中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

基金的过往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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中海惠裕分级债券发起式	
场内简称	中海惠裕	
基金主代码	163907	
基金运作方式	契约型。基金合同生效后三年内,惠裕A份额每满六个月开放申购和赎回一次;惠裕B份额封闭运作,不开放申购和赎回,但可在深圳证券交易所上市交易。基金合同生效后三年期届满,本基金将转换为LOF,并不再进行基金份额分级。	
基金合同生效日	2013年1月7日	
报告期末基金份额总额	590,769,680.58份	
投资目标	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。	
投资策略	(一)固定收益品种的配置策略 1、久期配置 本基金基于对宏观经济指标和宏观经济政策的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此预测利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性,确定债券资产配置的基本方向和特征;同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合的久期配置。 2、期限结构配置 在确定组合久期后,通过研究收益率曲线形态,对各期限段的风险收益情况进行评估,对收益率曲线各个期限的骑乘收益进行分析,在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。 3、债券类别配置/个券选择:主要依据信用利差分析,自上而下的资产配置。 在宏观分析和久期及期限结构配置的基础上,本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、市场流动性、市场风险等因素进行分析,同时兼顾其基本面分析,综合分析各品种的利差和变化趋势。 个券选择应遵循如下原则: 相对价值原则:同等风险中收益率较高的品种,同等收益率风险较低的品种。 流动性原则:其它条件类似,选择流动性较好的品种。 (二)信用品种的投资策略(中小企业私募债除外) 本基金对金融债、企业债、公司债和资产支持证券等信用品种采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本基金在久期配置策略与期限结构配置策略基础上,对信用品种的系统性因素进行分析,对利差走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本基金运用行业和公司基本面研究方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。 (三)中小企业私募债投资策略 本基金对中小企业私募债的投资策略主要基于信用品种投资略,在此基础上重点分析私募债的信用风险及流动性风险。首先,确定经济周期所处阶段,规避具有潜在风险的行业;其次,对私募债发行人公司治理、财务状况及偿债能力综合分析;最后,结合私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素,选择风险与收益相匹配的品种进行配置。 (四)其它交易策略 杠杆放大策略:即以组合现有债券为基础,利用回购等方式融入低成本资金,并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券,以期获取超额收益的操作方式。	
业绩比较基准	中证全债指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	中海基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	中海惠裕分级债券发起式A(场内简称:惠裕A)	中海惠裕分级债券发起式B(场内简称:惠裕B)
下属两级基金的交易代码	163908	150114
报告期末下属两级基金的份额总额	71,564,050.70份	519,205,629.88份
下属两级基金的风险收益特征	惠裕A为低风险、收益相对稳定的基金份额。	惠裕B为较高风险、较高收益的基金份额。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	7,656,215.03
2.本期利润	22,831,418.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.0376
4.期末基金资产净值	643,896,822.48
5.期末基金份额净值	1.090

注1:本期指2014年7月1日至2014年9月30日,上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如,申购、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

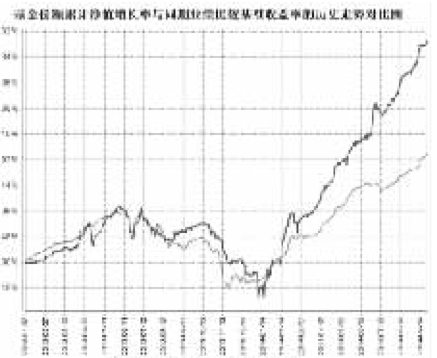
注2:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	5.10%	0.17%	1.56%	0.06%	3.54%	0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
江小震	固定收益部副总监,本基金基金经理、中海增强收益债券型证券投资基金基金经理、中海可转换债券债券型证券投资基金基金经理、中海惠祥分级债券型证券投资基金基金经理	2013年1月7日	-	16	江小震先生,复旦大学金融学专业硕士。历任长江证券股份有限公司投资经理、中维资产管理有限责任公司部门经理、天安人寿保险股份有限公司(原名恒康天安保险有限责任公司)投资部经理、太平洋资产管理有限责任公司高级经理。2009年11月进入本公司工作,曾任固定收益小组负责人,现任固定收益部副总监。2010年7月至2012年10月任中海货币市场证券投资基金基金经理,2011年3月至今任中海增强收益债券型证券投资基金基金经理,2013年1月至今任中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金基金经理,2014年3月至今任中海可转换债券债券型证券投资基金基金经理,2014年8月至今任中海惠祥分级债券型证券投资基金基金经理。
陆成来	投资副总监兼固定收益部总监、本基金基金经理、中海惠丰纯债分级债券型证券投资基金基金经理、中海惠利纯债分级债券型证券投资基金基金经理	2013年1月12日	-	12	陆成来先生,上海财经大学统计学专业博士。历任安徽省巢湖市钓鱼初级中学教师,安徽省淮北市朔里矿中学教师,兴业证券股份有限公司研究所策略部经理、资深研究员、固定收益部投资经理、董事副总经理、证券资产管理分公司客户资产管理部副总监兼投资主办。2012年9月进入本公司工作,曾任投资副总监,现任投资副总监兼固定收益部总监。2013年1月至今任中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金基金经理,2013年9月至今任中海惠丰纯债分级债券型证券投资基金基金经理,2013年11月至今任中海惠利纯债分级债券型证券投资基金基金经理。

