

中海优质成长证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

期间十八届三中全会召开,政府提出了一系列改革措施,将对中国经济的中长期发展产生积极影响,不过改革措施存在一个逐步落实的过程,短期中产落实现实性和上市公司业绩上,因此短期的积极影响较为有限。证券市场方面,最重要的事情是证监会发布了新股发行制度改革方案,IPO将重新启动,在这样的大背景下,市场整体预期相对较乐观。四季度,本基金股票仓位50%,在持仓结构上略有调整,增持了医药、软件、安防等行业中确定性成长股的配置,减持了地产等周期性行业。

4.4.2 报告期内基金的投资业绩
截至2013年12月31日,本基金份额净值5500元(累计净值28514元),报告期内本基金净值增长率为70.75%,高于业绩比较基准3.00个百分点。

1	权益投资	1,715,223,663.49	48.54
	其中:股票	1,715,223,663.49	48.54
2	固定收益投资	158,895,000.00	4.50
	其中:债券	158,895,000.00	4.50
	货币支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	1,900,616,295.92	39.35
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	其他资产	1,465,399.08	0.80
7	合计	3,533,546.04	100.00

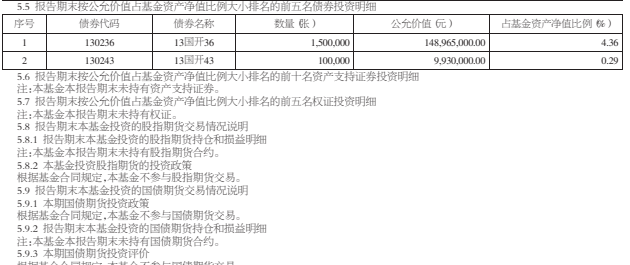
3.2 报告期末行业分类的股权投资组合

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	81,977,082.31	1.85
B	采矿业	11,053,555.10	0.32
C	制造业	609,096,868.58	17.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,996,266.56	0.73
E	建筑业	82,734,336.88	2.42
F	批发和零售业	99,289,882.95	2.91
G	交通运输、仓储和邮政业	2,357,410.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	医疗保健业	-	-
J	软件和信息技术服务业	575,784,524.15	16.86
K	金融业	34,619,698.29	1.01
L	房地产业	81,110,928.52	2.36
M	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	房地产业				
P	居民服务、修理和其他服务业				
Q	教育				
R	卫生和社会工作				
S	文化、体育和娱乐业	108,393,116.15			4.93
T	综合				
	合计	1,715,522,665.49			50.22
5.3 报告期末按公允价值计量且公允价值变动计入当期损益的前十名股权投资明细					
序号	被投资单位 (简称)	数量(股)	公允价值(元)	公允价值变动(元)	权益法下净损益(元)
	医药医疗	32,711,000	31,567,500.00		6.00

2	300020	银江股份	6,097.653	241,021.325	5.93
3	601928	凤凰传媒	16,290.300	155,352.868.00	4.55
4	002557	洽合食品	4,771.181	115,176.309.34	3.37
5	600515	上海家化	2,484.599	104,924,615.77	3.07
6	600511	国药股份	5,261.785	99,280.882.95	2.91
7	600557	康缘药业	3,223.308	98,053,029.36	2.86
8	002545	海康影视	3,826.927	87,942.782.46	2.57
9	601669	中国中免	25,669.784	78,898.336.88	2.31

10	中国民生银行		16,047,000	69,111,248,000	2,002
序号	债券品种及债券信息	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)		
1	国债逆回购	-	-		
2	央行票据	-	-		
3	金融债	158,895,000.00	4.65		
4	企业短期融资券	158,895,000.00	4.65		
5	公司债及中期票据	-	-		
6	中期票据	-	-		
7	可转债	-	-		
8	其他	-	-		
合计		158,895,000.00	4.65		



序号	名称	金额 (元)
1	存出保正金	2,174,909.42
2	应收证卷清算款	--
3	应收股利	--
4	应收利息	9,256,926.66
5	应收中票款	20,031,563.90
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	31,463,399.98

10.4 报告期内持有的处于转股期的可转换债券明细	
注：本基金未持有处于转股期的可转换债券	
10.5 报告期内前十名股票中持有流通受限情况的说明	
注：本基金未持有处于流通受限的股票	
10.6 报告期内持有的其他上市公司证券明细	
注：本基金由于公允价值变动、分派股利和会计差错之间可能存在误差	
6 开放式基金资产变动	
	单位：元
报告期期初基金资产总额	6,104,164,865.08
报告期期间基金总资产的增幅	534,231,170.61
报告期期间基金总资产的增幅	427,902,565.65
报告期期间基金总资产减少的原因(如赎回款支付、一揽子赎回)	
报告期期末基金资产的总额	6,210,495,735.04
7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	
注：本报告内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，基金管理人持有本基金共37,006,954.99份。	
8 其他重要事项	
8.1 重要事件目录	
1. 中国证监会核准海通证券股份有限公司投资证券投资基金的文件	
2. 中国证监会核准海通证券基金总部	
3. 中国证监会核准海通证券投资证券投资基金投资	
4. 中国证监会核准海通证券投资证券投资基金投资	
5. 中国证监会核准海通证券投资证券投资基金投资	
6. 报告期内在指定报刊上披露的各项公告	
7. 在央视网	
上海市浦东新区锦城路68号2-208室及夹层	
上海市浦东新区锦城路68号2-208室及夹层	
咨询电话：(021)38789788/888-888-8888	
公司网址：http://www.htfund.com	

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	9,930,000.00	5.70
	其中:政策性金融债	9,930,000.00	5.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	38,247,850.00	21.54
8	其他	-	-

[illegible]

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有在基金合同规定投资范围之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	443,408.81
2	应收证券清算款	1,580,754.92
3	应收股利	-
4	应收利息	218,855.00
5	其他应收款	6,641.92
6	待摊费用	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	2,249,659.65

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	1131001	中债转债	15,804,450.00	9.12
2	100018	国开转债	3,084,500.00	1.78
3	1131003	董司转债	1,165,300.00	0.67

5.10.3 报告期内前十名债券中存在流通受限情况的说明
注：本基金为报告期内前十名债券中不存在流通受限情况。

5.10.4 报告期内前十名债券中不存在流通受限情况的说明
本基金由于四只基金的原因，分债之和与合计项之间可能存在误差。

5 开放式基金资产变动

单位：元

[illegible]

中海基金管理有限公司

2013 第四季度 报告

2013年 12 月 31 日

[illegible]

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有在基金合同规定投资范围之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	443,408.81
2	应收证券清算款	1,580,754.92
3	应收股利	-
4	应收利息	218,855.00
5	其他应收款	6,641.92
6	待摊费用	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	2,249,659.65

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	1131001	中债转债	15,804,450.00	9.12
2	100018	国开转债	3,084,500.00	1.78
3	1131003	董司转债	1,165,300.00	0.67

5.10.3 报告期内前十名债券中存在流通受限情况的说明
注：本基金为报告期内前十名债券中不存在流通受限情况。

5.10.4 报告期内前十名债券中不存在流通受限情况的说明
本基金由于四只基金的原因，分债之和与合计项之间可能存在误差。

5 开放式基金资产变动

单位：元

[illegible]