

中海纯债债券型证券投资基金

2015 第四季度报告

2015年12月31日

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

重要提示
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,不保证本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 交易代码, etc. Summary of fund details.

投资目标
本基金为纯债基金,主要投资于中国境内中短期债券,追求基金资产的长期增值。

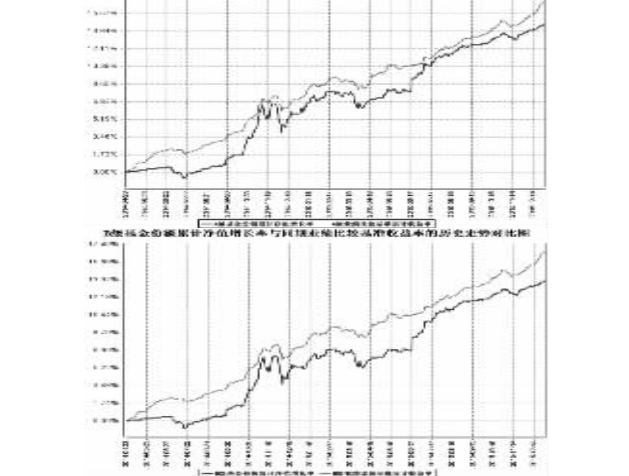
投资策略
本基金采用自上而下的投资策略,在严格控制风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准
中债综合全价指数

风险收益特征
本基金为纯债基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险和预期收益水平低于股票基金。

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
3.2 基金净值表现



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 冯小波, 职务: 基金经理

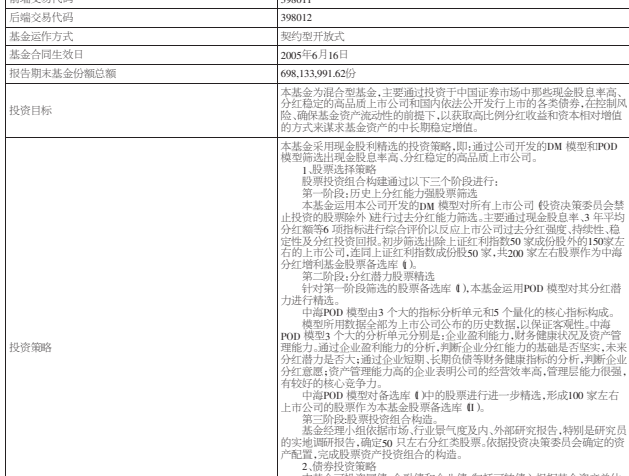
4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
基金管理人已在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,勤勉尽责地管理和运用基金资产。

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

重要提示
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,不保证本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
3.2 基金净值表现



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 冯小波, 职务: 基金经理

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
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》及其他法律法规、《基金合同》的规定,勤勉尽责地管理和运用基金资产。

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
3.2 基金净值表现

重要提示
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,不保证本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

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等情形。

4.3.1 公平交易制度的执行情况
根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等环节各环节,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过程进行了严格监控。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年1-11月,工业增加值增速6.1%,固定资产投资增速10.2%,固定资产投资增速前三季度下滑0.1%,社会消费品零售总额增速10.6%。

截至2015年12月31日,本基金A类份额净值1.145元(累计净值1.145元),报告期内本基金累计净增长率为1.61%,高于业绩比较基准1.14个百分点。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 1 权益投资 0.00

5.2 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 1 国策证券 7,577,570.00 0.94

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权证投资明细
序号 1 德盛转债 0.00 0.00

5.4 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债券投资明细
序号 1 国策证券 7,577,570.00 0.94

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十名资产支持证券投资明细
序号 1 国策证券 7,577,570.00 0.94

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 本报告期间,本基金未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.10.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.11.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.12 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.12.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.13 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.13.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.14 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.14.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.15 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.15.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.16 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.16.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.17 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.17.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.18 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.18.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.19 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.19.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.20 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.20.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.21 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.21.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.22 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.22.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.23 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.23.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.24 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.24.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.25 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.25.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.26 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.26.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.27 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.27.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.28 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.28.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.29 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.29.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.30 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.30.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.31 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.31.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.32 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.32.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.33 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.33.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.34 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.34.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.35 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.35.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.36 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.36.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

5.37 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.37.1 本报告期间,本基金未进行国债期货交易。

中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金

2015 第四季度报告

2015年12月31日

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

重要提示
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,不保证本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
3.2 基金净值表现

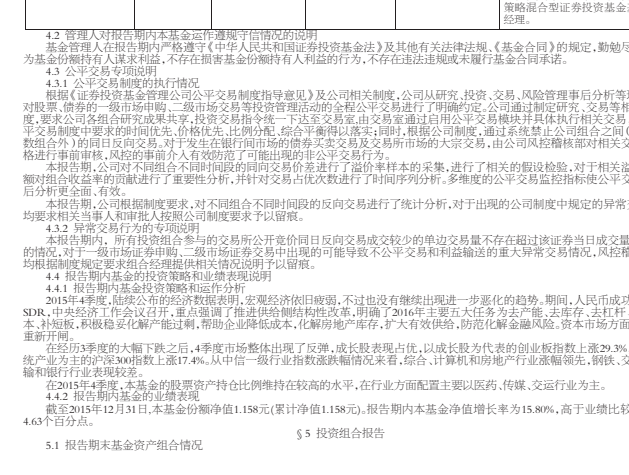


4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 文开明, 职务: 基金经理

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
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》及其他法律法规、《基金合同》的规定,勤勉尽责地管理和运用基金资产。

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
3.2 基金净值表现



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 文开明, 职务: 基金经理

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
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》及其他法律法规、《基金合同》的规定,勤勉尽责地管理和运用基金资产。

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
3.2 基金净值表现



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 文开明, 职务: 基金经理

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
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》及其他法律法规、《基金合同》的规定,勤勉尽责地管理和运用基金资产。

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

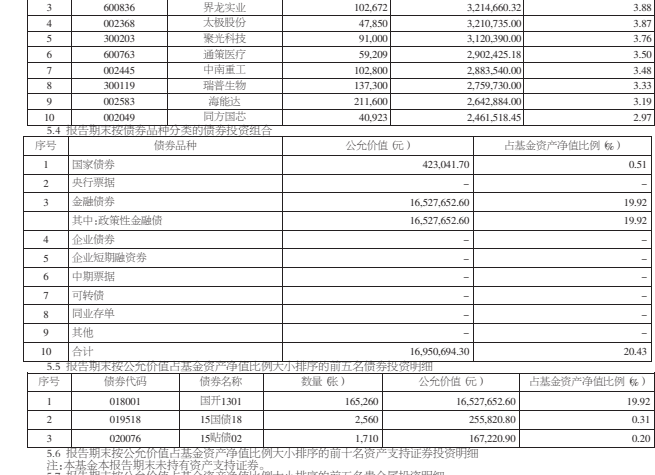
3.1 主要财务指标
3.2 基金净值表现

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

重要提示
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,不保证本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
3.2 基金净值表现



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 文开明, 职务: 基金经理

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
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》及其他法律法规、《基金合同》的规定,勤勉尽责地管理和运用基金资产。

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
3.2 基金净值表现



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 文开明, 职务: 基金经理

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
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》及其他法律法规、《基金合同》的规定,勤勉尽责地管理和运用基金资产。

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
3.2 基金净值表现



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 文开明, 职务: 基金经理

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
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》及其他法律法规、《基金合同》的规定,勤勉尽责地管理和运用基金资产。

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
3.2 基金净值表现