

中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金

2016 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:中国工商银行股份有限公司

重要提示
基金管理人及基金托管人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。

基金管理人中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金合同规定,于2017年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内,保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金资产净值或收益。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。本报告中的财务资料截止于2016年12月31日。

§ 2 基金产品概况

基金名称:中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金
基金代码:000316

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2016年12月19日

报告期末基金份额总额:81,000,564.68份
报告期末基金份额持有人户数:39,322户

投资目标:本基金投资于国内具有良好发展前景的节能环保、新能源、新材料、生物医药、信息技术、高端装备制造等主题相关行业,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

投资策略:本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。在资产配置上,主要考虑宏观经济周期、政策预期、市场估值、行业景气度等因素,通过对多种策略的合理配置,增加股票资产在其资产配置中的权重,提升基金资产的整体收益水平。

业绩比较基准:中证环保新能源主题指数收益率\*60%+中证综合指数收益率\*40%

风险收益特征:本基金属于中高风险证券投资基金,其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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

3.1 主要财务指标

本报告期:2016年10月1日至2016年12月31日
1.本期利润总额:2,100,833.11

2.本期净利润:-6,405,740.27
3.本期公允价值变动损益:0.00

4.本期经营活动产生的现金流量净额:66,506,790.00
5.本期基金份额持有人权益:70.06

注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购、赎回费),计入费用后实际收益水平可能会低于所列数字。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长, 业绩比较基准, 超额收益, ①-③, ②-④

3.2.2 自基金合同生效以来本基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金自2016年10月1日至2016年12月31日,上述基金业绩指标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),计入费用后实际收益水平可能会低于所列数字。

2.本基金自成立之日起投资范围未发生变化,投资范围、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期间即为本报告期公允价值变动损益。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限, 说明

注:1.上述任职日期,系在日前根据本基金管理人对外披露的任命日期填写。

注:2.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。

注:3.基金经理在报告期内管理过《中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金》及其他有关法律、法规、基金合同规定的,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情况。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
4.2 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度,国内经济延续前几季的回升势头,大宗商品大幅上涨,PP快速回升。中国经济提出“去产能、去库存、降杠杆、补短板、稳增长”五大任务中,去产能和去库存取得显著效果,煤炭和钢铁行业出现供需改善,成功避免了这两个行业可能出现的恶性竞争。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,所有投资组合的公允价值变动反向交易成交较少的单边交易未超过该品种当日成交量的0.5%,对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况,均经风控部合规风控部认定系组合管理提供相关风控提示予以留痕。

4.4 报告期内基金投资运作及业绩分析
四季度,国内经济延续前几季的回升势头,大宗商品大幅上涨,PP快速回升。中国经济提出“去产能、去库存、降杠杆、补短板、稳增长”五大任务中,去产能和去库存取得显著效果,煤炭和钢铁行业出现供需改善,成功避免了这两个行业可能出现的恶性竞争。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2016年12月31日,本基金份额净值为0.836元,报告期内基金份额净值为-6.07%,低于业绩比较基准6.30个百分点。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 权益投资

Table with columns: 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(%)

5.1.2 基金投资的前十名股票中有在报告期内被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票

5.1.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.1.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.1.5 报告期末前十名债券中有在报告期内被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票

5.2 基金持仓集中度
5.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with columns: 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(%)

5.2.2 基金持仓集中度
5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

Table with columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.7 报告期末持有的股指期货合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.8 报告期末持有的国债期货合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.9 报告期末持有的大宗商品期货合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.10 报告期末持有的期权合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.11 报告期末持有的其他衍生品合约

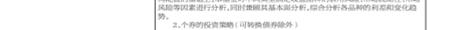
5.3 主要资产组合情况
5.3.1 主要资产组合情况

Table with columns: 主要资产组合, 报告期末公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3.2 自基金合同生效以来基金资产组合比例及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 净值增长, 业绩比较基准, 超额收益, ①-③, ②-④

5.3.3 自基金合同生效以来基金资产组合比例及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.上述任职日期,系在日前根据本基金管理人对外披露的任命日期填写。

注:2.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。

注:3.基金经理在报告期内管理过《中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金》及其他有关法律、法规、基金合同规定的,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情况。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
4.2 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度,国内经济延续前几季的回升势头,大宗商品大幅上涨,PP快速回升。中国经济提出“去产能、去库存、降杠杆、补短板、稳增长”五大任务中,去产能和去库存取得显著效果,煤炭和钢铁行业出现供需改善,成功避免了这两个行业可能出现的恶性竞争。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,所有投资组合的公允价值变动反向交易成交较少的单边交易未超过该品种当日成交量的0.5%,对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况,均经风控部合规风控部认定系组合管理提供相关风控提示予以留痕。

4.4 报告期内基金投资运作及业绩分析
四季度,国内经济延续前几季的回升势头,大宗商品大幅上涨,PP快速回升。中国经济提出“去产能、去库存、降杠杆、补短板、稳增长”五大任务中,去产能和去库存取得显著效果,煤炭和钢铁行业出现供需改善,成功避免了这两个行业可能出现的恶性竞争。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2016年12月31日,本基金份额净值为0.836元,报告期内基金份额净值为-6.07%,低于业绩比较基准6.30个百分点。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 权益投资

