

中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金

[2015]第四季度报告

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董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，并对其实质性、准确性、完整性和诚实性承担个别法律责任。

基金托管人:招商银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、持有人数和资产净值等数据,确认本报告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

4.2 报告期内基金的业绩表现

注1:本基金于2015年1月31日,本基金的净值净值1.243元/份,报告期内本基金净值增长率为2.22%,低于业绩比较基准0.53个百分点。

§ 5 投资组合报告

报告期末基金资产组合情况		
序号	项目	
1	权益投资	
其中:股票	-	
2	固定收益投资	
其中:债券	894,841,579.20	
资产支持证券	-	
3	贵金属投资	-
4	金融衍生品投资	-
5	买入返售金融资产	-
其中:质押式回购的买入返售金融资产	-	
6	银行存款和结算备付金合计	11,951,564.94
7	其他资产	32,118,766.00
8	合计	908,911,889.14
	占基金总资产的比例(%)	
100.00		

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.2 报告期利润按行业分类的股息及股利分配情况

5.3 报告期内按公募基金品种比例大小排序的前十名股息投资明细

5.4 报告期按公募基金品种类型的债券投资组合

5.5 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.6 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.7 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.8 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.9 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.10 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.11 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合

5.12 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.13 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名固定收益投资

5.14 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.15 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.16 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.17 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.18 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合

5.19 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.20 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名固定收益投资

5.21 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.22 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.23 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.24 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.25 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合

5.26 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.27 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名固定收益投资

5.28 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.29 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.30 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.31 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.32 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合

5.33 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.34 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名固定收益投资

5.35 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.36 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.37 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.38 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.39 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合

5.40 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.41 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名固定收益投资

5.42 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.43 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.44 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.45 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.46 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合

5.47 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.48 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名固定收益投资

5.49 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.50 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.51 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.52 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.53 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合

5.54 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.55 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名固定收益投资

5.56 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.57 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.58 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.59 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.60 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合

5.61 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.62 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名固定收益投资

5.63 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.64 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.65 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.66 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.67 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合

5.68 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.69 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名固定收益投资

5.70 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.71 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.72 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.73 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.74 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合

5.75 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.76 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名固定收益投资

5.77 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.78 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.79 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.80 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.81 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合

5.82 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.83 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名固定收益投资

5.84 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.85 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.86 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.87 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.88 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合

5.89 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.90 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名固定收益投资

5.91 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.92 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.93 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.94 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.95 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合

5.96 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.97 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名固定收益投资

5.98 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.99 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.10 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.11 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.12 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合

5.13 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.14 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名固定收益投资

5.15 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.16 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.17 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.18 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.19 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合

5.20 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

5.21 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名固定收益投资

5.22 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

5.23 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.24 报告期末按公募基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项</