中海货币市场证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21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1月17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2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中海货币
基金主代码	392001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年7月28日
报告期末基金份额总额	1,688,562,218.00份
投资目标	在保证资产安全与资产充分流动性前提下,追求高于业绩比较基准的收益率,为基金份额持有人创造稳定的当期收益。
投资策略	1、利率预期策略 根据对宏观经济和利率走势的分析,本基金将制定利率预期策略。如果预期利率下降,将增加组合的久期;反之,如果预期利率将上升,则缩短组合的久期。 2、期限结构配置策略 各类债券资产在期限结构上的配置是本基金所选择的收益率曲线策略在资产配置过程中的具体体现,本基金采用总收益分析法在子弹组合、杠铃组合、梯形组合等三种基础类型中进行选择。 3、类属配置策略 根据各类短期固定收益类金融工具的市场规模、收益性和流动性,决定各类资产的配置比例;再通过评估各类资产的流动性和收益性利差,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。 4、流动性管理策略 在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下,通过基金资产安排(包括现金库存、资产变现、剩余期限管理或以其他措施),保证基金资产的高流动性。 5、套利策略 本基金的套利策略主要是利用不同市场、不同期限和不同品种之间的收益率差异,通过融入和融出的资金安排,获取无风险的利差收益。
业绩比较基准	同期7天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属货币市场证券投资基金,为证券投资基金中的低风险品种。 本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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
下属两级基金的基金简称	中海货币A　　中海货币B
下属两级基金的交易代码	392001　　392002
报告期末下属两级基金的份额总额	235,005,697.95份　　1,453,556,520.05份

§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(2013年10月1日 - 2013年12月31日)	
	中海货币A	中海货币B
1. 本期已实现收益	3,346,300.78	18,415,120.37
2.本期利润	3,346,300.78	18,415,120.37
3.期末基金资产净值	235,005,697.95	1,453,556,520.05

注1:本报告期是指自2013年10月1日至2013年12月31日。

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

注3:本基金收益分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

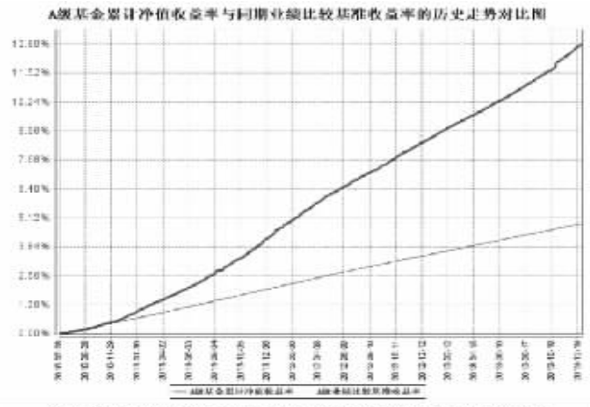
中海货币A

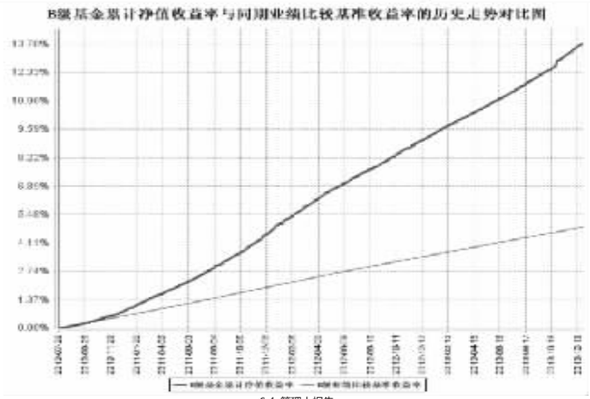
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.2088%	0.0099%	0.3300%	0.0000%	0.8788%	0.0099%

中海货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.2698%	0.0098%	0.3300%	0.0000%	0.9398%	0.0098%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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		
冯小波	本基金基金经理	2012年10月26日	-	11	冯小波先生,上海交通大学管理科学与工程专业硕士。历任华泰保险股份有限公司交易员,平安证券股份有限公司投资经理。兴业银行股份有限公司债券交易员,高级副理。2012年8月进入本公司工作,任职于投研中心。2012年10月至今任中海货币市场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的定。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,由交易室通过自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。

