

中海能源策略混合型证券投资基金

2016 第二季度报告

2016年6月30日

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金管理人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19日

1.1 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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定,于2016年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等相关内容,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者有投资高风险、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。
本报告中财务资料截止日:本报告期末(2016年6月30日)起至6月30日止。

§2 基金基本情况

基金简称	中海能源策略混合
基金代码	390021
交易代码	390021
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2007年5月13日
报告期末基金份额总额	2,104,982,982.92份

§3 主要财务指标和基金净值表现

1.本期已实现收益	415,577.57
2.本期利润	132,980.097
3.加权平均基金份额本期利润	0.00029
4.期末基金资产净值	1,471,785,130.49
5.期末基金份额净值	0.6992

§4 投资组合报告

4.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1,177,078,264.38	79.60
2	基金投资	1,177,078,264.38	79.60
3	固定收益投资	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	300,484,946.25	20.32
8	其他资产	1,194,939.25	0.08
9	合计	1,478,758,141.62	100.00

§5 投资组合报告

5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	569,608,685.16	38.30
C	制造业	417,867,358.69	28.29
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	22,284,136.50	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	129,528,678.63	8.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	32,297,279.30	2.19
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	20,126.10	0.00
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	医药制造业、医药批发和零售业	-	-
P	教育	-	-
Q	综合	-	-
S	合计	1,177,078,264.38	79.98

§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	600517	宁德时代	4,928,401	119,964,200.98	8.17
2	600247	山东黄金	3,022,934	116,444,161.94	7.94
3	600988	招商证券	6,239,858	116,246,351.76	7.93
4	600849	中国黄金	10,177,073	114,390,502.70	7.91
5	002007	华信资本	2,506,740	78,611,638.04	5.35
6	300011	阳光电源	3,222,002	75,270,206.00	5.14
7	002155	湘财股份	5,732,188	75,092,915.06	5.13
8	601899	紫金矿业	17,250,100	58,132,037.60	3.95
9	601099	西部矿业	2,472,340	57,383,011.40	3.90
10	002176	金诚信	2,275,780	42,292,308.00	2.87

§7 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*65%+上证国债指数收益率*35%

§8 基金管理人及基金托管人

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

§1 基金投资组合

1.1 报告期末基金资产组合情况

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.3 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

