中银中证 100 指数增强型证券投资基金

2009年第四季度报告

2009年 12 月 31 日

基金管理人：中银基金管理有限公司 基金托管人：中国建设银行股份有限公司 报告送出日期：二〇一〇年一月二十二日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 1 月 18 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 2009 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中银中证 100 指数增强
基金主代码	163808
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年 9 月 4 日
报告期末基金份额总额	2,518,122,862.84 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，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现对中证 100 指数的有效跟踪并力争实现超越，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数化投资作为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整，在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在严控偏离风险及力争适度超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离业绩比较基准的风险，本基金力求控制基金份额净值增长率与业绩比较基准间的日跟踪误差不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：中证 100 指数收益率×90% + 银行同业存款利率×10%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2009 年 10 月 1 日 –2009 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	61,027,919.81
2.本期利润	183,273,255.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0635
4.期末基金资产净值	2,638,678,168.51
5.期末基金份额净值	1.048

注：1、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。

2、所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

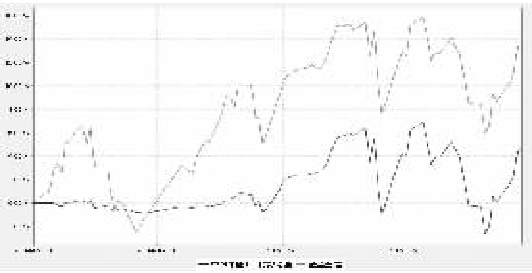
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去 3 月	5.75%	1.29%	15.28%	1.57%	–9.53%	–0.28%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

中银中证 100 指数增强型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2009 年 9 月 4 日至 2009 年 12 月 31 日）



注：1、本基金合同于 2009 年 9 月 4 日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至报告日本基金尚在建仓期。

§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		
吴域	中银中证 100 指数增强基金经理、中银中国基金经理	2009–9–4	–	9	中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），经济学硕士。曾于世纪证券自营部、东方证券资产管理部、生命人寿保险公司资产管理部先后从事行业研究，投资组合研究工作。2007 年 8 月至今任中银中国基金经理，2009 年 9 月至今任中银中证 100 指数增强基金经理。具有 9 年证券投资研究经验，具备证券、基金从业资格。
陈军	中银中证 100 指数增强基金经理、中银收益基金经理	2009–9–4	–	12	中银基金管理有限公司投资管理部权益投资总监、副总裁(VP)，金融学硕士。曾任中信证券股份有限责任公司资产管理部项目经理。2006 年 9 月至今任中银收益基金经理，2009 年 9 月至今担任中银中证 100 指数增强基金经理。具有 12 年投资分析经验，特许金融分析师（CFA），香港财经分析师学会会员，具备基金从业资格。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

在本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和《中银基金管理公司公平交易管理制度》，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发生异常交易行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

无投资风格相似基金

4.3.3 异常交易行为的专项说明

无

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一、宏观经济、行情回顾与运作分析

1.宏观经济分析

4 季度全球宏观经济复苏明显，发达国家的经济进一步企稳回升，国内宏观经济延续前三季度的复苏态势。

美国最新公布的 2009 年第三季度 GDP 出现了 2008 年春季以来的首次增长，修正后 GDP 数据为年化环比增长 2.2%。美国 12 月份制造业指数升至 55.9，已连续第五个月处于扩张状态，制造业已经走出衰退。美元指数 12 月初受就业数据超预期的影响，大幅走强，显示美国经济周期性的恢复领先于其他发达经济体。但目前美国的就业与信贷市场仍难言乐观，考虑到一系列信贷支持政策将陆续到期，如若没有后续的政策支持力量，消费增长仍将面临压力。由于美国经济确实在复苏，美联储已开始考虑逐步退出量化宽松的货币政策，当然，毕竟失业率还在高位，信贷扩张依旧低迷，市场对美联储短期内加息的预期还是偏弱。欧元区 2009 年第三季度 GDP 环比增长 0.4%，其中德国、法国经济复苏较快，希腊、西班牙等国则纷纷陷入危机，经济复苏不均衡现象凸显，这也表明经济危机对欧元区的威胁仍未结束。欧元区 12 月通胀年率也增至 10 个月来的高点 0.9%。与发达经济体相比，新兴市场复苏的步伐更快，但越南和印度等国家由于去年资金流入过多，通胀压力明显增大。