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

2013年四季度,宏观经济增长稳中趋缓,10月和11月官方采购经理人指数(PMI)均为51.4,12月PMI为51,整体水平略高于三季度,表明经济增长较为平稳,但12月意外回落使得市场担忧未来增长乏力。工业增速较为平稳,工业增加值同比增速自9月以来一直维持在10%以上的两位数增长速度。由于去年同期基数较低,四季度物价指数读数较高,但整体通胀水平可控。四季度,银行间市场资金面未见明显改善,而债券市场供求不平衡格局发展到一定极限,导致11月份债券收益率急速飙升。

本基金在四季度仍然是基于流动性的考虑来安排日常投资,在结构上相对均衡,信用产品和存款仍然是本季度基金的主要持仓。在操作上,各资产比例严格按照法规要求,没有出现流动性风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,报告期内本基金A净值收益率为1.2088%,高于业绩比较基准0.8788个百分点;报告期内本基金B净值收益率为1.2698%,高于业绩比较基准0.9398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	固定收益投资	965,804,538.48	48.95
	其中:债券	965,804,538.48	48.95
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	293,600,767.90	14.88
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	526,223,146.30	26.67
4	其他资产	187,278,645.68	9.49
5	合计	1,972,907,098.36	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.05	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	282,898,815.65	16.75
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额没有超过资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	85
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	101
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	55

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

根据本基金基金合同规定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天,下同。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.08	16.75
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	7.61	-
2	30天(含)-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	21.81	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.45	-
4	90天(含)-180天	3.53	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	18.32	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	105.75	16.75

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	286,719,834.54	16.98
	其中:政策性金融债	286,719,834.54	16.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	679,084,703.94	40.22
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	965,804,538.48	57.20
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	186,764,718.14	11.06

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130306	13进出06	1,300,000	128,477,936.97	7.61
2	041355037	13徐工CP002	1,200,000	119,509,332.06	7.08
3	130201	13国开01	1,000,000	99,955,116.40	5.92
4	041351012	13雅砻江CP001	800,000	80,030,758.15	4.74
5	041364040	13澄星CP003	700,000	70,000,128.23	4.15
6	041361028	13青铜峡CP001	600,000	59,611,055.98	3.53
7	120227	12国开27	600,000	58,286,781.17	3.45
8	041360015	13森工集CP001	500,000	50,015,113.62	2.96
9	041352007	13中铝CP001	500,000	49,988,243.17	2.96
10	041351051	13苏交通CP007	500,000	49,956,772.58	2.96

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	8
报告期内偏离度的最高值	0.1311%
报告期内偏离度的最低值	-0.3215%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1522%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提收益。

5.8.2

本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,未发生该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	17,398,254.15
4	应收申购款	169,880,391.53
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	187,278,645.68

5.8.5 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	中海货币A	中海货币B
报告期期初基金份额总额	133,014,158.61	1,267,879,700.18
报告期期间基金总申购份额	776,835,033.11	2,554,080,458.83
减:报告期期间基金总赎回份额	674,843,493.77	2,368,403,638.96
报告期期末基金份额总额	235,005,697.95	1,453,556,520.05