1.4 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

1.5 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权证投资明细

1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

1.7 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国债期货投资明细

1.8 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资产支持证券投资明细

1.9 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

1.10 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大宗商品投资明细

1.11 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衍生品投资明细

1.12 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其他资产投资明细

§2 基金业绩比较基准

§3 基金管理人及基金托管人

§4 基金业绩比较基准

§5 基金管理人及基金托管人

§6 基金业绩比较基准

§7 基金管理人及基金托管人

§8 基金业绩比较基准

§9 基金管理人及基金托管人

§10 基金管理人及基金托管人

§11 基金管理人及基金托管人

§12 基金管理人及基金托管人

§13 基金管理人及基金托管人

§14 基金管理人及基金托管人

§15 基金管理人及基金托管人

§16 基金管理人及基金托管人

§17 基金管理人及基金托管人

§18 基金管理人及基金托管人

§19 基金管理人及基金托管人

§20 基金管理人及基金托管人

§21 基金管理人及基金托管人

§22 基金管理人及基金托管人

§23 基金管理人及基金托管人

§24 基金管理人及基金托管人

§25 基金管理人及基金托管人

§26 基金管理人及基金托管人

§27 基金管理人及基金托管人

§28 基金管理人及基金托管人

§29 基金管理人及基金托管人

§30 基金管理人及基金托管人

§31 基金管理人及基金托管人

§32 基金管理人及基金托管人

§33 基金管理人及基金托管人

§34 基金管理人及基金托管人

§35 基金管理人及基金托管人

§36 基金管理人及基金托管人

§37 基金管理人及基金托管人

§38 基金管理人及基金托管人

§39 基金管理人及基金托管人

§40 基金管理人及基金托管人

§41 基金管理人及基金托管人

§42 基金管理人及基金托管人

§43 基金管理人及基金托管人

§44 基金管理人及基金托管人

§45 基金管理人及基金托管人

§46 基金管理人及基金托管人

§47 基金管理人及基金托管人

§48 基金管理人及基金托管人

§49 基金管理人及基金托管人

§50 基金管理人及基金托管人

§51 基金管理人及基金托管人

§52 基金管理人及基金托管人

§53 基金管理人及基金托管人

§54 基金管理人及基金托管人

§55 基金管理人及基金托管人

§56 基金管理人及基金托管人

§57 基金管理人及基金托管人

§58 基金管理人及基金托管人

§59 基金管理人及基金托管人

§60 基金管理人及基金托管人

§61 基金管理人及基金托管人

§62 基金管理人及基金托管人

§63 基金管理人及基金托管人

§64 基金管理人及基金托管人

§65 基金管理人及基金托管人

§66 基金管理人及基金托管人

§67 基金管理人及基金托管人

§68 基金管理人及基金托管人

§69 基金管理人及基金托管人

§70 基金管理人及基金托管人

§71 基金管理人及基金托管人

§72 基金管理人及基金托管人

§73 基金管理人及基金托管人

§74 基金管理人及基金托管人

§75 基金管理人及基金托管人

§76 基金管理人及基金托管人

§77 基金管理人及基金托管人

§78 基金管理人及基金托管人

§79 基金管理人及基金托管人

§80 基金管理人及基金托管人

§81 基金管理人及基金托管人

§82 基金管理人及基金托管人

§83 基金管理人及基金托管人

§84 基金管理人及基金托管人

§85 基金管理人及基金托管人

§86 基金管理人及基金托管人

§87 基金管理人及基金托管人

§88 基金管理人及基金托管人

§89 基金管理人及基金托管人

§90 基金管理人及基金托管人

§91 基金管理人及基金托管人

§92 基金管理人及基金托管人

§93 基金管理人及基金托管人

§94 基金管理人及基金托管人

§95 基金管理人及基金托管人

§96 基金管理人及基金托管人

§97 基金管理人及基金托管人

§98 基金管理人及基金托管人

§99 基金管理人及基金托管人

§100 基金管理人及基金托管人

§101 基金管理人及基金托管人

§102 基金管理人及基金托管人

§103 基金管理人及基金托管人

§104 基金管理人及基金托管人

§105 基金管理人及基金托管人

§106 基金管理人及基金托管人

§107 基金管理人及基金托管人

§108 基金管理人及基金托管人

§109 基金管理人及基金托管人

§110 基金管理人及基金托管人

§111 基金管理人及基金托管人

§112 基金管理人及基金托管人

§113 基金管理人及基金托管人

§114 基金管理人及基金托管人

§115 基金管理人及基金托管人

§116 基金管理人及基金托管人

§117 基金管理人及基金托管人

§118 基金管理人及基金托管人

§119 基金管理人及基金托管人

§120 基金管理人及基金托管人

§121 基金管理人及基金托管人

§122 基金管理人及基金托管人

§123 基金管理人及基金托管人

§124 基金管理人及基金托管人

§125 基金管理人及基金托管人

§126 基金管理人及基金托管人

§127 基金管理人及基金托管人

§128 基金管理人及基金托管人

§129 基金管理人及基金托管人

§130 基金管理人及基金托管人

§131 基金管理人及基金托管人

§132 基金管理人及基金托管人

§133 基金管理人及基金托管人

§134 基金管理人及基金托管人

§135 基金管理人及基金托管人

§136 基金管理人及基金托管人

§137 基金管理人及基金托管人

§138 基金管理人及基金托管人

§139 基金管理人及基金托管人

§140 基金管理人及基金托管人

§141 基金管理人及基金托管人

§142 基金管理人及基金托管人

§143 基金管理人及基金托管人

§144 基金管理人及基金托管人

§145 基金管理人及基金托管人

§146 基金管理人及基金托管人

§147 基金管理人及基金托管人

§148 基金管理人及基金托管人

§149 基金管理人及基金托管人

§150 基金管理人及基金托管人

§151 基金管理人及基金托管人

§152 基金管理人及基金托管人

§153 基金管理人及基金托管人

§154 基金管理人及基金托管人

§155 基金管理人及基金托管人

§156 基金管理人及基金托管人

§157 基金管理人及基金托管人

§158 基金管理人及基金托管人

§159 基金管理人及基金托管人

§160 基金管理人及基金托管人

§161 基金管理人及基金托管人

§162 基金管理人及基金托管人

§163 基金管理人及基金托管人

§164 基金管理人及基金托管人

§165 基金管理人及基金托管人

§166 基金管理人及基金托管人

§167 基金管理人及基金托管人

§168 基金管理人及基金托管人

§169 基金管理人及基金托管人

§170 基金管理人及基金托管人

§171 基金管理人及基金托管人

§172 基金管理人及基金托管人

§173 基金管理人及基金托管人

§174 基金管理人及基金托管人

§175 基金管理人及基金托管人

§176 基金管理人及基金托管人

§177 基金管理人及基金托管人

§178 基金管理人及基金托管人

§179 基金管理人及基金托管人

§180 基金管理人及基金托管人

§181 基金管理人及基金托管人

§182 基金管理人及基金托管人

§183 基金管理人及基金托管人

§184 基金管理人及基金托管人

§185 基金管理人及基金托管人

§186 基金管理人及基金托管人

§187 基金管理人及基金托管人

§188 基金管理人及基金托管人

§189 基金管理人及基金托管人

§190 基金管理人及基金托管人

§191 基金管理人及基金托管人