在外部经济持续向好的情况下，国内宏观经济延续了前三季度的复苏态势，经济增速的上升更多来自内需的恢复，出口恢复的速度较为缓慢，同比增速尚未转正；进口的增速则出现了大幅上升，自 2008 年 11 月以来首次转正。四季度的 PMI 强劲回升，11 月发电量的同比增速创历史新高 26.9%，11 月工业增加值同比增长 19.2%，月环比折年率增长 14.9%，处于较高的增速水平。固定资产投资增速依然强劲，地产投资增速和房屋新开工面积表现较好，11 月新开工面积同比增长近 200%。消费增速平稳上升，汽车和房地产相关的建筑装潢材料的消费仍非常旺盛，拉动了经济上行。货币供应量增速维持高位，11 月 M2 同比增长 29.74%，M1 同比增长 34.63%，信贷同比增速仍居高位，虽然新增贷款数量有所下降，但是结构趋于优化。整体通胀水平仍较为温和的水平，但通胀压力在加大。11 月份 CPI 同比已经转正为 0.6%，CPI 和 PPI 的环比都大幅上扬，CPI 月环比折年率为 7.1%，PPI 月环比折年率为 12.4%，上涨幅度非常大。CPI 上涨很快有雪灾因素，这体现在食品涨幅加大上面，但 CPI 非食品项涨幅回升也很快。

2.行情回顾

A 股市场在本季度小幅波动，中证 100 指数的主要波动区间为 3100–3600 点。受政策利空影响，地产行业从 12 月开始大幅下跌，是对指数负贡献最大的板块；因为全球电子行业景气回升以及 LED 的高速发展，电子元器件行业表现一枝独秀，成为四季度为数不多的亮点。

3.基金运作分析

本基金依然处于建仓期，到季度末，我们已经提前完成指数化建仓，整体仓位保持在 92–95%之间，其中中证 100 成份股之外的主动投资仓位暂时控制在 5%以内。

二、市场展望和投资策略

我们认为未来一个季度缺乏系统性的机会，但存在股指期货、融资融券等事件驱动的阶段性机会，以及各类主题投资机会。本基金将严格按照契约规定，被动投资为主，主动投资为辅，保持跟踪误差在较小范围内；同时，本基金的主动投资部分将严控仓位，采取自下而上策略，精选个股，中长期投资，力求超额收益，不以追逐市场热点的短期策略作为超越指数的投资手段。

作为基金管理者，我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧，为投资人创造应有的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2009 年 12 月 31 日，本基金的累计单位净值为 1.048 元。2009 年四季度本基金采取了分步稳健建仓的策略，净值增长率为 5.75%，同期基金基准增长率为 15.28%。12 月单月本基金净值增长率为 2.24%，同期基金基准增长率为 2.41%，建仓完成之后本基金收益率已经基本与基准相符。

本报告期内，本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差为 0.12%，年化跟踪误差为 1.95%，达到了基金合同中关于标的指数的跟踪目标。

§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	2,388,683,230.50	89.73
	其中：股票	2,388,683,230.50	89.73
2	固定收益投资	147,390,000.00	5.54
	其中：债券	147,390,000.00	5.54
	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	49,454,082.42	1.86
6	其他资产	76,657,077.55	2.88
7	合计	2,662,184,390.47	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	2,185,984.89	0.08
B	采掘业	11,854,983.90	0.45
C	制造业	2,288,865.00	0.09
C0	食品、饮料	–	–
C1	纺织、服装、皮毛	–	–
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	–	–
C5	电子	–	–
C6	金属、非金属	–	–
C7	机械、设备、仪表	–	–
C8	医药、生物制品	–	–
C99	其他制造业	2,288,865.00	0.09
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	11,980,894.32	0.45
F	交通运输、仓储业	46,967,046.60	1.78
G	信息技术业	654,304.44	0.02
H	批发和零售贸易	–	–
I	金融、保险业	–	–
J	房地产业	5,760,948.00	0.22
K	社会服务业	1,555,877.04	0.06
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	83,248,904.19	3.15

