

中海能源策略混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2010年第2号)

日期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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	21,649,669	281,662,193.69	4.13
2	000983	西山煤电	12,510,735	227,194,947.60	3.33
3	600000	浦发银行	16,368,729	222,614,714.40	3.26
4	600875	东方电气	4,938,209	215,059,001.95	3.15
5	600795	国电电力	50,524,272	165,214,369.44	2.42
6	601186	中国铁建	21,384,596	153,969,091.20	2.26
7	601601	中国太保	6,000,000	136,620,000.00	2.00
8	600858	银座股份	5,226,306	132,800,435.46	1.95
9	000858	五粮液	4,897,439	118,664,946.97	1.74
10	600016	民生银行	19,607,511	118,625,441.55	1.74

期末按股票品种分类的股票投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	254,228,000.00	3.73
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	118,604,180.00	1.74
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	28,695,440.80	0.42
7	其他	-	-
	合计	401,527,620.80	5.89

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1001038	10债兴3	2,600,000	254,228,000.00	3.73
2	122043	09粤赣债	299,000	32,040,840.00	0.47
3	080845	08联电债	300,000	31,479,000.00	0.46
4	123003	09甬沪债	300,000	30,000,000.00	0.44
5	113001	中行转债	283,720	28,695,440.80	0.42

1. 本基金本报告期末持有资产支持证券。
 2. 本基金本报告期末未持有权证。
 3. 本基金本报告期末未持有股指期货。
 4. 本报告期末本基金持有的前十名证券的发行主体除宜宾五粮液股份有限公司被监管部门立案调查外,其他发行主体本期无违规披露上监管部门,或在报告期内曾一年一度受到公开谴责、处罚的情况。宜宾五粮液股份有限公司董事会于2009年8月8日召开,对宜宾五粮液股份有限公司的内部控制及公司治理情况进行了自查,并向全体股东披露了自查报告。本基金对五粮液股份有限公司的内部控制及公司治理情况进行了核查,未发现其内部控制及公司治理存在重大缺陷。本基金对五粮液股份有限公司的内部控制及公司治理情况进行了核查,未发现其内部控制及公司治理存在重大缺陷。
 5. 截至2010年6月30日,本基金其他投资明细如下:

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,244,562.81
2	应收证券清算款	1,525,130.00
3	应收股利	734,345.53
4	应收利息	4,615,562.31
5	应收申购款	299,822.88
	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,419,423.53

4. 本基金本报告期末未持有资产支持证券的情况。
 5. 本基金本报告期末未持有股指期货的情况。
 6. 本基金本报告期末未持有权证的情况。
 7. 本报告期末本基金持有的前十名证券的发行主体除宜宾五粮液股份有限公司被监管部门立案调查外,其他发行主体本期无违规披露上监管部门,或在报告期内曾一年一度受到公开谴责、处罚的情况。宜宾五粮液股份有限公司董事会于2009年8月8日召开,对宜宾五粮液股份有限公司的内部控制及公司治理情况进行了自查,并向全体股东披露了自查报告。本基金对五粮液股份有限公司的内部控制及公司治理情况进行了核查,未发现其内部控制及公司治理存在重大缺陷。本基金对五粮液股份有限公司的内部控制及公司治理情况进行了核查,未发现其内部控制及公司治理存在重大缺陷。
 8. 截至2010年6月30日,本基金其他投资明细如下:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2007031-20071231	70.94%	1.71%	59.28%	1.42%	11.66%	0.29%
20080101-20081231	-49.30%	2.06%	-47.38%	1.97%	-1.92%	0.09%
20090101-20091231	61.42%	1.62%	57.62%	1.33%	3.80%	0.29%
20100101-20100630	-16.67%	1.27%	-18.41%	1.03%	1.74%	0.24%

