

中海增强收益债券型证券投资基金

2015年6月30日

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6月29日

基金份额持有人的基金份额不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
本基金由中海基金管理有限公司根据基金合同约定,于2015年6月1日正式发布了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证不存在虚假记载、误导陈述或者重大遗漏。
本基金的业经审计并代表未在本报告。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2015年6月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称 中海增强收益债券

基金主代码 395011

交易代码 395011

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2011年3月31日

报告期末基金份额总额 134,069,877.33份

投资目标 在充分重视本基金管理的安全前提下,力争为基金份额持有人创造稳定的投资回报。

投资策略 1. “绝对”配置
本基金采取自上而下的分析方法,比较不同市场和金融工具的投资风险及风险特征,动态确定基金资产在固定收益类资产、权益类资产资产中的配置比例。
(1)长期机构化,优先考虑长期利率曲线模型对各期限收益率的影响,通过分析宏观经济周期、政策预期、资金流向、资金成本、资金需求等指标,预测未来利率走势。
(2)中期机构化,优先考虑中长期利率曲线模型对各期限收益率的影响,通过分析宏观经济周期、政策预期、资金流向、资金成本、资金需求等指标,预测未来利率走势。
(3)短期机构化选择个券选择,个券选择的原因为:①久期较短的品种;②流动性强的品种;③信用等级较高的品种;④票面利率较高的品种;⑤流动性强的品种。
2. “相对”配置
本基金二级市场的投资策略是精选红利优选择投资策略,通过运用分红策略和个股模型,精选出具有分红潜力的高股息率股票,并结合二级市场的股价表现,挑选出性价比高的股票。
3. “绝对”和“相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

4. “绝对”配置
本基金投资二级市场的策略是精选红利优选择投资策略,通过运用分红策略和个股模型,精选出具有分红潜力的高股息率股票,并结合二级市场的股价表现,挑选出性价比高的股票。

5. “相对”配置
本基金在综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

6. “绝对”和“相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

7. “绝对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

8. “相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

9. “绝对”和“相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

10. “绝对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

11. “相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

12. “绝对”和“相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

13. “绝对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

14. “相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

15. “绝对”和“相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

16. “绝对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

17. “相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

18. “绝对”和“相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

19. “绝对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

20. “相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

21. “绝对”和“相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

22. “绝对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

23. “相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

24. “绝对”和“相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

25. “绝对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

26. “相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

27. “绝对”和“相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

28. “绝对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

29. “相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

30. “绝对”和“相对”配置
本基金将综合运用绝对收益法和相对收益法,在投资过程中根据宏观经济环境的宏观性风险,寻找驱动因素以及收益驱动因素变化的驱动因素,适时调整资产配置比例。

31. 主要财务指标

报告期:2015年4月1日 - 2015年6月30日

单位:人民币元

主要财务指标 报告期初基金资产净值/报告期末基金资产净值

报告期初基金份额总额/报告期末基金份额总额

报告期利息收入/报告期利息支出

报告期手续费/报告期佣金

报告期管理人报酬/报告期托管费

报告期申购赎回费用/报告期申购赎回费用

报告期其他收入/报告期其他支出

报告期税项/报告期所得税

报告期投资收益/报告期公允价值变动损益

报告期净利得/报告期净亏

报告期利润/报告期亏损

报告期加权平均基金份额利润率/报告期加权平均基金份额亏损率

报告期净值增长率/报告期净值增长率标准差

报告期净值增长率/报告期净值增长率标准差