注1:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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。

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,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,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。

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》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度,要求公司各组合研究成果共享,投资交易指令统一下达至交易室,由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易,使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实;同时,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的同日反向交易。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,由公司风险管理部对相关交易价格进行事前审核,风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,进行了相关的假设检验,对于相关溢价金额对组合收益率的贡献进行了重要性分析,并针对交易占优次数进行了时间序列分析。多维度的公平交易监控指标使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期,公司根据制度要求,对不同组合不同时间段的反向交易进行了统计分析,对于出现的公司制度中规定的异常交易,均要求相关当事人和审批人按照公司制度要求予以留痕。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况,对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况,风险管理部均根据制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留痕。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初以来经济增速持续低迷,虽然进入二季度,受政策刺激影响宏观经济出现了底部趋稳的迹象, PMI数据都逐月上升,但经济持续回暖的根基并不稳定。进入三季度,持续低迷的金融数据远超市场预期,普遍预计3季度GDP增速为7.2%,低于二季度水平。

疲弱的基本面结合流动性宽松和银行配置标准化品种需求的重启,今年以来债市走出一波牛市行情。进入三季度后,更多的配置力量在于银行理财资金的介入,利率债在经历先上后下的行情时,城投等信用品种却持续下行,市场的风格彻底切换到对转债和低评级品种的偏好上。

产品已经成立两年有余,配置资产和仓位进入稳定期,整体组合操作以流动性管理为主,同时逐步减少收益率较低和质押率较低的品种的配置,控制组合久期,优化组合结构。

我们认为维系牛市的因素并未发生改变,作为主要融资需求方的房地产行业已经进入下行周期,银行的风险偏好难以明显回升,从基本面和资金面上都有利于未来债券市场的发展,虽然当前收益率曲线较为平坦,短端利率的高企限制了长端的下行空间,但随着政府对融资平台的梳理和融资需求的下降,短端利率的堰塞状态也将被疏通,从而推动债券牛市的继续进行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金份额净值 1.090元(累计净值1.124元)。报告期内本基金净值增长率为5.10%,高于业绩比较基准3.54个百分点。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,445,086,045.20	95.48
	其中:债券	1,445,086,045.20	95.48
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	19,120,654.45	1.26
7	其他资产	49,216,940.20	3.25
8	合计	1,513,423,639.85	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金为纯债基金,不进行股票投资。

5.3 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:本基金为纯债基金,不进行股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,033,206.60	0.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,096,000.00	6.23
	其中:政策性金融债	40,096,000.00	6.23
4	企业债券	1,192,571,838.60	185.21
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	211,385,000.00	32.83
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,445,086,045.20	224.43

5.5 报告期末按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	124209	13三门峡	900,000	91,170,000.00	14.16
2	1380161	13潍滨投债	800,000	79,432,000.00	12.34
3	124131	13安国资	600,000	64,128,000.00	9.96
4	124240	13合工投	600,000	60,600,000.00	9.41
5	124159	13绍城改	500,000	52,240,000.00	8.11

5.6 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资产支持证券投资明细

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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,055.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	49,189,761.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,123.27
8	其他	-
9	合计	49,216,940.20