十一、基金资产净值与基金份额净值
 1. 基金资产的核算
 2. 基金资产的估值
 3. 基金份额净值
 4. 基金资产净值的公告

十二、基金费用的计提、支付方式及比例
 1. 基金管理费
 2. 基金托管费
 3. 基金销售服务费
 4. 基金交易费用
 5. 基金持有人大会费用
 6. 基金分红费用
 7. 基金管理人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失
 8. 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失
 9. 基金管理人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失
 10. 基金管理人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	2,806,190.00	0.04
B	采掘业	350,855,476.90	5.14
C	制造业	1,786,062,310.58	26.19
D	电力、煤气及水的生产和供应业	263,763,977.49	3.87
E	建筑业	259,624,722.85	3.81
F	交通运输、仓储业	50,034,117.65	0.73
G	信息技术业	361,449,438.83	5.30
H	批发和零售业	265,855,204.32	3.90
I	金融、保险业	954,665,692.00	14.00
J	房地产业	17,741,075.64	0.26
K	社会团体	17,741,075.64	0.26
L	传播与文化业	3,494,421.00	0.05
M	综合类	52,474,833.44	0.77
	合计	4,333,576,261.75	63.55

十三、基金资产净值的公告
 1. 基金资产的核算
 2. 基金资产的估值
 3. 基金份额净值
 4. 基金资产净值的公告

一、基金概况
 1. 基金名称
 2. 基金管理人
 3. 基金托管人
 4. 基金投资目标
 5. 基金投资策略
 6. 基金业绩比较基准

二、基金管理人
 1. 基金管理概况
 2. 基金管理人的职责
 3. 基金管理人承诺
 4. 基金经理
 5. 基金经理的简介
 6. 基金经理的聘任和解聘
 7. 基金经理的变更
 8. 基金经理的报酬
 9. 基金经理的考核

三、基金托管人
 1. 基金托管概况
 2. 基金托管人的职责
 3. 基金托管人承诺
 4. 基金托管人的资格
 5. 基金托管人的办公地点
 6. 基金托管人的联系方式

四、基金份额发售与申购赎回
 1. 基金份额的发售
 2. 基金申购赎回的场所
 3. 基金申购赎回的时间
 4. 基金申购赎回的最低金额
 5. 基金申购赎回的费用
 6. 基金申购赎回的确认
 7. 基金申购赎回的退款
 8. 基金申购赎回的差错处理

五、基金的投资
 1. 基金投资目标
 2. 基金投资策略
 3. 基金投资组合比例
 4. 基金投资禁止行为
 5. 基金投资管理人的职责
 6. 基金投资业绩比较基准

六、基金的风险管理
 1. 风险管理的概述
 2. 风险管理的方法
 3. 基金风险管理的原则
 4. 基金风险管理的目标
 5. 基金风险管理的流程
 6. 基金风险管理的报告

七、基金的费用与税收
 1. 基金费用的种类
 2. 基金费用的计提方式和计提标准
 3. 基金费用的支付方式
 4. 基金费用的总额
 5. 基金费用的公告
 6. 基金费用的调整

八、基金的收益分配
 1. 基金收益分配的原则
 2. 基金收益分配的条件
 3. 基金收益分配的日期
 4. 基金收益分配的数额
 5. 基金收益分配的支付方式
 6. 基金收益分配的税费

九、基金的转换
 1. 基金转换的条件
 2. 基金转换的程序
 3. 基金转换的费用
 4. 基金转换的公告
 5. 基金转换的限制
 6. 基金转换的差错处理

十、基金的申购与赎回
 1. 基金申购赎回的场所
 2. 基金申购赎回的时间
 3. 基金申购赎回的最低金额
 4. 基金申购赎回的费用
 5. 基金申购赎回的确认
 6. 基金申购赎回的退款
 7. 基金申购赎回的差错处理

十一、基金资产的估值
 1. 基金资产净值的计算方法
 2. 基金资产净值的公告
 3. 基金资产净值的调整
 4. 基金资产净值的差错处理
 5. 基金资产净值的复核
 6. 基金资产净值的披露

十二、基金资产的披露
 1. 基金资产的披露原则
 2. 基金资产的披露内容
 3. 基金资产的披露时间
 4. 基金资产的披露地点
 5. 基金资产的披露方式
 6. 基金资产的披露责任

十三、基金资产的分配
 1. 基金资产分配的原则
 2. 基金资产分配的条件
 3. 基金资产分配的日期
 4. 基金资产分配的数额
 5. 基金资产分配的支付方式
 6. 基金资产分配的税费

