

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...

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:390021
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

2.2 基金产品说明
投资目标:在世界经济短缩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、行业轮动等策略...

投资策略
1. 一级资产配置:本基金根据股票和债券的相对吸引力,按照(Shark Share Shark Valuation Model)模型,依据宏观经济分析模型和估值模型进行资产配置...

2.3 基金管理人和其他基金托管人
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

Table with 3 columns: Item, Fund Manager, Custodian. Lists key personnel like Name, Contact Info, and Client Service.

3 主要财务数据和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末数据指标

3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

3.2.2 基金合同生效以来基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率变动的对比

3.3 基金投资组合报告
3.3.1 基金投资组合报告
3.3.2 基金投资组合报告附注

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人及基金托管人的基本情况
4.1.2 基金管理人及基金托管人履行职责的情况

4.2 基金经理
4.2.1 基金经理简介
4.2.2 基金经理变更情况

4.3 基金管理人内部控制制度
4.3.1 内部控制制度的概述
4.3.2 基金管理人内部控制制度的主要内容

4.4 基金管理人内部控制制度的完善性
4.4.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.4.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.5 基金管理人内部控制制度的完善性
4.5.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.5.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.6 基金管理人内部控制制度的完善性
4.6.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.6.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.7 基金管理人内部控制制度的完善性
4.7.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.7.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.8 基金管理人内部控制制度的完善性
4.8.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.8.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.9 基金管理人内部控制制度的完善性
4.9.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.9.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.10 基金管理人内部控制制度的完善性
4.10.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.10.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.11 基金管理人内部控制制度的完善性
4.11.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.11.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.12 基金管理人内部控制制度的完善性
4.12.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.12.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.13 基金管理人内部控制制度的完善性
4.13.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.13.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.14 基金管理人内部控制制度的完善性
4.14.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.14.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.15 基金管理人内部控制制度的完善性
4.15.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.15.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.16 基金管理人内部控制制度的完善性
4.16.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.16.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.17 基金管理人内部控制制度的完善性
4.17.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.17.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.18 基金管理人内部控制制度的完善性
4.18.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.18.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.19 基金管理人内部控制制度的完善性
4.19.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.19.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.20 基金管理人内部控制制度的完善性
4.20.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.20.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.21 基金管理人内部控制制度的完善性
4.21.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.21.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.22 基金管理人内部控制制度的完善性
4.22.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.22.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.23 基金管理人内部控制制度的完善性
4.23.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.23.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.24 基金管理人内部控制制度的完善性
4.24.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.24.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.25 基金管理人内部控制制度的完善性
4.25.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.25.2 基金管理人内部控制制度的完善性

4.26 基金管理人内部控制制度的完善性
4.26.1 基金管理人内部控制制度的完善性
4.26.2 基金管理人内部控制制度的完善性

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...

4.7 管理人报告期末基金利润分配情况的说明
根据法律法规及基金合同的有关规定,本基金报告期内未发生利润分配。

5.1 报告期内本基金托管人履行托管职责情况
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的利益的行为...

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
2011年上半年,中海能源策略混合型证券投资基金管理人——中海基金管理有限公司在中海能源策略混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人的利益的行为...

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实性、准确性和完整性的意见
本托管人对中海基金管理有限公司编制的2011年中海能源策略混合型证券投资基金半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务报告(未经审计)
6.1 资产负债表
单位:人民币元

Balance Sheet table with columns: Asset, Liability, and Equity. Includes items like Cash, Receivables, and Total Assets.

6.2 利润表
单位:人民币元

Income Statement table with columns: Revenue, Expense, and Profit. Includes items like Interest Income, Management Fees, and Net Profit.

6.3 所有者权益变动表
单位:人民币元

Equity Statement table with columns: Opening Balance, Change, and Ending Balance. Shows changes in net assets.

6.4 所有者权益变动表(续)
单位:人民币元

Continuation of Equity Statement table, showing further details of equity changes.

6.5 所有者权益变动表(续)
单位:人民币元

Continuation of Equity Statement table, showing further details of equity changes.

6.6 所有者权益变动表(续)
单位:人民币元

Continuation of Equity Statement table, showing further details of equity changes.

6.7 所有者权益变动表(续)
单位:人民币元

Continuation of Equity Statement table, showing further details of equity changes.

6.7.4 关联方关系
6.7.4.1 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
6.7.4.2 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

6.7.5 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.6 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.7 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.8 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.9 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.10 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.11 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.12 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.13 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.14 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.15 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.16 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.17 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.18 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.19 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.20 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.21 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.22 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.23 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.24 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.25 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.26 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.27 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.28 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.29 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.30 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.31 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.32 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.33 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.34 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.35 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.36 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.37 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.38 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.39 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.40 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.41 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.42 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.43 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.44 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.45 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.46 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.47 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.48 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.49 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.50 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.51 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.52 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.53 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.54 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.55 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.56 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.57 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.58 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.59 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.60 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.61 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.62 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.63 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.64 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.65 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.66 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.67 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.68 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.69 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.70 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.71 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.72 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.73 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.74 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.75 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.76 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.77 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.78 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.79 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.80 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.81 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.82 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.83 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.84 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.85 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.86 本报告期与基金发生关联交易的相关方

6.7.87 本报告期与基金发生关联交易的相关方
6.7.88 本报告期与基金发生关联交易的相关方

Table of Top 10 Holdings. Columns: Rank, Security Code, Security Name, Current Market Value, and Proportion of Net Assets.

注:本报告期末,买入股票金额以取得成交金额、成交均价乘以成交量列示,不考虑相关交易费用。
7.4.3 买入股票的成本及支出款项的总额

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

Table of Top 5 Bond Holdings. Columns: Rank, Bond Code, Bond Name, Quantity, Fair Value, and Proportion of Net Assets.

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

7.9 投资组合报告附注
7.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。
7.9.3 期末其他各项资产构成

Table of Top 10 Securities. Columns: Rank, Security Code, Security Name, Quantity, Fair Value, and Proportion of Net Assets.

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.9.5 期末持有的资产支持证券明细
7.9.6 期末持有的权证明细

7.9.7 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.8 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.9 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.10 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.11 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.12 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.13 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.14 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.15 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.16 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.17 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.18 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.19 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.20 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.21 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.22 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.23 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.24 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.25 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.26 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.27 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.28 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.29 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.30 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.31 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.32 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.33 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.34 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.35 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.36 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.37 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.38 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。

7.9.39 基金管理人及基金托管人报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情况。