

**中海基金** 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**：二〇一二年八月二十四日

**重要提示**  
 本基金管理人保证基金信息披露内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。  
 基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)根据本基金合同规定，于2012年8月22日复核了本报告中的财务指标、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，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，基金的业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。  
 本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。  
 本报告中财务资料未经审计。  
 本报告自2012年7月1日起至6月30日止。

**2 基金简介**

**2.1 基金基本情况**

基金名称	中海环保新能源基金
基金净值	99051.51
交易代码	990515
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月9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	557,121,243.90
基金合同存续期	不定期

**2.2 基金产品说明**

在宏观经济环境不断变化、市场震荡加剧以及国内通胀压力日益凸显的背景下，以环保为投资主题，重点投资于具有环境友好型特征，并符合我国可持续发展方向、环保领域上下游产业链上其他资产配置的资产，通过分散投资降低组合的资产集中度风险，以规避单一行业或个股风险，谋求基金资产的长期增值回报。

**2.3 基金管理人**

姓名	胡志刚	职务	总经理
姓名	赵超军	职务	副总经理

**3 主要财务指标和基金净值表现**

**3.1 主要会计数据和财务指标**

本期净利润	-5,525,077.00
本期总资产	23,360,900.09
加权平均基金份额本期利润	0.0045
本期基金份额净值增长率	5.27%
1.1.2 基金份额净值增长率	-0.247
期末基金份额净值	446,551,554.87
期末基金份额净值增长率	0.802

**3.2 基金净值表现**

阶段	份额净值增长率①	同期业绩比较基准收益率②	份额净值增长率-业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去一个月	-2.67%	1.23%	-3.82%	0.64%	1.15%
过去三个月	5.39%	1.09%	1.02%	0.64%	4.37%
过去六个月	5.25%	1.15%	4.16%	0.79%	1.09%
过去一年	-6.42%	1.08%	-9.02%	0.80%	2.69%
自基金合同生效以来	-19.80%	0.94%	-10.56%	0.79%	-9.24%

**3.3 基金业绩比较基准**

本基金业绩比较基准为沪深300指数涨跌幅×60%+中国债券综合指数涨跌幅×40%。我们选取市场认可的沪深300指数、中国债券综合指数作为业绩基准的指数。本基金投资组合中，本基金资产的比例为30%-90%。在正常市场情况下，本基金股票资产比例控制在60%左右，债券资产比例控制在40%左右。我们根据本基金在一般市场情况下的资产配置比例来指定本基金业绩比较基准的权重，以使业绩比较基准更具相关性。

**3.4 基金管理人**

本基金管理人中海基金管理有限公司，是经中国证监会核准设立的基金管理公司。公司注册资本10亿元人民币，注册地为上海。公司经营范围包括：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。

**3.5 基金托管人**

中国工商银行股份有限公司，是经国务院银行业监督管理机构批准，由中国人民银行总行于1985年10月1日在北京设立的一家全国性股份制商业银行。总行设在北京，在全国设有3600多个分支机构，资产总额达15.6万亿元人民币。

**3.6 基金投资组合**

截至2012年6月30日，基金资产净值557,121,243.90元，基金份额总额557,121,243.90份。基金资产净值较期初增长5.27%，基金份额净值较期初增长0.802%。

**3.7 基金业绩比较基准**

本基金业绩比较基准为沪深300指数涨跌幅×60%+中国债券综合指数涨跌幅×40%。我们选取市场认可的沪深300指数、中国债券综合指数作为业绩基准的指数。本基金投资组合中，本基金资产的比例为30%-90%。在正常市场情况下，本基金股票资产比例控制在60%左右，债券资产比例控制在40%左右。我们根据本基金在一般市场情况下的资产配置比例来指定本基金业绩比较基准的权重，以使业绩比较基准更具相关性。

**3.8 基金管理人**

本基金管理人中海基金管理有限公司，是经中国证监会核准设立的基金管理公司。公司注册资本10亿元人民币，注册地为上海。公司经营范围包括：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。

**3.9 基金托管人**

中国工商银行股份有限公司，是经国务院银行业监督管理机构批准，由中国人民银行总行于1985年10月1日在北京设立的一家全国性股份制商业银行。总行设在北京，在全国设有3600多个分支机构，资产总额达15.6万亿元人民币。

**3.10 基金投资组合**

截至2012年6月30日，基金资产净值557,121,243.90元，基金份额总额557,121,243.90份。基金资产净值较期初增长5.27%，基金份额净值较期初增长0.802%。

**3.11 基金业绩比较基准**

本基金业绩比较基准为沪深300指数涨跌幅×60%+中国债券综合指数涨跌幅×40%。我们选取市场认可的沪深300指数、中国债券综合指数作为业绩基准的指数。本基金投资组合中，本基金资产的比例为30%-90%。在正常市场情况下，本基金股票资产比例控制在60%左右，债券资产比例控制在40%左右。我们根据本基金在一般市场情况下的资产配置比例来指定本基金业绩比较基准的权重，以使业绩比较基准更具相关性。

**3.12 基金管理人**

本基金管理人中海基金管理有限公司，是经中国证监会核准设立的基金管理公司。公司注册资本10亿元人民币，注册地为上海。公司经营范围包括：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。

**3.13 基金托管人**

中国工商银行股份有限公司，是经国务院银行业监督管理机构批准，由中国人民银行总行于1985年10月1日在北京设立的一家全国性股份制商业银行。总行设在北京，在全国设有3600多个分支机构，资产总额达15.6万亿元人民币。

**3.14 基金投资组合**

截至2012年6月30日，基金资产净值557,121,243.90元，基金份额总额557,121,243.90份。基金资产净值较期初增长5.27%，基金份额净值较期初增长0.802%。