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金为纯债基金,不进行股票投资。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中海惠裕分级债券发起式A(场内简称:惠裕A)	中海惠裕分级债券发起式B(场内简称:惠裕B)
报告期期初基金份额总额	283,312,905.74	519,205,629.88
报告期期间基金总申购份额	1,033,000.00	-
减:报告期期间基金总赎回份额	218,895,203.59	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	6,113,348.55	-
报告期期末基金份额总额	71,564,050.70	519,205,629.88

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	20,457,640.08
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	20,683,121.07
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	3.50

注:本报告期内,基金管理人因惠裕A折算,导致持有基金份额变动。截至本报告期末,基金管理人持有本基金共20,683,121.07份,其中惠裕A10,675,020.26份,惠裕B10,008,100.81份。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	20,683,121.07	3.50	20,683,121.07	3.50	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	20,683,121.07	3.50	20,683,121.07	3.50	三年

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准募集中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金的文件
2、中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金基金合同
3、中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金托管协议
4、中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金财务报表及报表附注
5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

9.3 查阅方式

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)38789788或400-888-9788
公司网址:http://www.zhfund.com

中海基金管理有限公司
2014年10月25日

中海上证50指数增强型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30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
报告送出日期:2014年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

基金的过往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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中海上证50指数增强
基金主代码	399001
交易代码	399001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年3月25日
报告期末基金份额总额	236,710,159.59份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金,在被动跟踪标的指数的基础上,加入增强型的积极手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%。在控制基金组合跟踪误差的前提下力争取得高于业绩基准的稳定收益,追求长期的资本增值。
投资策略	本基金将采用"指数化投资为主、主动增强投资为辅"的投资策略,在完全复制标的指数的基础上有限度地调整个股,从而最大限度降低由于交易成本等因素造成的股票投资组合相对于标的指数的偏离,并力求投资收益能够有效跟踪并适度超越标的指数。 1、资产配置策略 为实现有效跟踪标的指数并力争超越标的指数的投资目标,本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于90%,投资于上证50指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于80%。本基金将采用完全复制为主,增强投资为辅的方式,按标的指数的成份股权重构建被动组合,同时辅以主动增强投资,对基金投资组合进行适当调整,力争本基金投资目标的实现。 2、股票投资策略 本基金被动投资组合采用完全复制方法进行构建,对于法律法规规定不能投资的股票将选择其它品种予以替代。主动投资主要采用自上而下与自下而上相结合的方法,依据宏微观研究与个股研究,在上证50指数中配置有正超额收益预期的成份股;同时,根据研究员的研究成果,适当的选择部分上证50指数成份股以外的股票作为增强股票库,构建主动型投资组合。 3、债券投资策略 本基金将根据国际与国内宏微观经济形势、债券市场资金状况以及市场利率走势来预测债券市场利率变化趋势,并对各债券品种收益率、流动性、信用风险和久期等进行综合分析,评定各债券品种的投资价值,同时着重考虑基金的流动性管理需要,主要选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。 4、投资组合调整策略 本基金为指数增强型基金,基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等因素,对基金投资组合进行适时调整,以保证基金份额净值增长率与业绩比较基准的跟踪偏离度和跟踪误差最优化。
业绩比较基准	上证50指数×95%+一年期银行定期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属指数增强型证券投资基金,为证券投资基金中的较高风险较高预期收益品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	5,223,457.99
2.本期利润	19,014,291.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.0773
4.期末基金资产净值	160,486,422.72
5.期末基金份额净值	0.678

注1:本期指2014年7月1日至2014年9月30日,上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

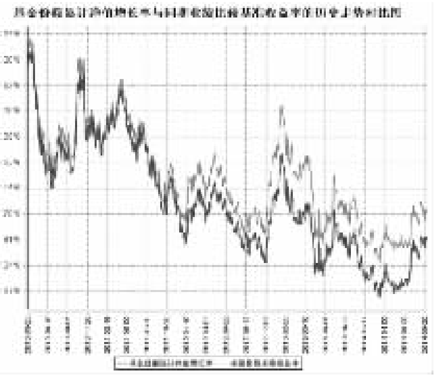
注2:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	12.81%	0.92%	8.84%	0.92%	3.97%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
彭海平	本基金基金经理	2013年1月8日	-	4	彭海平先生,中国科学技术大学概率论与数理统计专业硕士。2009年7月进入本公司工作,历任金融工程助理分析师、金融工程分析师、金融工程分析师兼基金经理助理。2013年1月至今任中海上证50指数增强型证券投资基金基金经理。