Table with columns: 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(%)

5.1.2 基金投资的前十名股票中有在报告期内被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票

5.1.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.1.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.1.5 报告期末前十名债券中有在报告期内被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票

5.2 基金持仓集中度
5.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with columns: 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(%)

5.2.2 基金持仓集中度
5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

Table with columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.6 报告期末持有的股指期货合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.7 报告期末持有的国债期货合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.8 报告期末持有的大宗商品期货合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.9 报告期末持有的期权合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.10 报告期末持有的其他衍生品合约

5.3 主要资产组合情况
5.3.1 主要资产组合情况

Table with columns: 主要资产组合, 报告期末公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3.2 自基金合同生效以来基金资产组合比例及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 净值增长, 业绩比较基准, 超额收益, ①-③, ②-④

5.3.3 自基金合同生效以来基金资产组合比例及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.上述任职日期,系在日前根据本基金管理人对外披露的任命日期填写。

注:2.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。

注:3.基金经理在报告期内管理过《中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金》及其他有关法律、法规、基金合同规定的,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情况。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
4.2 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度,国内经济延续前几季的回升势头,大宗商品大幅上涨,PP快速回升。中国经济提出“去产能、去库存、降杠杆、补短板、稳增长”五大任务中,去产能和去库存取得显著效果,煤炭和钢铁行业出现供需改善,成功避免了这两个行业可能出现的恶性竞争。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,所有投资组合的公允价值变动反向交易成交较少的单边交易未超过该品种当日成交量的0.5%,对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况,均经风控部合规风控部认定系组合管理提供相关风控提示予以留痕。

4.4 报告期内基金投资运作及业绩分析
四季度,国内经济延续前几季的回升势头,大宗商品大幅上涨,PP快速回升。中国经济提出“去产能、去库存、降杠杆、补短板、稳增长”五大任务中,去产能和去库存取得显著效果,煤炭和钢铁行业出现供需改善,成功避免了这两个行业可能出现的恶性竞争。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2016年12月31日,本基金份额净值为0.836元,报告期内基金份额净值为-6.07%,低于业绩比较基准6.30个百分点。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 权益投资

Table with columns: 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(%)

5.1.2 基金投资的前十名股票中有在报告期内被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票

5.1.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.1.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.1.5 报告期末前十名债券中有在报告期内被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票

5.2 基金持仓集中度
5.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with columns: 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(%)

5.2.2 基金持仓集中度
5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

Table with columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.6 报告期末持有的股指期货合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.7 报告期末持有的国债期货合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.8 报告期末持有的大宗商品期货合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.9 报告期末持有的期权合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.10 报告期末持有的其他衍生品合约

5.3 主要资产组合情况
5.3.1 主要资产组合情况

Table with columns: 主要资产组合, 报告期末公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3.2 自基金合同生效以来基金资产组合比例及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with columns: 阶段, 净值增长, 业绩比较基准, 超额收益, ①-③, ②-④

5.3.3 自基金合同生效以来基金资产组合比例及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.上述任职日期,系在日前根据本基金管理人对外披露的任命日期填写。

注:2.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。

注:3.基金经理在报告期内管理过《中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金》及其他有关法律、法规、基金合同规定的,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情况。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
4.2 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度,国内经济延续前几季的回升势头,大宗商品大幅上涨,PP快速回升。中国经济提出“去产能、去库存、降杠杆、补短板、稳增长”五大任务中,去产能和去库存取得显著效果,煤炭和钢铁行业出现供需改善,成功避免了这两个行业可能出现的恶性竞争。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,所有投资组合的公允价值变动反向交易成交较少的单边交易未超过该品种当日成交量的0.5%,对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况,均经风控部合规风控部认定系组合管理提供相关风控提示予以留痕。

4.4 报告期内基金投资运作及业绩分析
四季度,国内经济延续前几季的回升势头,大宗商品大幅上涨,PP快速回升。中国经济提出“去产能、去库存、降杠杆、补短板、稳增长”五大任务中,去产能和去库存取得显著效果,煤炭和钢铁行业出现供需改善,成功避免了这两个行业可能出现的恶性竞争。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2016年12月31日,本基金份额净值为0.836元,报告期内基金份额净值为-6.07%,低于业绩比较基准6.30个百分点。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 权益投资

Table with columns: 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(%)

5.1.2 基金投资的前十名股票中有在报告期内被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票

5.1.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

5.1.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.1.5 报告期末前十名债券中有在报告期内被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票

5.2 基金持仓集中度
5.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with columns: 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(%)

5.2.2 基金持仓集中度
5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

Table with columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.6 报告期末持有的股指期货合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.7 报告期末持有的国债期货合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.8 报告期末持有的大宗商品期货合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.9 报告期末持有的期权合约

Table with columns: 品种, 合约名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.10 报告期末持有的其他衍生品合约

5.3 主要资产组合情况
5