	3,229,000.00	3.49
7	300013	丽珠集团	320,000	3,109,200.00	3.36
8	000697	深信泰丰	100,000	2,956,000.00	3.19
9	300296	三川智慧	25,000	2,894,750.00	3.11
10	000961	中广核技	94,542	2,815,400.76	3.04
报告期末按行业分类的股票投资组合	87,465,060.00	100.00			

报告期末按行业分类的股票投资组合

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	600400	国阳新能	200,000	4,136,000.00	4.40
2	002439	三维丝	120,000	4,116,000.00	4.44
3	000831	五矿稀土	160,000	4,092,800.00	4.41
4	000720	韶能A	360,000	3,614,000.00	3.90
5	300089	硕贝德	70,000	3,570,000.00	3.95
6	600000	中行证券	320,000	3,229,000.00	3.49
7	300013	丽珠集团	320,000	3,109,200.00	3.36
8	000697	深信泰丰	100,000	2,956,000.00	3.19
9	300296	三川智慧	25,000	2,894,750.00	3.11
10	000961	中广核技	94,542	2,815,400.7	