注1:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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。

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,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,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。

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》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度,要求公司各组合研究成果共享,投资交易指令统一下达至交易室,由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易,使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实;同时,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的同日反向交易。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,由公司风险管理部对相关交易价格进行事前审核,风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,进行了相关的假设检验,对于相关溢价金额对组合收益率的贡献进行了重要性分析,并针对交易占优次数进行了时间序列分析。多维度的公平交易监控指标使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期,公司根据制度要求,对不同组合不同时间段的反向交易进行了统计分析,对于出现的公司制度中规定的异常交易,均要求相关当事人和审批人按照公司制度要求予以留痕。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况,对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况,风险管理部均根据制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留痕。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

A股在三季度的表现十分抢眼,走出了一波难得的上涨行情。在政策放松、流动性宽松、沪港通预期、改革预期以及散户资金入市等因素影响下,A股市场指数三季度表现靓丽,上证综指、深成指分别在三季度获得15.40%、10.04%的季度涨幅。从7月份开始,CPI、进出口规模等宏观经济数据持续转好,显示出中国经济有望逐渐进入经济波动周期的上行阶段,而上市公司中报整体业绩也较大幅度出现同比增长,改善了市场对权重周期性个股的投资预期。在宏观经济周期转好的同时,以深化中国经济结构转型、定向刺激为目的的调控政策在7月份后不断出炉,为市场提供了诸如区域振兴、混合所有制改革、新能源等炒作题材,保证了市场热点不断。

本基金在三季度主要以跟踪指数为目标,同时适当参与了有业绩支撑的成长股,基金业绩三季度较大幅度跑赢基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金份额净值0.678元(累计净值0.678元)。报告期内本基金净值增长率为12.81%,高于业绩比较基准3.97个百分点。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	152,357,604.84	93.72
	其中:股票	152,357,604.84	93.72
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,517,948.86	5.24
7	其他资产	1,687,628.84	1.04
8	合计	162,563,182.54	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	623,565.00	0.39
B	采矿业	3,117,102.94	1.94
C	制造业	22,073,965.59	13.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,691,978.66	1.68
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,607,102.54	1.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,787,147.44	1.74
J	金融业	93,342,129.24	58.16
K	房地产业	4,551,491.33	2.84
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	130,794,482.74	81.50

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	21,563,122.10	13.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,563,122.10	13.44

5.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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

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	601318	中国平安	317,968	13,144,797.12	8.19
2	600036	招商银行	1,141,280	11,857,899.20	7.39
3	600016	民生银行	1,843,779	11,505,180.96	7.17
4	601166	兴业银行	810,415	8,282,441.30	5.16
5	600000	浦发银行	817,667	7,972,253.25	4.97
6	600030	中信证券	501,388	6,678,488.16	4.16
7	600837	海通证券	589,294	6,081,514.08	3.79
8	601328	交通银行	1,018,036	4,367,374.44	2.72
9	601601	中国太保	196,820	3,820,276.20	2.38
10	600887	伊利股份	146,315	3,789,558.50	2.36

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600210	紫江企业	1,171,700	5,659,311.00	3.53
2	600063	皖维高新	1,458,100	5,001,283.00	3.12
3	600742	一汽富维	109,500	3,028,770.00	1.89
4	600409	三友化工	340,800	2,170,896.00	1.35
5	600080	金花股份	141,600	1,857,792.00	1.16

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按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

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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资产支持证券投资明细

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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	30,479.38
2	应收证券清算款	1,604,273.06
3	应收股利	-
4	应收利息	1,565.86
5	应收申购款	51,310.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,687,628.84

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	251,678,439.88
报告期期间基金总申购份额	15,408,771.69
减:报告期期间基金总赎回份额	30,377,051.98
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	236,710,159.59