# 中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金

## 2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

6.1 资产负债表

资产	附注号	期末数 2012年6月30日	上年末数 2011年12月31日
货币存款		6,951,563.58	25,628,423.45
债券投资		770,119.99	3,194,304.96
其他金融资产		1,649,024.21	2,145,670.41
其他资产		438,339,687.06	435,969,326.67
合计		343,841,079.06	332,346,727.47

负债和所有者权益	附注号	期末数 2012年6月30日	上年末数 2011年12月31日
应付账款		606,146.98	1,862,728.69
其他负债		-	-
所有者权益		6,813.51	15,337.63
合计		606,146.98	1,862,728.69

**6.2 利润表**

项目	附注号	本期 2012年1-6月	上年同期 2011年1-6月
一、收入		31,228,477.07	-90,673,805.27
利息收入		1,335,898.18	4,140,978.87
其他收入		103,079.53	826,586.00
二、费用		-1,047,686.15	-2,244,479.39
其他费用		-1,047,686.15	-2,244,479.39
三、利润总额		30,180,790.92	-86,429,326.38
所得税		-	-
净利润		30,180,790.92	-86,429,326.38

**6.3 所有者权益变动表**

项目	附注号	本期 2012年1-6月	上年同期 2011年1-6月
一、所有者权益		6,813.51	15,337.63
二、费用		-1,047,686.15	-2,244,479.39
三、利润总额		30,180,790.92	-86,429,326.38
四、净利润		30,180,790.92	-86,429,326.38
五、所有者权益		6,813.51	15,337.63

**6.4 现金流量表**

项目	附注号	本期 2012年1-6月	上年同期 2011年1-6月
一、经营活动产生的现金流量		1,616,627.09	1,935,697.65
二、投资活动产生的现金流量		-1,047,686.15	-2,244,479.39
三、筹资活动产生的现金流量		-	-
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-	-
五、现金及现金等价物净增加额		568,940.94	-308,781.74

**6.5 资产负债表**

项目	附注号	本期 2012年1-6月	上年同期 2011年1-6月
一、资产		343,841,079.06	332,346,727.47
二、负债		606,146.98	1,862,728.69
三、所有者权益		6,813.51	15,337.63

**6.6 利润表**

项目	附注号	本期 2012年1-6月	上年同期 2011年1-6月
一、收入		31,228,477.07	-90,673,805.27
二、费用		-1,047,686.15	-2,244,479.39
三、利润总额		30,180,790.92	-86,429,326.38
四、净利润		30,180,790.92	-86,429,326.38

**6.7 现金流量表**

项目	附注号	本期 2012年1-6月	上年同期 2011年1-6月
一、经营活动产生的现金流量		1,616,627.09	1,935,697.65
二、投资活动产生的现金流量		-1,047,686.15	-2,244,479.39
三、筹资活动产生的现金流量		-	-
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-	-
五、现金及现金等价物净增加额		568,940.94	-308,781.74

**6.8 资产负债表**

项目	附注号	本期 2012年1-6月	上年同期 2011年1-6月
一、资产		343,841,079.06	332,346,727.47
二、负债		606,146.98	1,862,728.69
三、所有者权益		6,813.51	15,337.63

**6.9 利润表**

项目	附注号	本期 2012年1-6月	上年同期 2011年1-6月
一、收入		31,228,477.07	-90,673,805.27
二、费用		-1,047,686.15	-2,244,479.39
三、利润总额		30,180,790.92	-86,429,326.38
四、净利润		30,180,790.92	-86,429,326.38

**6.10 现金流量表**

项目	附注号	本期 2012年1-6月	上年同期 2011年1-6月
一、经营活动产生的现金流量		1,616,627.09	1,935,697.65
二、投资活动产生的现金流量		-1,047,686.15	-2,244,479.39
三、筹资活动产生的现金流量		-	-
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-	-
五、现金及现金等价物净增加额		568,940.94	-308,781.74

**6.11 资产负债表**

项目	附注号	本期 2012年1-6月	上年同期 2011年1-6月
一、资产		343,841,079.06	332,346,727.47
二、负债		606,146.98	1,862,728.69
三、所有者权益		6,813.51	15,337.63

**6.12 利润表**

项目	附注号	本期 2012年1-6月	上年同期 2011年1-6月
一、收入		31,228,477.07	-90,673,805.27
二、费用		-1,047,686.15	-2,244,479.39
三、利润总额		30,180,790.92	-86,429,326.38
四、净利润		30,180,790.92	-86,429,326.38

**6.13 现金流量表**

项目	附注号	本期 2012年1-6月	上年同期 2011年1-6月
一、经营活动产生的现金流量		1,616,627.09	1,935,697.65
二、投资活动产生的现金流量		-1,047,686.15	-2,244,479.39
三、筹资活动产生的现金流量		-	-
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-	-
五、现金及现金等价物净增加额		568,940.94	-308,781.74

**6.14 资产负债表**

项目	附注号	本期 2012年1-6月	上年同期 2011年1-6月
一、资产		343,841,079.06	332,346,727.47
二、负债		606,146.98	1,862,728.69
三、所有者权益		6,813.51	15,337.63

基金管理人每日计算、逐日累计至每月月末、按月支付。  
 6.4.8.2 基金托管费

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金托管费	569,144.50	927,611.65

**6.4.8.3 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.4 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.5 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.6 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.7 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.8 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.9 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.10 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.11 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.12 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.13 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.14 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.15 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.16 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.17 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.18 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.19 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.20 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.21 关联方交易**

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
工商银行	6,951,563.58	66,419,771.46

**6.4.8.22 关联方交易**