十四、基金资产的管理
 1. 基金资产管理的概述
 2. 基金资产管理的方法
 3. 基金资产管理的原则
 4. 基金资产管理的目标
 5. 基金资产管理的流程
 6. 基金资产管理的报告

十五、基金资产的估值
 1. 基金资产净值的计算方法
 2. 基金资产净值的公告
 3. 基金资产净值的调整
 4. 基金资产净值的差错处理
 5. 基金资产净值的复核
 6. 基金资产净值的披露

十六、基金资产的披露
 1. 基金资产的披露原则
 2. 基金资产的披露内容
 3. 基金资产的披露时间
 4. 基金资产的披露地点
 5. 基金资产的披露方式
 6. 基金资产的披露责任

十七、基金资产的分配
 1. 基金资产分配的原则
 2. 基金资产分配的条件
 3. 基金资产分配的日期
 4. 基金资产分配的数额
 5. 基金资产分配的支付方式
 6. 基金资产分配的税费

十八、基金资产的管理
 1. 基金资产管理的概述
 2. 基金资产管理的方法
 3. 基金资产管理的原则
 4. 基金资产管理的目标
 5. 基金资产管理的流程
 6. 基金资产管理的报告

十九、基金资产的估值
 1. 基金资产净值的计算方法
 2. 基金资产净值的公告
 3. 基金资产净值的调整
 4. 基金资产净值的差错处理
 5. 基金资产净值的复核
 6. 基金资产净值的披露

二十、基金资产的披露
 1. 基金资产的披露原则
 2. 基金资产的披露内容
 3. 基金资产的披露时间
 4. 基金资产的披露地点
 5. 基金资产的披露方式
 6. 基金资产的披露责任

二十一、基金资产的分配
 1. 基金资产分配的原则
 2. 基金资产分配的条件
 3. 基金资产分配的日期
 4. 基金资产分配的数额
 5. 基金资产分配的支付方式
 6. 基金资产分配的税费

二十二、基金资产的管理
 1. 基金资产管理的概述
 2. 基金资产管理的方法
 3. 基金资产管理的原则
 4. 基金资产管理的目标
 5. 基金资产管理的流程
 6. 基金资产管理的报告

二十三、基金资产的估值
 1. 基金资产净值的计算方法
 2. 基金资产净值的公告
 3. 基金资产净值的调整
 4. 基金资产净值的差错处理
 5. 基金资产净值的复核
 6. 基金资产净值的披露

二十四、基金资产的披露
 1. 基金资产的披露原则
 2. 基金资产的披露内容
 3. 基金资产的披露时间
 4. 基金资产的披露地点
 5. 基金资产的披露方式
 6. 基金资产的披露责任

二十五、基金资产的分配
 1. 基金资产分配的原则
 2. 基金资产分配的条件
 3. 基金资产分配的日期
 4. 基金资产分配的数额
 5. 基金资产分配的支付方式
 6. 基金资产分配的税费

二十六、基金资产的管理
 1. 基金资产管理的概述
 2. 基金资产管理的方法
 3. 基金资产管理的原则
 4. 基金资产管理的目标
 5. 基金资产管理的流程
 6. 基金资产管理的报告

二十七、基金资产的估值
 1. 基金资产净值的计算方法
 2. 基金资产净值的公告
 3. 基金资产净值的调整
 4. 基金资产净值的差错处理
 5. 基金资产净值的复核
 6. 基金资产净值的披露

二十八、基金资产的披露
 1. 基金资产的披露原则
 2. 基金资产的披露内容
 3. 基金资产的披露时间
 4. 基金资产的披露地点
 5. 基金资产的披露方式
 6. 基金资产的披露责任

二十九、基金资产的分配
 1. 基金资产分配的原则
 2. 基金资产分配的条件
 3. 基金资产分配的日期
 4. 基金资产分配的数额
 5. 基金资产分配的支付方式
 6. 基金资产分配的税费

三十、基金资产的管理
 1. 基金资产管理的概述
 2. 基金资产管理的方法
 3. 基金资产管理的原则
 4. 基金资产管理的目标
 5. 基金资产管理的流程
 6. 基金资产管理的报告