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内,基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准募集中海上证50指数增强型证券投资基金的文件
2、中海上证50指数增强型证券投资基金基金合同
3、中海上证50指数增强型证券投资基金托管协议
4、中海上证50指数增强型证券投资基金财务报表及报表附注
5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

8.3 查阅方式

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)38789788或400-888-9788
公司网址:http://www.zhfund.com

中海基金管理有限公司
2014年10月25日

中海量化策略股票型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30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
报告送出日期:2014年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

基金的过往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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中海量化策略股票
基金主代码	398041
交易代码	398041
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月24日
报告期末基金份额总额	173,300,592.35份
投资目标	根据量化模型,精选个股,积极配置权重,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在对经济周期、财政政策、货币政策和通货膨胀等宏观经济因素进行前瞻性充分研究的基础上,通过比较股票资产与债券资产预期收益率的高低进行大类资产配置,动态调整基金资产在股票、债券和现金之间的配置比例。 股票投资:本基金产品的特色在于采用自下而上的选股策略,施行一级股票库初选、二级股票库精选以及投资组合行业权重配置的全程数量化。 债券投资:债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的,在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上,采取积极主动的投资策略,投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、可分离可转债产品,在获取较高利息收入的同时兼顾资本利得,谋取超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数涨跌幅×80%+中国债券总指数涨跌幅×20%
风险收益特征	本基金属股票型证券投资基金,为证券投资基金中的较高风险品种。 本基金长期平均的风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	22,302,473.90
2.本期利润	23,185,079.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.1283
4.期末基金资产净值	163,515,714.16
5.期末基金份额净值	0.944

注1:本期指2014年7月1日至2014年9月30日,上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如,申购、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

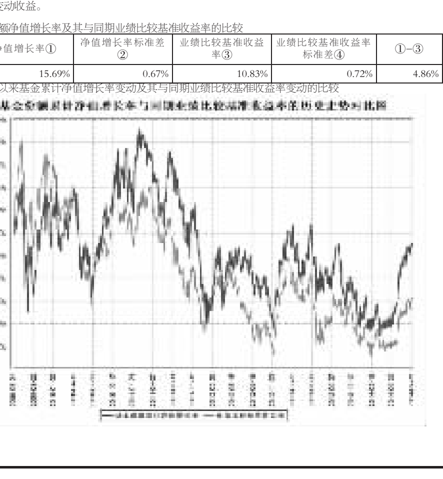
注2:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	15.69%	0.67%	10.83%	0.72%	4.86%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
俞忠华	副总经理兼投研中心总经理、投资总监、本基金基金经理	2013年2月8日	-	20	俞忠华先生,华东师范大学世界经济专业硕士。历任申银万国证券股份有限公司(原上海万国证券公司)国际业务部经理,国泰君安证券股份有限公司(原君安证券公司)国际业务部总经理,瑞士联盟银行(UBS)上海代表处副代表、授权官员,美国培基证券公司上海代表处首席代表、副总裁,霸菱亚洲投资公司执行董事,今日资本集团合伙人,光大证券股份有限公司销售交易部总经理、研究所常务副所长、资产管理总部总经理、证券投资部董事总经理、研究所所长。2012年3月进入本公司工作,曾任公司总经理助理,2012年6月至今任本公司副总经理兼投研中心总经理、投资总监。2012年7月至2014年3月任中海优质成长证券投资基金基金经理,2013年2月至今任中海量化策略股票型证券投资基金基金经理。
周其源	金融工程副总监、本基金基金经理	2013年10月24日	-	6	周其源先生,上海交通大学管理科学与工程专业博士。历任杭州恒生电子集团业务员,Lombard Risk Management Ltd. Co.(Lombard风险管理有限责任公司)金融工程师,太平洋资产管理有限责任公司高级研究员、高级投资经理。2012年5月进入本公司工作,现任金融工程副总监。2013年3月至2014年4月任中海可转换债券债券型证券投资基金基金经理,2013年10月至今任中海量化策略股票型证券投资基金基金经理。

注1:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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。

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,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,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。

