

中海能源策略混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2014年第1号)

本基金合同于2007年3月13日生效。

重要提示
 投资者应认真阅读基金合同、招募说明书并认真领会其精髓。基金的投资目标并不承诺未来收益。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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

一、基金管理人
 (一)基金管理人概况
 名称:中海基金管理有限公司
 住所:上海市浦东新区世纪大道1502号22-27楼
 办公地址:上海市浦东新区世纪大道1502号22-27楼
 法定代表人:李勇
 联系人:李勇
 客服电话:400-888-9788
 网址:www.zhfund.com.cn

电话:021-68780161
 传真:021-68778171
 邮编:200120
 网址:www.zhfund.com.cn

(二)基金托管人概况
 名称:交通银行股份有限公司
 住所:上海市浦东新区银城中路188号
 办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
 法定代表人:李勇
 联系人:李勇
 客服电话:95558
 网址:www.bankcomm.com

二、基金托管人
 (一)基金托管人概况
 名称:交通银行股份有限公司
 住所:上海市浦东新区银城中路188号
 办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
 法定代表人:李勇
 联系人:李勇
 客服电话:95558
 网址:www.bankcomm.com

(二)基金托管人概况
 名称:交通银行股份有限公司
 住所:上海市浦东新区银城中路188号
 办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
 法定代表人:李勇
 联系人:李勇
 客服电话:95558
 网址:www.bankcomm.com

三、基金销售机构
 (一)基金销售机构
 名称:交通银行股份有限公司
 住所:上海市浦东新区银城中路188号
 办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
 法定代表人:李勇
 联系人:李勇
 客服电话:95558
 网址:www.bankcomm.com

(二)基金销售机构
 名称:交通银行股份有限公司
 住所:上海市浦东新区银城中路188号
 办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
 法定代表人:李勇
 联系人:李勇
 客服电话:95558
 网址:www.bankcomm.com

四、基金的投资
 (一)投资目标
 本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票、债券、权证及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期增值。

(二)投资范围
 本基金的投资范围包括国内依法发行的股票、债券、权证及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期增值。

五、基金的业绩
 (一)基金业绩
 本基金自2007年3月13日成立以来,业绩表现良好,为投资者创造了可观的财富。

(二)基金业绩
 本基金自2007年3月13日成立以来,业绩表现良好,为投资者创造了可观的财富。

六、基金的费用
 (一)基金费用
 本基金的管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用,按照基金合同的约定收取。

(二)基金费用
 本基金的管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用,按照基金合同的约定收取。

七、基金的风险
 (一)基金风险
 本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应认真阅读基金合同、招募说明书,全面认识本基金的风险收益特征。

(二)基金风险
 本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应认真阅读基金合同、招募说明书,全面认识本基金的风险收益特征。

八、基金的信息披露
 (一)基金信息披露
 本基金的信息披露,包括基金合同、招募说明书、定期报告、临时报告等,按照法律法规和中国证监会的要求进行。

(二)基金信息披露
 本基金的信息披露,包括基金合同、招募说明书、定期报告、临时报告等,按照法律法规和中国证监会的要求进行。

九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算
 (一)基金合同的变更
 基金合同的变更,应当经基金份额持有人大会决议通过,并报中国证监会备案。

(二)基金合同的变更
 基金合同的变更,应当经基金份额持有人大会决议通过,并报中国证监会备案。

十、基金合同的终止
 (一)基金合同终止
 基金合同终止,应当经基金份额持有人大会决议通过,并报中国证监会备案。

(二)基金合同终止
 基金合同终止,应当经基金份额持有人大会决议通过,并报中国证监会备案。

十一、基金合同的效力
 (一)基金合同效力
 基金合同自生效之日起生效,对基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均具有法律约束力。

(二)基金合同效力
 基金合同自生效之日起生效,对基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均具有法律约束力。

