

中海消费主题精选股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

[illegible]

主要财务指标	报告期(2013年7月1日~2013年9月30日)	4	002415	海康威视	140,605	3,711,998.40	3.70
1.本期已实现收益	9,919,430.00	5	300168	万达信息	96,696	3,400,798.32	3.71
2.本期利润	19,226,847.91	6	002618	万邦科技	81,800	3,325,988.00	3.31
		7	002400	广信股份	76,149	3,240,376.00	3.32



Figure 4.1 is a line chart titled '基金自成立以来的业绩表现' (Fund's performance since establishment). The x-axis represents time from March 2014 to March 2015. The y-axis represents the net asset value (NAV) in RMB units, ranging from 1.00 to 1.50. Two lines are plotted: a solid line for the fund's NAV and a dashed line for the CSI 300 Index. The fund's NAV starts at 1.00 in March 2014 and rises steadily to approximately 1.45 by March 2015. The CSI 300 Index starts at 1.00 in March 2014 and rises to approximately 1.35 by March 2015. The fund's performance is consistently above the benchmark.

薛洪斌	投资部总经理 本基金基金经理	2011年11月19日	-	理有限公司研究员, 天南基金有限公司研究总监, 投资总监, 长期基金基金经理, 天南基金有限公司研究员, 2010年6月加入本公司工作。曾任研义投资, 现任资产管理部。2011年12月	5.10.4 报告期末持有的于转股期可转换债券明细 注: 本基金本报告期末持有于转股期的可转换债券。 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
姓名	股票市值	股票占净值	或受限部分的公允价值	占基金资产净值比	流通受限情况说明

注1：上述任职日期、离任日期指本基金管理人对外披露的任免日期。	今任中商消费主题精选股票型证券投资基金基金经理				
注2：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。					
注3：管理人对报告期内基金运作遵规情况的说明					

基金管理人已在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定，勤勉尽责地管理和运用基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺。	单位：元
报告期末前基金份总额	64,583,431.09
报告期间基金份额申购份额	1,908,646,777.49
报告期间基金份额赎回份额	1,895,766,616.47

对, 对联, 债券的一级市场和二级市场交易等投资管理制度的全程公平交易进行明确规定, 公司通过制定研究、交易等管理制度, 要求公司所有研究人员和基金经理、投资交易指令统一下达至交易室, 由交易室通过公平交易模块并具体执行, 确保公平交易制度的有效执行。 公平交易制度要求的主要内容包括: 价格优先、比例分配、综合平衡原则以落实; 同时, 根据公平制度, 通过系统设置, 公司公平交易(指数加权)的时间窗口为交易; 对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易, 由公司公平交易系统进行控制。	报告期期末基金份额变动情况 报告期期末基金份额变动情况	77,463,590.81
---	---	----------------------

本期报告期内,公司对不同组合之间的同向交易易发生进行了审慎的事前控制,同时,进行了相关的假设检验,对于相关组合金额和组合的收益进行了不同时间窗口,针对交易占优次数进行了行列判定分析。同时,对不同组合的换手率进行了分析,发现组合收益与交易习惯是否发生重大变化。对不同组合的持仓集中度进行了统计比较,究竟是否存在不同组合经理管理的组合持仓集中度偏高的情况。多维度的公平交易监控指标使公平交易分析更加全面。	8.1 备查文件目录 1、中国证监会指定信息披露网站巨潮资讯网登载的投资基金的文件 2、中国证监会指定信息披露网站深圳证券交易所基金信息披露网站 3、中国证监会指定信息披露网站深圳证券交易所基金信息披露网站
---	---

4. 投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等对基金的投资价值和风险等级、风险承受能力做出独立判断和决策。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，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金管理人无直接关系。投资者应当认真阅读并充分理解《基金合同》中关于基金投资风险提示的相关内容，充分认识投资风险，谨慎投资。

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年3季度以来,随着宏观经济调整的阶段性结束,总体市场估值有所回升,结构性的市场特征愈加突出。其中,表现为显著的是以自区域为核心的所谓改革主题。本基金在报告期内采取了一贯稳健的投资策略,继续坚持长期投资为主,投资方向均按照既定策略配置,没有发生偏离投资说明情况以资留取。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司,咨询电话:(021)86789788或400-888-9788

公司网址:<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司
2013年10月25日

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	014271010	12国债(附CP001)	400,000	40,364,000.00	7.51
2	11818700	11国债(附息债)	300,000	30,543,000.00	5.68

3	112119	12国债08	275,820	27,164,408.82	5.06
4	12880081	12鲁阳开债	200,000	21,018,000.00	3.91
5	1280036	12临安城建债	200,000	20,766,000.00	3.86

5.6 报告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

年度 报告
2013年9月30日

 注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。
 5.7 报告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
 注：本基金本报告期末未持有权证。
 5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 5.8.1 本期国债期货投资策略

对交易所提供的一般市场和场外二级市场交易指令指令下达至综合公平交易系统进行了详细的说明。公平交易系统制定完善、交易和清算流程、要求各方在各自研究或研究成果、投资交易指令下达至交易所、由交易所通过公平交易系统接收并具体执行交易,使公平交易系统成为重要的交易指令、价格发现、比例分配、综合平衡得以落实;同时,根据公司章程规定,通过系统连接交易所组合(2)和综合组合(3)的每日交易情况,对于存在争议和纠纷的场外交易和交易所市场的大宗交易,通过公平交易系统提供交易指令和成交数据,为各方提供交易和清算的依据。