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》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度,要求公司各组合研究成果共享,投资交易指令统一下达至交易室,由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易,使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实;同时,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的同日反向交易。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,由公司风险管理部对相关交易价格进行事前审核,风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,进行了相关的假设检验,对于相关溢价金额对组合收益率的贡献进行了重要性分析,并针对交易占优次数进行了时间序列分析。多维度的公平交易监控指标使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期,公司根据制度要求,对不同组合不同时间段的反向交易进行了统计分析,对于出现的公司制度中规定的异常交易,均要求相关当事人和审批人按照公司制度要求予以留痕。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况,对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况,风险管理部均根据制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留痕。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度股票市场,与之前结构性行情显然不同,呈现大小盘齐头并进的同涨格局,代表小盘股的创业板指数涨幅达10%左右,代表大盘股的沪深300指数涨幅达到13%左右。

短期诸多微刺激落实,利率缓步下行,房地产放开限购限贷,经济有望再次企稳,沪港通稳步推进,边际上改善投资者预期。低估值蓝筹股,当前已经逐步反映该预期,叠加经济数据较多低于预期,后市较可能维持震荡。同时,由于注册制愿景(IPO和新三板做市),将使得已经透支反映经济转型利好的高估值中小板股持续退潮。

着眼于当前行情的核心特征,短期重点关注土地流转、国企改革、兼并重组等与经济周期没有关系的主题股,中期重点关注边际仍将改善或者即将改善的,与日常消费、生物医药、高端装备等相关的受益标的。同时重点警惕三大风险:QE持续退出导致的资金外流风险、股市制度改革(注册制和退市制度等)导致的成长股持续回调风险、信用违约风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日, 本基金净值为0.944元(累计净值0.981元)。报告期内本基金净值增长率为15.69%,超越业绩比较基准4.86个百分点。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	135,757,368.50	78.21
	其中:股票	135,757,368.50	78.21
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	15,000,000.00	8.64
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	22,518,563.39	12.97
7	其他资产	305,154.24	0.18
8	合计	173,581,086.13	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	6,029,979.00	3.69
B	采矿业	7,937,633.84	4.85
C	制造业	67,195,546.58	41.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,389,393.32	1.46
E	建筑业	3,015,015.52	1.84
F	批发和零售业	10,948,564.22	6.70
G	交通运输、仓储和邮政业	6,614,700.00	4.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,537,200.00	2.16
J	金融业	11,775,396.72	7.20
K	房地产业	13,481,294.80	8.24
L	租赁和商务服务业	1,687,000.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,145,644.50	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	135,757,368.50	83.02

5.3 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

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	600315	上海家化	183,629	6,592,281.10	4.03
2	600108	亚盛集团	715,300	6,029,979.00	3.69
3	600048	保利地产	1,000,000	5,550,000.00	3.39
4	601857	中国石油	700,000	5,453,000.00	3.33
5	002556	辉隆股份	395,700	5,397,348.00	3.30
6	000538	云南白药	100,000	5,127,000.00	3.14
7	600837	海通证券	422,771	4,362,996.72	2.67
8	600079	人福医药	145,000	4,004,900.00	2.45
9	600030	中信证券	300,000	3,996,000.00	2.44
10	600585	海螺水泥	200,000	3,436,000.00	2.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 报告期末按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

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 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资产支持证券投资明细

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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除上海家化联合股份有限公司受到监管部门行政处罚外,其他发行主体未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、处罚的情形。上海家化联合股份有限公司董事会于2013年11月21日发布《上海家化联合股份有限公司关于收到上海证监局<行政监管措施决定书>的公告》,称公司接到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对上海家化联合股份有限公司采取责令改正措施的决定》。本基金投资上海家化的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。本基金管理人的投研团队对上海家化受调查及处罚事件进行了及时分析和跟踪研究,认为该事件对该公司投资价值未产生实质性影响。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	284,171.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,337.79
5	应收申购款	14,645.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	305,154.24

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	186,132,457.64
报告期期间基金总申购份额	1,108,267.77
减:报告期期间基金总赎回份额	13,940,133.06
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	173,300,592.35

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内,基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准募集中海量化策略股票型证券投资基金的文件
2、中海量化策略股票型证券投资基金基金合同
3、中海量化策略股票型证券投资基金托管协议
4、中海量化策略股票型证券投资基金财务报表及报表附注
5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

8.3 查阅方式

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)38789788或400-888-9788
公司网址:http://www.zhfund.com

中海基金管理有限公司
2014年10月25日