

中海量化策略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
报告送出日期:2017年1月20日

基金管理人的董事会及董事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。

基金托管人和中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定,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报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理承诺:以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表未来表现。投资人投资于基金,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未经审计。

本报告期自2016年10月1日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中海量化策略
基金主代码	399041
交易代码	399041
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月24日
报告期末基金份额总额	79,047,338.07份
投资目标	本基金的投资目标是通过综合运用多种投资策略,在严格控制风险的前提下,追求超越基准的稳定收益。
投资策略	本基金将综合运用多种投资策略,在严格控制风险的前提下,追求超越基准的稳定收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中国国债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、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 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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期实现的收益	808,050.07
2.本期利润	-707,311.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0098
4.期末基金资产净值	72,419,197.22
5.期末基金份额净值	0.9897

注:1)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、赎回费等),计算费用后实际益水平将低于所列示数据。

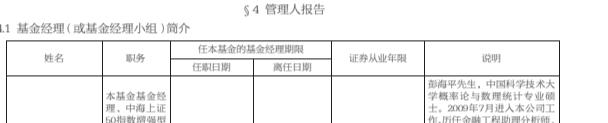
注:2)本期利润已扣除应收基金管理人基本收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润同时扣除了本期实现益加上本期公允价值变动收益。

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同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长(%)	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④		
过去三个月	-0.08%	0.21%	1.02%	-0.08%	-2.00%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§ 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期间	证券从业年限	说明
彭海平	本基金基金经理、中海量化策略混合型证券投资基金基金经理、中海量化精选混合型证券投资基金基金经理、中海量化配置混合型证券投资基金基金经理、中海量化绝对收益策略混合型证券投资基金基金经理、中海量化对冲策略混合型证券投资基金基金经理、中海量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海量化增强混合型证券投资基金基金经理、中海量化增利债券型证券投资基金基金经理、中海量化定期开放债券型证券投资基金基金经理、中海量化策略混合型证券投资基金基金经理	2016年12月20日	-	6年
周其源	本基金基金经理	2013年10月24日	2016年12月20日	8年

注:1)上述任日期,即任日期起本基金基金经理对外披露的任免日期。

注:2)证书从其的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作的整体情况的说明

基金管理人报告期内严格执行了《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》的规定,勤勉尽责地履行了基金合同约定的义务,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。

4.3 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金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、风险管理事后分析等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场价格偏离度等进行全程监控。公司通过制定交易规则、交易等相关机制,要求公司各组合分别共享交易权限,交易所交易通过归档公司交易模块统一进行,根据公司制度,具体执行相关交易,使公司交易行为中的申购价格优先于卖出价格,同时,根据公司制度,通过系统禁止公司组合间在除指定期外的当日反向交易。对于发生在不同时间的场外买卖的证券实行交易市场的公平交易,由公司风控部门对相关交易进行事前审核,风控的事前介入有效防范了可能出现的不公平交易行为。

本报告期内,公司不同组合在不同时间的同向交易差额在0.05%以下,体现了公平交易原则。多维度的公平交易监控指标对公平交易事后分析全面、有效。

本报告期内,公司根据制度要求,对不同组合在不同时间段的反向交易进行了统计分析,对于出现的公司制度中规定的异常交易,均需要相关当事人和扣分,按照公司制度要求予以留置。

4.4 竞争对手交易行为的专项说明

根据《证券投资基金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、风险管理事后分析等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场价格偏离度等进行全程监控。公司通过制定交易规则、交易等相关机制,要求公司各组合分别共享交易权限,交易所交易通过归档公司交易模块统一进行,根据公司制度,具体执行相关交易,使公司交易行为中的申购价格优先于卖出价格,同时,根据公司制度,通过系统禁止公司组合间在除指定期外的当日反向交易。对于发生在不同时间的场外买卖的证券实行交易市场的公平交易,由公司风控部门对相关交易进行事前审核,风控的事前介入有效防范了可能出现的不公平交易行为。

本报告期内,公司不同组合在不同时间的同向交易差额在0.05%以下,体现了公平交易原则。多维度的公平交易监控指标对公平交易事后分析全面、有效。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金份额组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权证投资	59,344,424.00	78.70
2	其中:股票	59,344,424.00	78.70
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券投资	-	-
6	黄金投资	-	-
7	银行存款和结算备付金	15,561,044.00	20.62
8	其他资产	511,495.67	0.68
9	合计	76,406,960.67	100.00

§ 2 基金产品概况

2.1 基金的基本情况

2.2 报告期内本基金的经营情况

2.3 报告期末本基金的资产组合

2.4 报告期末本基金的资产净值

2.5 报告期末基金份额净值

2.6 报告期基金份额净值增长率

2.7 报告期基金净值增长率标准差

2.8 报告期基金加权平均净值增长率

2.9 报告期基金净值增长率标准差

2.10 报告期基金定期报告披露情况

2.11 报告期基金组合类资产情况

2.12 报告期未向基金份额持有人分配利润情况

2.13 报告期未进行基金份额净值折算情况

2.14 报告期未向基金份额持有人收取费用情况

2.15 报告期未向基金份额持有人支付费用情况

2.16 报告期未进行基金份额净值调整的情形

2.17 报告期未进行基金份额净值公告

2.18 报告期未进行基金份额净值复核

2.19 报告期未进行基金份额净值偏离度

2.20 报告期未进行基金份额净值偏离度警示值

2.21 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.22 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.23 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.24 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.25 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.26 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.27 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.28 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.29 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.30 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.31 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.32 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.33 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.34 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.35 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.36 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.37 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.38 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.39 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.40 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.41 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.42 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.43 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.44 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.45 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.46 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.47 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.48 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.49 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.50 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.51 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.52 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.53 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.54 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.55 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.56 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.57 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.58 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.59 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.60 报告期未进行基金份额净值偏离度预警值

2.61 报告期未进行基金份额净值偏离