十二、基金合同的解释
 (一)基金合同解释
 基金合同的解释,应当遵循诚实信用原则,按照通常理解予以解释。

(二)基金合同解释
 基金合同的解释,应当遵循诚实信用原则,按照通常理解予以解释。

十三、基金合同的适用法律
 (一)基金合同适用法律
 基金合同适用中华人民共和国法律。

(二)基金合同适用法律
 基金合同适用中华人民共和国法律。

十四、基金合同的争议解决
 (一)基金合同争议解决
 基金合同的争议,应当通过协商解决,协商不成的,可以向人民法院提起诉讼。

(二)基金合同争议解决
 基金合同的争议,应当通过协商解决,协商不成的,可以向人民法院提起诉讼。

十五、基金合同的附则
 (一)基金合同附则
 基金合同的附则,包括基金合同的生效、修改、终止等事项。

(二)基金合同附则
 基金合同的附则,包括基金合同的生效、修改、终止等事项。

2.期末行业分类的资产配置组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,858,809,697.05	58.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	65,093,639.12	2.06
F	批发和零售业	178,741,444.28	5.66
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	171,471,375.62	5.43
K	房地产业	83,277,054.28	2.64
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,675,747.68	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	940,571.14	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公事业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	其他	-	-
	合计	2,360,049,528.57	74.69

3.期末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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000731	四川美丰	27,731,554	274,560,699.06	8.68
2	300124	汇川技术	3,855,793	225,525,325.77	7.14
3	002217	东药药业	7,958,667	156,796,939.90	4.96
4	002038	双鹭药业	3,038,491	133,945,720.08	4.86
5	600557	康药药业	4,265,398	129,753,877.16	4.11
6	000581	威远药业	3,629,347	111,506,687.60	3.53
7	000663	华谊集团	2,372,726	109,148,856.00	3.45
8	601766	中国南车	19,888,776	100,128,377.76	3.17
9	601126	西巴股份	5,088,625	97,378,146.25	3.08
10	600925	中国国研	6,278,551	84,132,583.40	2.66

4.期末按行业分类的股票投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	128,726,000.00	4.07
4	企业债	128,726,000.00	4.07
5	企业短期融资券	99,132,970.00	3.14
6	可转债	-	-
7	其他	115,365,165.60	3.65
8	其他	-	-
9	合计	343,224,135.60	10.86

5.期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	110015	石化转债	819,030	78,102,700.80	2.47
2	040026	04附息国债	600,000	59,796,000.00	1.89
3	1181063	11国债转股	500,000	47,480,000.00	1.50
4	070406	07农发债	400,000	39,728,000.00	1.26
5	1181093	11国债国债	300,000	29,442,000.00	0.93

6.期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本基金报告期内未持有资产支持证券投资。
 7.期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
 本基金报告期内未持有权证投资。
 8.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 8.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 本基金报告期内未持有股指期货合约。
 8.2本基金投资股指期货的投资政策
 根据基金合同规定,本基金并不以进行股指期货交易为目的,本基金将根据投资组合的风险管理需要,适度使用股指期货进行套期保值,以调整投资组合的风险敞口,提高投资效率,实现基金的投资目标。

9.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 根据基金合同规定,本基金并不以进行国债期货交易为目的,本基金将根据投资组合的风险管理需要,适度使用国债期货进行套期保值,以调整投资组合的风险敞口,提高投资效率,实现基金的投资目标。

10.投资组合报告附注
 (1)报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告期内受到公开谴责、处罚的情况。
 (2)报告期内本基金投资的前十名证券中没有存在基金合同规定备选股票库之外的股票。
 (3)截至2013年12月31日,本基金其他资产项目列示如下:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,041,956.64
2	应收证券清算款	36,708,686.77
3	应收股利	-
4	应收利息	7,101,486.80
5	应收申购款	6,120,772.60
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	45,771,250.93

(4)期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	78,102,700.80	2.47
2	110023	民生转债	8,803,536.00	0.28

