

## 中海能源策略混合型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

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10月24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10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、持有人数和资产净值等数据，确保本报告所载的信息不存在虚假记载、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。

本报告期间自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 中海能源策略混合

基金主代码 390021

交易代码 390021

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2007年3月13日

报告期末基金份额总额 2,181,874,980.07份

投资目标 在世界经济金融环境的中国经济增长模式向市场机制的背景下，以地域为投资主题，盘点具备竞争优势的行业和企业，精选一个或多个子行业，通过股票、债券、权证、货币市场工具等投资品种的合理配置，力争实现基金资产的长期增值。

投资策略 1.一揽子投资：本基金将根据国内外的经济形势变化，综合考虑宏观经济分析和行业分析，根据行业景气度和估值水平，选择具有较好投资价值的行业，进行行业配置；

(ASVVM, A Share Stock Value Valuation Model)，从股票基本面分析和股票估值两个方面入手，对股票进行筛选，从而构建股票组合；

本基金托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10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、持有人数和资产净值等数据，确保本报告所载的信息不存在虚假记载、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。

本报告期间自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 – 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -363,302,246.70

-644,706,107.63

-0.2010

2.期末可供分配利润 1,526,502,463.08

0.0907

3.期末基金资产净值 300,000,000.00

上证综合指数涨跌幅 -3.36%

业绩比较基准

本基金拟以资产净值占基金本利得收入、股息收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和相关费用后的余额，本报告期间三季报加权上期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 – 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -363,302,246.70

-644,706,107.63

-0.2010

2.期末可供分配利润 1,526,502,463.08

0.0907

3.期末基金资产净值 300,000,000.00

上证综合指数涨跌幅 -3.36%

业绩比较基准

本基金拟以资产净值占基金本利得收入、股息收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和相关费用后的余额，本报告期间三季报加权上期公允价值变动收益。

3.2.1 本期主要财务指标与上期同期指标的比较

阶段 ①-③ ②-④

过去三个月 -0.203% 2.4% -18.40% -2.1% -10.37% 0.03%

3.2.2 基金合同生效以来基金净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金净值增长率 变动幅度 (%) 同期业绩比较基准收益率 变动幅度 (%) 业绩比较基准收益率 变幅 (%)

注：本基金报告期未持有债券。

5.4 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时间 证券从业年限 说明

开文明 基金基金经理兼投资总监、基金经理 2015年3月12日 - 7年 张文明先生，复旦大学世界经济系毕业，历任交通银行总行零售金融部产品经理，国泰君安软件工程师，上海万邦证券投资分析师，先后担任工银瑞信基金公司测试员、单点威廉斯分析师、基金经理助理、光大证券股份有限公司高级研究员、分析师、基金经理，现任本公司基金经理。2012年6月入职本公司，担任基金经理，2013年1月担任基金经理兼投资总监，2014年1月担任基金经理兼投资总监，2015年3月担任基金经理兼投资总监，2015年6月担任基金经理兼投资总监，2015年9月担任基金经理兼投资总监。

姚巍巍 基金基金经理兼投资总监、基金经理 2015年4月17日 - 8年 姚巍巍先生，复旦大学金融学专业硕士，曾任上海银行国际业务研究处二部分分析员，2007年1月加入本公司，历任公司工作、分析员、基金经理助理、研究员、基金经理、基金经理兼投资总监，2014年1月担任基金经理兼投资总监，2015年4月担任基金经理兼投资总监，2015年6月担任基金经理兼投资总监，2015年9月担任基金经理兼投资总监。

注：上述任职日期、任期自即日起根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

注：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 管理人对报告期内基金运作遵规守法情况的说明

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》的约定，不存在损害基金持有人利益的行为，不存在违法决策或内幕交易行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金公平交易管理制度指引》公平交易制度的执行情况，不同时间段内不同的投资组合之间不存在利益输送行为，不存在不公平交易和利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的经营业绩及行业排名

4.4.1 报告期内基金的经营业绩和行业排名

2015年4季度，随着公布的经济数据表明，宏观经济进一步恶化，积极的财政政策进一步加码，相对宽松的货币

政策依然延续。期间受到人民币贬值的影响，全球市场都出现了一定程度的恐慌，部分资金加速流出中国，中国的外汇占款数据出现较大程度的下滑；此外，监管层开始规范和限制配资和伞形信托，在这样的背景下，A股市场出现了进一步的下跌。不过在此后，央行对人民币汇率进行了一定程度的干预，加上美联储没有在9月份的议息会议中降息，期间人民币汇率有所企稳。

本基金在报告期内的股票仓位维持在较低的水平，在行业配置方面主要以交运、食品饮料、医药

、钢铁、轻工制造、电子等行业为主，同时配置了部分的金融股和周期股。

4.4.2 报告期内基金的经营业绩和行业排名

截至2015年9月30日，本基金份额净值1.247元/份。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

本基金管理人持有的基金资产运用有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金的变动情况

7.2 中海能源策略混合型证券投资基金的运作情况

7.3 中海能源策略混合型证券投资基金托管费的计提方法

7.4 报告期内基金的费用情况

7.5 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.6 报告期内基金的利润分配情况

7.7 报告期内基金的费用调整情况

7.8 报告期内基金的收益分配情况

7.9 报告期内基金的费用减免情况

7.10 报告期内基金的其他费用

7.11 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.12 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.13 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.14 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.15 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.16 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.17 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.18 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.19 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.20 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.21 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.22 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.23 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.24 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.25 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.26 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.27 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.28 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.29 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.30 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.31 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.32 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.33 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.34 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.35 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.36 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.37 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.38 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.39 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.40 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.41 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.42 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.43 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.44 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.45 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.46 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.47 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.48 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.49 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.50 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.51 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.52 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.53 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.54 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.55 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.56 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.57 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.58 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.59 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.60 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.61 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.62 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.63 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.64 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.65 报告期内基金管理人运用固有