5.2.2 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	–	–
B	采掘业	264,441,330.86	10.02
C	制造业	545,537,039.94	20.67
C0	食品、饮料	89,051,549.22	3.37
C1	纺织、服装、皮毛	9,674,266.81	0.37
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	119,506,132.47	4.53
C5	电子	–	–
C6	金属、非金属	156,653,517.03	5.94
C7	机械、设备、仪表	170,651,574.41	6.47
C8	医药、生物制品	–	–
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	88,067,041.56	3.34
E	建筑业	36,181,357.62	1.37
F	交通运输、仓储业	102,438,851.36	3.88
G	信息技术业	59,715,788.71	2.26
H	批发和零售贸易	32,991,055.30	1.25
I	金融、保险业	1,046,800,101.22	39.67
J	房地产业	102,988,086.49	3.90
K	社会服务业	15,861,937.89	0.60
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	10,411,735.36	0.39
	合计	2,305,434,326.31	87.37

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	600036	招商银行	6,617,735	119,450,116.75	4.53
2	601328	交通银行	10,808,721	101,061,541.35	3.83
3	600309	烟台万华	4,087,050	98,130,070.50	3.72
4	601318	中国平安	1,712,029	94,315,677.61	3.57
5	600016	民生银行	11,255,665	89,032,310.15	3.37
6	600030	中信证券	2,762,971	87,779,588.67	3.33
7	601166	兴业银行	2,091,433	84,305,664.23	3.19
8	601398	工商银行	12,711,540	69,150,777.60	2.62
9	600000	浦发银行	3,183,777	69,056,123.13	2.62
10	601088	中国神华	1,970,060	68,597,489.20	2.60

5.3.2 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	600386	北巴传媒	3,216,921	46,967,046.60	1.78
2	600547	山东黄金	81,733	6,563,159.90	0.25
3	601668	中国建筑	1,363,900	6,437,608.00	0.24
4	600489	中金黄金	90,800	5,291,824.00	0.20
5	000024	招商地产	160,100	4,263,463.00	0.16

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	147,390,000.00	5.59
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	–	–
7	其他	–	–
8	合计	147,390,000.00	5.59

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	0901042	09央票 42	1,500,000	147,390,000.00	5.59
2	–	–	–	–	–
3	–	–	–	–	–
4	–	–	–	–	–
5	–	–	–	–	–

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.8.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	273,939.80
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	824,018.68
5	应收申购款	75,559,119.07
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	76,657,077.55

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

5.8.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告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	3,557,745,752.38
报告期期间基金总申购份额	365,590,283.60
报告期期间基金总赎回份额	1,405,213,173.14
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	2,518,122,862.84

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《中银中证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》

2、《中银中证 100 指数增强型证券投资基金招募说明书》

3、《中银中证 100 指数增强型证券投资基金托管协议》

4、中国证监会要求的其他文件

7.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站 www.bocim.com

7.3 查阅方式

投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，也可登陆基金管理人网站 www.bocim.com 查阅

中银基金管理有限公司

二〇一〇年一月二十二日

中海优质成长证券投资基金

2009年第四季度报告

2009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：交通银行股份有限公司 报告送出日期：二〇一〇年一月二十二日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 1 月 20 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，但不保证本基金一定盈利。