(5)期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
 本基金报告期内未持有流通受限股票的情况。
 (6)投资组合报告附注的其他文字描述部分
 本基金报告期内未持有其他股票。

七、基金的业绩
 本基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。基金业绩比较基准:中证500指数收益率×60%+沪深300指数收益率×40%。

阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准③	业绩比较基准差④	①-③	②-④
2007/03/13-2007/12/31	70.94%	1.71%	59.28%	1.42%	11.66%	0.29%
2008/01/1-2008/12/31	-49.30%	2.60%	-47.38%	1.97%	-1.92%	0.09%
2009/01/1-2009/12/31	61.42%	1.62%	57.62%	1.33%	3.80%	0.29%
2010/01/1-2010/12/31	0.49%	1.33%	-6.64%	1.03%	7.13%	0.32%
2011/01/1-2011/12/31	-37.38%	1.20%	-15.51%	0.84%	-21.87%	0.36%
2012/01/1-2012/12/31	-2.63%	1.15%	6.54%	0.83%	-9.17%	0.25%
2013/01/1-2013/12/31	4.06%	1.19%	-3.62%	0.91%	7.68%	0.32%
自基金合同生效以来	-10.80%	1.51%	7.02%	1.25%	-17.82%	0.26%

六、基金的费用与税收
 (一)基金费用的种类
 1.基金管理人的管理费;
 2.基金托管人的托管费;
 3.基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
 4.基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;
 5.基金份额持有人大会费用;
 6.按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用的计提方法
 1.基金管理人的管理费
 基金管理人的管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:
 $H = H \times 1.5\% \div 365$
 H为前一日的基金资产净值
 费用自基金合同生效日起,按日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、公休日等,可顺延支付。

2.基金托管人的托管费
 基金托管人的托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下:
 $H = H \times 0.25\% \div 365$
 H为前一日的基金资产净值
 费用自基金合同生效日起,按日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、公休日等,可顺延支付。

3.基金合同生效后与基金相关的信息披露费用
 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用,按照《证券投资基金信息披露管理办法》及相关规定计提,列入基金费用。

4.基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费
 基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费,按照《证券投资基金信息披露管理办法》及相关规定计提,列入基金费用。

5.基金份额持有人大会费用
 基金份额持有人大会费用,按照《证券投资基金信息披露管理办法》及相关规定计提,列入基金费用。

6.按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用
 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用,按照《证券投资基金信息披露管理办法》及相关规定计提,列入基金费用。

七、基金的投资
 (一)投资目标
 本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票、债券、权证及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期增值。

(二)投资范围
 本基金的投资范围包括国内依法发行的股票、债券、权证及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期增值。

(三)投资策略
 本基金采取自上而下的投资策略,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期增值。

(四)资产配置
 本基金根据宏观经济形势、政策变化、市场估值等因素,动态调整股票、债券、权证等资产的配置比例,力求实现基金资产的长期增值。

(五)股票投资
 本基金采取自上而下的投资策略,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期增值。

(六)债券投资
 本基金采取自上而下的投资策略,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期增值。

(七)权证投资
 本基金根据宏观经济形势、政策变化、市场估值等因素,动态调整股票、债券、权证等资产的配置比例,力求实现基金资产的长期增值。

(八)股指期货投资
 根据基金合同规定,本基金并不以进行股指期货交易为目的,本基金将根据投资组合的风险管理需要,适度使用股指期货进行套期保值,以调整投资组合的风险敞口,提高投资效率,实现基金的投资目标。

(九)国债期货投资
 根据基金合同规定,本基金并不以进行国债期货交易为目的,本基金将根据投资组合的风险管理需要,适度使用国债期货进行套期保值,以调整投资组合的风险敞口,提高投资效率,实现基金的投资目标。

八、基金业绩
 本基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。基金业绩比较基准:中证500指数收益率×60%+沪深300指数收益率×40%。

基金业绩比较基准:中证500指数收益率×60%+沪深300指数收益率×40%。
 自基金合同生效以来,本基金净值增长率及业绩比较基准差如下表所示:

阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准③	业绩比较基准差④	①-③	②-④
2007/03/13-2007/12/31	70.94%	1.71%	59.28%	1.42%	11.66%	0.29%
2008/01/1-2008/12/31	-49.30%	2.60%	-47.38%	1.97%	-1.92%	0.09%
2009/01/1-2009/12/31	61.42%	1.62%	57.62%	1.33%	3.80%	0.29%
2010/01/1-2010/12/31	0.49%	1.33%	-6.64%	1.03%	7.13%	0.32%
2011/01/1-2011/12/31	-37.38%	1.20%	-15.51%	0.84%	-21.87%	0.36%
2012/01/1-2012/12/31	-2.63%	1.15%	6.54%	0.83%	-9.17%	0.25%
2013/01/1-2013/12/31	4.06%	1.19%	-3.62%	0.91%	7.68%	0.32%
自基金合同生效以来	-10.80%	1.51%	7.02%	1.25%	-17.82%	0.26%

九、基金的费用与税收
 (一)基金费用的种类
 1.基金管理人的管理费;
 2.基金托管人的托管费;
 3.基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
 4.基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;
 5.基金份额持有人大会费用;
 6.按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用的计提方法
 1.基金管理人的管理费
 基金管理人的管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:
 $H = H \times 1.5\% \div 365$
 H为前一日的基金资产净值
 费用自基金合同生效日起,按日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、公休日等,可顺延支付。

2.基金托管人的托管费
 基金托管人的托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下:
 $H = H \times 0.25\% \div 365$
 H为前一日的基金资产净值
 费用自基金合同生效日起,按日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、公休日等,可顺延支付。

3.基金合同生效后与基金相关的信息披露费用
 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用,按照《证券投资基金信息披露管理办法》及相关规定计提,列入基金费用。

4.基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费
 基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费,按照《证券投资基金信息披露管理办法》及相关规定计提,列入基金费用。

5.基金份额持有人大会费用
 基金份额持有人大会费用,按照《证券投资基金信息披露管理办法》及相关规定计提,列入基金费用。

6.按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用
 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用,按照《证券投资基金信息披露管理办法》及相关规定计提,列入基金费用。

十、基金的投资
 (一)投资目标
 本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票、债券、权证及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期增值。

(二)投资范围
 本基金的投资范围包括国内依法发行的股票、债券、权证及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期增值。

(三)投资策略
 本基金采取自上而下的投资策略,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期增值。

(四)资产配置
 本基金根据宏观经济形势、政策变化、市场估值等因素,动态调整股票、债券、权证等资产的配置比例,力求实现基金资产的长期增值。

(五)股票投资
 本基金采取自上而下的投资策略,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期增值。

(六)债券投资
 本基金采取自上而下的投资策略,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期增值。

(七)权证投资
 本基金根据宏观经济形势、政策变化、市场估值等因素,动态调整股票、债券、权证等资产的配置比例,力求实现基金资产的长期增值。

(八)股指期货投资
 根据基金合同规定,本基金并不以进行股指期货交易为目的,本基金将根据投资组合的风险管理需要,适度使用股指期货进行套期保值,以调整投资组合的风险敞口,提高投资效率,实现基金的投资目标。

(九)国债期货投资
 根据基金合同规定,本基金并不以进行国债期货交易为目的,本基金将根据投资组合的风险管理需要,适度使用国债期货进行套期保值,以调整投资组合的风险敞口,提高投资效率,实现基金的投资目标。

十一、基金业绩
 本基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。基金业绩比较基准:中证500指数收益率×60%+沪深300指数收益率×40%。

基金业绩比较基准:中证500指数收益率×60%+沪深300指数收益率×40%。
 自基金合同生效以来,本基金净值增长率及业绩比较基准差如下表所示:

阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准③	业绩比较基准差④	①-③	②-④
2007/03/						