

中海增强收益债券型证券投资基金

[2017]第一季度报告

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：2017年4月21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。

本报告期财务报告未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称 中海增强收益债券型证券投资基金

基金简称 中海增强

基金主代码 396011

基金运作方式 封闭式

上市交易场所 上海证券交易所

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

报告期末基金资产净值 106,401,860,649

投资目标 在确保本金安全的前提下，力争为基金份额持有人创造稳定收益。

投资策略 本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，精选具有较好投资价值的债券品种，力求在有效控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。本基金将根据宏观经济形势、利率走势、信用利差、流动性变化等对不同类别的债券品种进行动态调整，以期在不同市场环境下实现基金资产的保值增值。

业绩比较基准 中证综合债指数收益率×70%+一年期定期存款利率（税后）×30%

报告期损益分配情况 本报告期内本基金未进行收益分配。

报告期利润 本报告期内本基金未进行利润分配。

报告期净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 -1.54%，同期业绩比较基准收益率为-0.46%。

投资策略说明 本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，精选具有较好投资价值的债券品种，力求在有效控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。本基金将根据宏观经济形势、利率走势、信用利差、流动性变化等对不同类别的债券品种进行动态调整，以期在不同市场环境下实现基金资产的保值增值。

风险提示 本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，精选具有较好投资价值的债券品种，力求在有效控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。本基金将根据宏观经济形势、利率走势、信用利差、流动性变化等对不同类别的债券品种进行动态调整，以期在不同市场环境下实现基金资产的保值增值。

基金管理人声明 本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金托管人声明 本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

重要提示 本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，精选具有较好投资价值的债券品种，力求在有效控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。本基金将根据宏观经济形势、利率走势、信用利差、流动性变化等对不同类别的债券品种进行动态调整，以期在不同市场环境下实现基金资产的保值增值。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标 单位：人民币元

报告期(2017年1月1日至 2017年3月31日) 中海增强净值增长率为 -1.54%

1.本期利润 -303,032.00 -303,032.00

2.本期利润 -0.0001 -0.0001

3.期末基金资产净值 106,401,860,649 106,401,860,649

4.本期末基金资产净值占份额百分比 0.23% 0.23%

5.报告期净值增长率 -1.54% -1.54%

6.净值增长率标准差 -0.0001 -0.0001

7.报告期净值增长率偏离度 -0.00% -0.00%

8.报告期净值增长率偏离度的绝对值 -0.00% -0.00%

9.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

10.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

11.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

12.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

13.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

14.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

15.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

16.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

17.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

18.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

19.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

20.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

21.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

22.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

23.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

24.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

25.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

26.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

27.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

28.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

29.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

30.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

31.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

32.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

33.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

34.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

35.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

36.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

37.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

38.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

39.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

40.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

41.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

42.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

43.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

44.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

45.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

46.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

47.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

48.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

49.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

50.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

51.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

52.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

53.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

54.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

55.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

56.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

57.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

58.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

59.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

60.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

61.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

62.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

63.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

64.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

65.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

66.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

67.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

68.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

69.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

70.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

71.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

72.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

73.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

74.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

75.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

76.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

77.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

78.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

79.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

80.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

81.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

82.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

83.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

84.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

85.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

86.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

87.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

88.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

89.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

90.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

91.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

92.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

93.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

94.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

95.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

96.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

97.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

98.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

99.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

100.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

101.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

102.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

103.报告期净值增长率偏离度的上界 -0.00% -0.00%

104.报告期净值增长率偏离度的下界 -0.00% -0.00%

105.报告期净值增长率偏离度的平均值 -0.00% -0.00%

106.报告期净值增长率偏离度的标准差 -0.00% -0.00%

<div data-bbox="2