本报告期间,公司不同组合不同期间的双向交易价差进行了溢价率样本的采集,进行了不同组合的假设检验,对于相关溢价和溢价的合理性进行了重要性的分析,对交易成本与溢价率进行了对比分析。同时,对于相关组合的手续费进行了分析,验证了溢价和溢价的合理性。对于溢价和溢价的合理性进行了验证,验证了溢价和溢价的合理性。	5.9 投资组合回报附注
本报告期间,公司不同组合不同期间的双向交易价差进行了溢价率样本的采集,进行了不同组合的假设检验,对于相关溢价和溢价的合理性进行了重要性的分析,对交易成本与溢价率进行了对比分析。同时,对于相关组合的手续费进行了分析,验证了溢价和溢价的合理性。对于溢价和溢价的合理性进行了验证,验证了溢价和溢价的合理性。	5.9.1
本报告期间,公司不同组合不同期间的双向交易价差进行了溢价率样本的采集,进行了不同组合的假设检验,对于相关溢价和溢价的合理性进行了重要性的分析,对交易成本与溢价率进行了对比分析。同时,对于相关组合的手续费进行了分析,验证了溢价和溢价的合理性。对于溢价和溢价的合理性进行了验证,验证了溢价和溢价的合理性。	5.9.2

4.3.2 除交易行为外的专项说明 报告期内, 所投资标的公司二级市场公开交易的周日日均向成交较多的单位交易且未有在过往投资期内日成交量较大, 对于一二级市场投资中出现的可能导致不公平交易和利益输送的大额异常交易情况, 经管理层按照制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留置。 4.3.3 报告期内基金的业绩来源和业绩归因分析 4.3.4 报告期内基金投资资产公允价值和公允价值分析	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。 5.9.3 其他资产产成产						
<table border="1"> <thead> <tr> <th>序号</th><th>名称</th><th>金额(元)</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1</td><td>存出保证金</td><td>16,024.00</td></tr> </tbody> </table>	序号	名称	金额(元)	1	存出保证金	16,024.00	
序号	名称	金额(元)					
1	存出保证金	16,024.00					

经历了上半年经济持续下滑后，三季度国内经济数据开始企稳。8月份PMI数据回到50%临界点附近，而三季度的实际GDP同比增长也达到6.9%，创历史新高。开工小时数、企业新增订单数量等，同时，CPI也在反弹，但二季度仍保持负增长并不足以说明经济全面复苏，因为核心CPI仍处于负值区间。	2	应收证券清算款	400,000.00
	3	应收账款	-
相对而言，债券市场在三季度出现了明显的回暖，以利率债为主的收益率持续提升，尤其其中长期品种最为。债券类资产性价比及信用风险均有所上调。债券市场整体走强，四、五两月，短息类产品保持和银行理财产品有供给优势，流动性较好的产品，成为机构投资者配置的重点，对收益型产品的需求可能继续提升。	4	应收利息	14,718,445.95
	5	应收款项损失准备	895.71

本基金在二季度,保持了较稳定的仓位,净值表现平稳。		
4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明		
截至2018年9月30日,本基金A类的净值1.079元(累计净值1.079元)。报告期内本基金A类净值增长率为6.00%,高于业绩比较基准0.86个百分点。本基金A类份额净值1.068元(累计净值1.068元)。报告期内本基金C类净值增长率为-0.09%,高于业绩比较基准0.86个百分点。	6 其他应收款	-
	7 预摊费用	-
	8 其他	-
	9 合计	14,635,365.66

3 报告期末基金资产组合情况			占基金总资产的比例(%)	
序号	项目	金额(元)		
1	权益投资	-	-	-
	其中:股票	-	-	-

2	固定收益投资	451,465,474.16	83.86	本基金由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。
	其中:债券	451,465,474.16	83.86	
	资产支持证券	-	-	
3	金融衍生品投资	-	-	
	金融资产公允价值变动	-	-	
	其他资产	-	-	
	其他负债	-	-	
	净资产	517,490,280.69	100.00	

9.6 开放式基金份额变动

项目		中海增强收益债券A	中海增强收益债券C
报告期初基金份额总额		317,490,280.69	33,789,308.44

		64,000,000.00	11.89	报告期期末基金总申购份额	164,192,770.32	30,205,769.29
5	其中:买断式回购的买入返售金融资产			减:报告期期末基金总赎回份额	1,341,159.15	3,396,151.71
6	报告期新增和拆回待售付集合计	8,266,171.01	1.54	报告期期末基金总申购份额	-	-
7	其他负债	14,635,365.66	2.72	报告期期末基金总赎回份额	-	-
8	合计	78,255,000.00	14.15	报告期期末基金净申购份额	468,271,452.86	30,033,507.02

3. 报告期末按行业分类的股票投资组合	2,538,000,000.00	100.00
注：本基金本报告期末未持有股票。		
3.1 报告期末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		
注：本基金本报告期末未持有股票。		
3.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合		

注：本报告期内，基金管理人未运用固定收益投资基本金。

3. 备查文件目录

1. 中国证监会批准募集由安徽国际公益慈善信托投资基金的文件

5.7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注：本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资基本金。

5.8 备查文件目录

1. 备查文件目录

1. 中国证监会批准募集由安徽国际公益慈善信托投资基金的文件

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	备 注
1	国家债券	--	--	2、 中债增强收益债券型证券投资基金基金合同
2	央行票据	--	--	3、 中债增强收益债券型证券投资基金托管协议
3	金融债券	19,956,000.00	3.71	4、 中债增强收益债券型证券投资基金财务报表及报表附注
	其中：政策性金融债	19,956,000.00	3.71	5、 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

5	企业债券		70,577,930.32	68.97	上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
5	企业短期融资券		60,514,000.00	11.26	8.3 查阅方式
6	中期票据	-	-	-	投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。
7	可转债	417,543.84	0.08		咨询电话:(021)38789788/400-888-9788

其他					22.01.04.11:https://www.zmna.com	
合计	0	451,465,474.16	-	-		
5.5 报告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				84.03		