

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
送出日期:2015年8月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对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的责任。基金托管人对本基金信息全文及其摘要自成立之日起至报告期末没有进行任何更新，因此对报告期末之前的信息不承担复核责任。

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司以下简称“浦发银行”。根据本基金合同规定，于2015年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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认真阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中海安鑫保本混合型证券投资基金
基金代码	000166
交易代码	000166
基金份额方式	契约型开放式
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

定期定额申购的总额

106,230,030.49元

基金的存续期

不定期

2.2 基金产品说明

投资目标

通过采用保本策略，在保证本金安全的前提下，力争在本期实现基金资产的增值。

本基金以CPPI策略为主，即通过资产配置和资产组合管理，其中主要通过CPPI策略动态调整资产配置，从而在保证本金安全的前提下，通过股票、债券等资产的配置，力争在本期实现基金资产的增值。

风险收益特征

本基金为保本混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

2.3 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

王君

权限

督察

信息披露负责人

联系电话

021-38429008

电子邮箱

wangj@zifuhu.com

客户服务电话

400-888-9788-021-38789798

传真

021-68196265

3.1 主要数据概要和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 利润数据和费用

报告期2015年1月1日至2015年6月30日

本期净收益

33,592,990.26

本期利润

37,018,672.10

加权平均基金份额利润

0.2900

本期的每份额净资产收益率

26.00%

3.1.2 利润和费用

报告期2015年6月30日

本期利润

0.2700

期末可供分配利润

140,630,900.30

3.2.1 基金份额表现

3.2.1.1 基金份额增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段

份额净增长率

份额净值增长

业绩比较基准收益率

①-③

②-③

自基金成立以来至今

-31.8% 1.18% 0.25% -0.01% -3.43% 11.7%

过去一个月 15.72% 1.10% 0.74% 0.01% 14.98% 1.00%

过去三个月 26.92% 0.89% 1.56% 0.01% 24.37% 0.98%

过去六个月 36.00% 0.70% 3.44% 0.01% 32.05% 0.69%

过去一年 36.00% 0.51% 7.06% 0.01% 32.84% 0.50%

3.2.2 自基金合同期以来

注:1)以上所述基金业绩报酬不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购、赎回费等),计价后用货币形式支付的。

注:2)本期实现收益扣除本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.3 基金净值表现

3.2.3.1 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

份额净值增长率

份额净值增长

业绩比较基准收益率

①-③

②-③

自基金成立以来至今

-31.8% 1.18% 0.25% -0.01% -3.43% 11.7%

过去一个月 15.72% 1.10% 0.74% 0.01% 14.98% 1.00%

过去三个月 26.92% 0.89% 1.56% 0.01% 24.37% 0.98%

过去六个月 36.00% 0.70% 3.44% 0.01% 32.05% 0.69%

过去一年 36.00% 0.51% 7.06% 0.01% 32.84% 0.50%

3.2.4 基金合同生效以来基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购、赎回费等)

3.2.5 自基金合同期以来基金份额累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.6 3.3.1 会计主体:中海安鑫保本混合型证券投资基金

本报告期内:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

3.3.1 利润数据和费用

报告期2015年1月1日至2015年6月30日

本期净收益

33,592,990.26

本期利润

37,018,672.10

加权平均基金份额利润

0.2900

本期的每份额净资产收益率

26.00%

3.3.2 利润和费用

报告期2015年6月30日

本期利润

0.2700

期末可供分配利润

140,630,900.30

3.3.3 基金份额表现

3.3.3.1 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

份额净值增长率

份额净值增长

业绩比较基准收益率

①-③

②-③

自基金成立以来至今

-31.8% 1.18% 0.25% -0.01% -3.43% 11.7%

过去一个月 15.72% 1.10% 0.74% 0.01% 14.98% 1.00%

过去三个月 26.92% 0.89% 1.56% 0.01% 24.37% 0.98%

过去六个月 36.00% 0.70% 3.44% 0.01% 32.05% 0.69%

过去一年 36.00% 0.51% 7.06% 0.01% 32.84% 0.50%

3.3.4 基金合同生效以来

注:1)以上述日期起,即2015年7月31日基金合同生效日至2015年6月30日。

注:2)自基金合同生效日起至最近一个开放日止,基金合同规定的各项费率、费用(例如赎回费等)不适用于本基金。

注:3)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:4)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:5)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:6)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:7)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:8)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:9)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:10)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:11)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:12)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:13)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:14)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:15)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:16)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:17)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:18)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:19)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:20)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:21)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:22)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:23)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:24)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述条款,并提前公告。

注:25)基金管理人根据法律法规及基金合同的规定,可以决定本基金不再适用上述