本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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中海优质成长混合
基金主代码	398001
前端基金主代码	398001
后端基金主代码	398002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年 9 月 28 日
报告期末基金份额总额	6,772,297,037.54 份
投资目标	本基金主要通过投资于中国证券市场中具有品质保障和发展潜力的持续成长企业所发行的股票和国内依法公开发行上市的债券，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，以获取资本长期增值和股息红利收益的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	品质过滤，成长精选。 （一）资产配置 本基金由公司投资决策委员会基于如下的分析判断并结合《基金合同》中的投资限制和投资比例限制来确定、调整基金资产中股票、债券和现金的配置比例： 1、根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化来把握宏观经济发展对证券市场的影响方向和力度，判断证券市场的发展趋势和风险收益特征； 2、根据基金投资者对开放式基金的认识程度，以及基金行业的管理经验，判断基金申购和赎回净现金流量。 （二）股票组合的构建 1、选股标准 本基金投资对象是优质成长企业的权益类证券。优质成长即注重上市公司品质和成长性的结合。主要从三方面考察上市公司的品质：① 财务健康，现金流充沛、业绩真实可靠；② 公司在所属行业内具有比较竞争优势；③ 良好的经营管理能力。同时从如下两个方面考察上市公司的成长性：① 公司应具有较强的潜在获利能力和较高的净利润增长率；② 公司产品或服务的需求总量不断扩大。 2、备选股票库的构建 备选股票库通过以下两个阶段构建： 第一阶段：品质与历史成长性过滤 本基金运用 GOQ 模型 (Growth On High Quality Model)对所有上市公司（投资决策委员会禁止投资的股票除外）的品质和历史成长性进行过滤。主要通过经营性现金流、总资产回报率等指标对其财务状况进行评价。通过相对市场份额、超额毛利率等指标对行业竞争优势进行评价。通过净利润增长率等指标对历史成长性进行评价。GOQ 模型根据上述指标对上市公司进行综合评价排序，初步筛选出 300 家左右的上市公司作为股票备选库（Ⅰ）。 第二阶段：成长精选 针对第一阶段筛选的股票备选库（Ⅰ），本基金运用 α 公司评级系统对其进行成长精选。 中海 α 公司评级系统由 4 个大的指标分析单元和 50 个具体评分指标构成，其中客观性评分指标 30 个，主观性评分指标 20 个。中海 α 公司评级系统 4 个大的分析单元分别是：企业成长的行业基本情况评价，企业成长的政策等非市场因素评价，企业成长的内在因素深度分析，企业成长的盈利与风险情况评价。 中海 α 公司评级系统的设置充分体现了主客观结合的评价原则，评级系统中可量化客观性指标的设置保证了选股过程的客观性和可比性。与一般的主观评级系统相比较，这种主客观结合的指标体系既充分保障了评价结果的全面与客观可比性，又有利于引导研究员对目标公司做更加深入细致的研究，提高评价结果的准确度。 本基金运用 α 公司评级系统的评价结果，对备选库（Ⅰ）中的股票进行进一步精选，形成 150 家左右上市公司的股票备选库（Ⅱ）。 3、股票投资组合的构建 基金经理根据内部、外部的研究报告以及自己的综合判断，特别是通过对公司管理团队的考量以及公司竞争力的全面分析，对股票备选库（Ⅱ）中的股票做出合适的投资判断，在此基础上形成最终的股票投资组合，并进行适时的调整。 （三）债券组合的构建 本基金可投资国债、金融债和企业债（包括可转债）。本基金根据基金资产总体配置计划，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，建立由不同类型、不同期限债券品种构成的投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数 *75% + 上证国债指数 *25%
风险收益特征	本基金是一只主动型的股票基金，在证券投资基金中属于中等风险品种。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产的中长期稳定增值。
基金管理人	中海基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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(2009 年 10 月 1 日 –2009 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	419,582,717.71
2.本期利润	768,535,584.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.1124
4.期末基金资产净值	5,511,957,382.91
5.期末基金份额净值	0.8139

注 1：本期指 2009 年 10 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日。所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：申购赎回费、基金转换费等），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

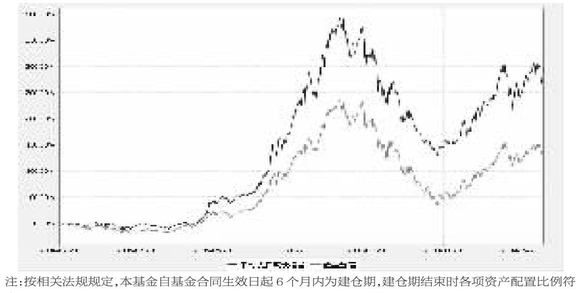
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	16.01%	1.61%	14.29%	1.32%	1.72%	0.29%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

中海优质成长证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2004 年 9 月 28 日至 2009 年 12 月 31 日）



