

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:二〇一一年八月二十六日
重要提示
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守基金管理人职责,诚实守信,勤勉尽责,严格按照法律法规和行业自律规范运作,审慎选择基金投资标的,严格执行投资决策程序,确保基金份额持有人的合法权益,不从事任何可能导致基金资产损失或基金份额持有人利益受损的行为。

中海能源策略混合型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

2 基金简介
2.1 基金基本情况
基金名称:中海能源策略混合型证券投资基金
基金代码:398021
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2007年3月13日
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
报告期末基金份额总额:6,315,169.632129
基金合同存续期:不定期

2.2 基金产品说明
投资目标:在世界经济增长和中国经济增长模式向节约型转变的背景下,以能源为投资主题,重点关注具备能源竞争优势的行业和企业,精选个股,并综合运用资产配置、行业轮动、个股精选等投资策略,追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略:
1. 一级资产配置:本基金根据股票和债券市场的相对吸引力,参考 IASVM (Asset Share Stock Valuation Model) 模型,依据宏观经济分析模型和估值模型,对股票和债券资产进行配置。
2. 行业配置:本基金根据行业景气度、行业景气度变化趋势、行业景气度变化趋势、行业景气度变化趋势,对行业进行配置。

Table with 3 columns: 项目, 基金管理人, 基金托管人. Lists key personnel like 姓名, 职务, 联系电话, etc.

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

告, 定价服务机构按照合同约定提供定价服务, 其中, 本基金管理人为了保障估值工作的合规开展, 建立了负责估值工作小组, 成员包括督察长、风险控制总监、监察稽核负责人及基金会计负责人等, 成员均具有多年基金从业经验, 且具备风控、合规、会计方面的专业经验, 负责估值核算小组由估值核算小组组长、估值核算小组副组长、估值核算小组组员组成, 估值核算小组组长由基金管理人指定, 估值核算小组副组长由基金管理人指定, 估值核算小组组员由基金管理人指定。

5.1 报告期内本基金托管人履职情况说明
2011年上半年, 本基金托管人在对中海能源策略混合型证券投资基金的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

6.4.7 关联方关系
6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.4.7.2 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化
6.4.7.3 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

Table with 2 columns: 关联方名称, 与本基金的关系. Lists related parties and their relationships.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Shows financial data for the period ending 2011年6月30日.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%). Lists top 20 stocks sold.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%). Lists top 20 stocks bought.

Table with 2 columns: 买入股票的成本、成交总额, 卖出股票的收入、成交总额. Shows buy and sell transaction totals.

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 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(%). Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 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(%). Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 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(%). Lists top 5 bond holdings.

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额. Lists top 5 positions.

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额. Lists top 5 positions.

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额. Lists top 5 positions.

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额. Lists top 5 positions.

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额. Lists top 5 positions.

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额. Lists top 5 positions.

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额. Lists top 5 positions.

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额. Lists top 5 positions.

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额. Lists top 5 positions.

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额. Lists top 5 positions.

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额. Lists top 5 positions.