

中海惠丰纯债分级债券型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月19日

重要提示
基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金合同生效日:2013年9月12日
报告期基金份额总额:503,887,159.03份
投资策略:在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。

主要财务指标
本期利润总额:9,896,661.53
本期基金份额净值:489.070422
期末基金份额净值:0.972

主要财务指标
本期利润总额:9,896,661.53
本期基金份额净值:489.070422
期末基金份额净值:0.972

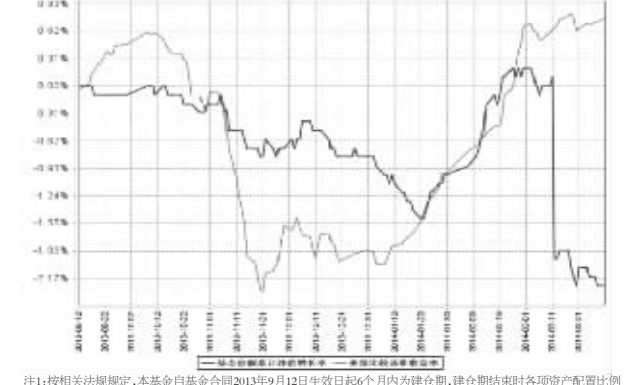


Table with 4 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Shows performance data for the last 3 months.

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月19日

重要提示
基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金合同生效日:2013年9月12日
报告期基金份额总额:2,345,438,477.00份
投资策略:本基金采用现金流驱动的投资策略,通过公开发行的DM模型筛选出流动性较好的纯债类固定收益类资产。

主要财务指标
本期利润总额:-14,192,757.31
本期基金份额净值:1,665.111,335.51
期末基金份额净值:0.7100

主要财务指标
本期利润总额:-14,192,757.31
本期基金份额净值:1,665.111,335.51
期末基金份额净值:0.7100

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关规定,公司从研究、投资、交易、风险管理等环节后分析等。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现
4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)



Table with 4 columns: 序号, 存出保证金, 名称, 金额(元)

Table with 4 columns: 项目, 中海惠丰纯债债券A, 中海惠丰纯债债券B

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

中海增强收益债券型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月19日

重要提示
基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金合同生效日:2013年9月12日
报告期基金份额总额:227,070,996.17份
投资策略:本基金采取自上而下的分析框架,在不同市场环境和资产配置策略下,力争为基金份额持有人创造稳定收益。

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)



Table with 4 columns: 序号, 存出保证金, 名称, 金额(元)

Table with 4 columns: 项目, 中海增强收益债券A, 中海增强收益债券B

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关规定,公司从研究、投资、交易、风险管理等环节后分析等。

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)



Table with 4 columns: 序号, 存出保证金, 名称, 金额(元)

Table with 4 columns: 项目, 中海增强收益债券A, 中海增强收益债券B

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

中海分红增利混合型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月19日

重要提示
基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金合同生效日:2013年9月12日
报告期基金份额总额:1,672,303,042.27份
投资策略:本基金采取自上而下的分析框架,在不同市场环境和资产配置策略下,力争为基金份额持有人创造稳定收益。

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关规定,公司从研究、投资、交易、风险管理等环节后分析等。

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)



Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明