§7 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货币市场证券投资基金的文件

2、中海货币市场证券投资基金基金合同

3、中海货币市场证券投资基金托管协议

4、中海货币市场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1月21日

中海能源策略混合型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21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1月17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2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中海能源策略混合
基金主代码	398021
交易代码	398021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月13日
报告期末基金份额总额	5,199,336,519.82份
投资目标	在世界能源短缺和中国经济增长模式向节约型转变的背景下,以能源为投资主题,重点关注具备能源竞争优势的行业和企业,精选个股,并结合积极的权重配置,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、一级资产配置:本基金根据股票和债券估值的相对吸引力模型(ASSVM、A Share Stocks Valuation Model),依据宏观经济分析和股票债券估值比较进行一级资产配置。ASSVM模型通过对股票市场和债券市场相对估值判断,决定股票和债券仓位配置。投资决策委员会作为本基金管理人投资的最高决策机构和监督执行机构,决定本基金的一级资产配置。 2、股票投资:本基金围绕能源主题。首先,根据摩根斯坦利和标准普尔公司联合发布的全球行业四级分类标准(GICS),对A股所有行业进行了重新划分。将A股所有行业划分为能源供给型行业和能源消耗型行业;然后,将能源供给型行业细分为能源生产行业和能源设备与服务行业,将能源消耗型行业细分为低耗能行业和高耗能行业(能源下游需求各行业能耗相对高低的界定,主要来源于国家统计局和国家发改委的相关文件)。 本基金股票资产的行业配置主要依据中海能源竞争优势评估体系。本基金依托中海油在能源研究方面的独特优势,收集整理外部能源专家和其他研究机构的研究成果,综合考虑全球地缘政治、军事、经济、气象等多方面因素,结合本公司内部能源研究小组的研究,对未来能源价格的趋势进行预测。在此基础上,行业研究小组根据经济增长和能源约束的动态发展关系,结合未来能源价格趋势的预测,从能源策略的角度,确定能源主题类行业(包括能源供给型行业、高耗能行业中单位能耗产出比具有竞争优势的企业和低耗能行业)在组合中的权重。在能源价格趋势向上时,提高能源生产行业、能源设备与服务行业的权重配置。当能源价格趋势向下时,加大高耗能行业中单位能耗产出比具有竞争优势的企业的权重配置。同时本基金还将动态调整行业的配置权重,规避能源价格波动引起的风险。 3、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。 4、权证投资 本基金的权证投资将以保值为主要投资策略,以达到控制正股下跌风险、实现保值和锁定收益的目的。同时,发掘潜在的套利机会,以达到增值目的。 本基金持有的权证,可以是因上市公司派送而被动持有的权证,也可以是根据权证投资策略在二级市场上主动购入的权证。
业绩比较基准	沪深300指数涨跌幅×65%+上证国债指数涨跌幅×35%
风险收益特征	本基金属混合型证券投资基金,为证券投资基金中的中高风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金、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(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	7,989,447.61
2.本期利润	-88,091,329.65
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0167
4.期末基金资产净值	3,159,777,007.27
5.期末基金份额净值	0.6077

注1:本期指2013年10月1日至2013年12月31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。

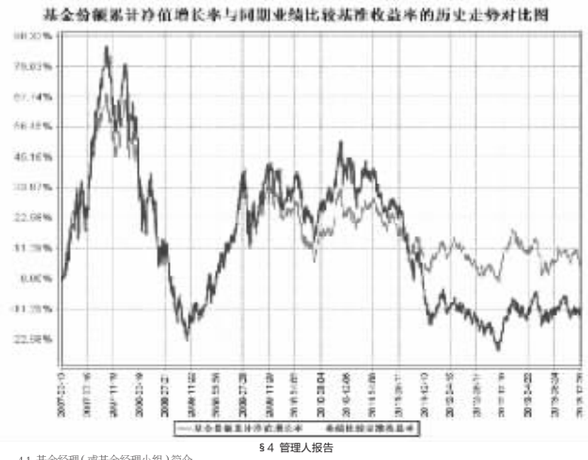
注2:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-2.64%	1.00%	-1.84%	0.73%	-0.80%	0.27%

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		
许定晴	研究总监、本基金基金经理	2011年12月14日	-	10	许定晴女士,苏州大学金融学专业硕士。曾任国联证券股份有限公司研究员。2004年3月进入本公司工作,历任分析师、高级分析师、基金经理助理、现任研究总监。2010年3月至2012年7月任中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2011年12月至今任中海能源策略混合型证券投资基金基金经理。
王巍	本基金基金经理、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2013年2月8日	-	13	王巍先生,清华大学工商管理专业硕士。历任北方证券有限公司投资经理,Emperor Investment Management Ltd.(依铂瑞投资管理公司)研究员、组合经理,海通证券股份有限公司高级投资经理。2012年4月进入本公司工作,任职于投研中心。2012年7月至今任中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2013年2月至今任中海能源策略混合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的定。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,由交易室通过自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,对于相关溢价金额和组合的收益率进行了重要性分析,针对交易占优次数进行了时间序列分析。同时,对不同组合的换手率进行分析,观察组合经理交易习惯是否发生重大变化。对不同组合的持仓相似度进行统计对比,观察是否存在不同组合经理管理的组合持仓高度相似的情况。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

2013年四季度,宏观经济增长稳中趋缓,10月和11月官方采购经理人指数(PMI)均为51.4,12月PMI为51,整体水平略高于三季度,表明经济增长较为平稳,但12月意外回落使得市场担忧未来增长乏力。工业增速较为平稳,工业增加值同比增速自9月以来一直维持在10%以上的两位数增长速度。由于去年同期基数较低,四季度物价指数读数较高,但整体通胀水平可控。四季度,银行间市场资金面未见明显改善,而债券市场供求不平衡格局发展到一定极限,导致11月份债券收益率急速飙升。

未来的经济增速与物价水平的变化及政府的政策特别是对于社会融资总量的调控政策变化,是影响证券市场最为重要的影响因素。对上述各种因素我们要保持实时跟踪。债券市场方面,未来的运作要坚持稳健的原则,重点关注流动性风险与信用风险,在控制信用风险的前提下继续着重配置信用债资产。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金份额净值1.042元(累计净值1.322元)。报告期内本基金净值增长率为-2.07%,高于业绩比较基准0.30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	118,105,842.12	93.70
	其中:债券	118,105,842.12	93.70
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	506,671.68	0.40
6	其他资产	7,431,712.78	5.90
7	合计	126,044,226.58	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

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:本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,999,000.00	8.74
	其中:政策性金融债	9,999,000.00	8.74
4	企业债券	97,221,758.10	85.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	10,885,084.02	9.52
8	其他	-	-
9	合计	118,105,842.12	103.29

截至2013年12月31日,本基金份额净值0.6077元(累计净值0.9177元)。报告期内本基金净值增长率为-2.64%,低于业绩比较基准0.80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	2,360,049,528.57	74.09
	其中:股票	2,360,049,528.57	74.09
2	固定收益投资	343,224,135.60	10.77
	其中:债券	343,224,135.60	10.77
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	354,901,006.75	11.14
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	81,625,440.92	2.56
6	其他资产	45,771,250.93	1.44
7	合计	3,185,571,362.77	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	-	-
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	178,781,444.28	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	1,675,747.08	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	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,360,049,528.57	74.69

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	000731	四川美丰	27,731,554	274,265,069.06	8.68
2	300124	汇川技术	3,855,793	225,525,332.57	7.14
3	002317	众生药业	7,954,667	156,706,939.90	4.96
4	002038	双鹭药业	3,038,491	153,595,720.05	4.86
5	600557	康缘药业	4,265,398	129,753,407.16	4.11
6	000581	威孚高科	3,620,347	111,506,687.60	3.53
7	000963	华东医药	2,372,736	109,145,856.00	3.45
8	601766	中国南车	19,985,776	100,128,737.76	3.17
9	601126	四方股份	5,058,605	97,378,146.25	3.08
10	601965	中国汽研	6,278,551	84,132,583.40	2.66

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	128,726,000.00	4.07
	其中:政策性金融债	128,726,000.00	4.07
4	企业债券	99,132,970.00	3.14
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	115,365,165.60	3.65
8	其他	-	-
9	合计	343,224,135.60	10.86

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	040206	04国开06	600,000	59,796,000.00	1.89
3	1380163	13宿建投债	500,000	47,480,000.00	1.50
4	070406	07农发06	400,000	39,728,000.00	1.26
5	1180093	11丰国资债	300,000	29,442,000.00	0.93

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

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	7,014,486.80
5	应收申购款	6,120.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,771,250.93

5.10.4 报告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

5.10.5 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。

5.10.6 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	5,380,496,823.23
报告期期间基金总申购份额	2,496,515.51
减:报告期期间基金总赎回份额	183,656,818.92
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	5,199,336,519.82

§7 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能源策略混合型证券投资基金的文件

2、中海能源策略混合型证券投资基金基金合同

3、中海能源策略混合型证券投资基金托管协议

4、中海能源策略混合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