注：按相关法规规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
杨济如	本基金基金经理	2009–6–2	–	11	华东师范大学经济学硕士、哥伦比亚大学公共管理硕士，11 年证券从业经历。历任国泰君安证券股份有限公司投资银行部高级经理、机构客户部（上海）总经理、资产管理部基金经理、上海乐丰投资管理有限公司投资经理。2008 年 4 月加入中海基金管理有限公司，曾任投研中心分析师兼本基金基金经理助理。2009 年 6 月 2 日起任本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，中海基金管理有限公司作为中海优质成长证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中海优质成长证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为进一步完善公平交易管理，防范和杜绝不规范交易行为，保护基金份额持有人的合法权益，公司建立了有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

公司通过制定《中海基金研究部研究报告质量考评制度》，树立了研究导向的投资文化，强调投资应以研究作为依据，不断建立完善系统、科学的研究方法和流程，并认真地推行实施。

对于场内交易，公司制定了《中海基金管理有限公司交易管理制度》，所有的投资指令必须通过集中交易室下达，集中交易室与投资部门相隔离，规定多基金指令处理原则是：时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡，通过公司已有交易软件进行控制，不同基金同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配，同时禁止多基金之间的同日反向交易。对于场外交易，通过《固定收益证券投资管理办法》、《新股询价网下申购流程》以及《中海基金旗下基金投资流通受限证券管理办法》等规定对交易行为进行规范。

本报告期，本基金运作合法合规，不同投资组合的交易得到公平对待，未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易，无损害基金份额持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

进入 2009 年 4 季度，市场运行的节奏分为两个部分。首先是 11 月前在美元指数持续创出新低，以及房地产市场持续高温的背景下，有色、煤炭、地产带领市场终于突破维持了两个月的箱体上行；随后美元进入低位盘整和反弹，政府陆续出台地产调控措施，信贷资金维持低位，创业板的推出，消费旺季的到来，使得业绩增长确定的中小板和大消费接过周期性行业的接力棒，成为市场上行的新动力。

基于宏观面复苏和企业盈利改善的正面预期，本基金在 2009 年 3 季度期末维持较高的仓位，并增持周期类板块，在反弹前期获取了较好的效果；在反弹后期，组合中增持了低估值大盘股以期取得进可攻退可守的效果，但在年底流动性局限以及地产调控的压力下，低估值的大盘股并没有得到市场的认同，资金依旧青睐高估值的中小盘股，市场风格没有切换，成为组合的拖累。

2010 年预期中的流动性收紧，通胀抬头等负面因素以及企业盈利持续增长等正面因素将加大市场波动的频率，总体上本基金依然看好未来市场的整体走势，自下而上，以业绩增长确定性作为构建组合和个股选择的首要因素，力求为投资者谋求更好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2009 年 12 月 31 日，本基金份额净值 0.8139 元 (累计净值 2.9234 元)。报告期内本基金净值增长率为 16.01%，高于业绩比较基准 1.72 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	4,616,776,803.97	81.66
	其中：股票	4,616,776,803.97	81.66
2	固定收益投资	249,650,000.00	4.42
	其中：债券	249,650,000.00	4.42
	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	593,942,970.04	10.51
6	其他资产	193,196,351.92	3.42
7	合计	5,653,566,125.93	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	29,912,111.00	0.54
B	采掘业	495,715,657.57	8.99
C	制造业	1,973,136,973.01	35.80
C0	食品、饮料	217,709,281.58	3.95
C1	纺织、服装、皮毛	18,434,544.00	0.33
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	50,154,426.80	0.91
C4	石油、化学、塑胶、塑料	130,407,131.98	2.37
C5	电子	145,828,346.24	2.65
C6	金属、非金属	894,993,080.32	16.24
C7	机械、设备、仪表	384,872,871.49	6.98
C8	医药、生物制品	113,953,189.24	2.07
C99	其他制造业	16,784,101.36	0.30
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,225,559.10	0.08
E	建筑业	142,380,895.20	2.58
F	交通运输、仓储业	2,688,434.22	0.05
G	信息技术业	411,968,134.42	7.47
H	批发和零售贸易	217,807,550.64	3.95
I	金融、保险业	1,091,025,278.98	19.79
J	房地产业	102,867,517.87	1.87
K	社会服务业	49,603,518.31	0.90
L	传播与文化产业	732,008.58	0.01
M	综合类	94,713,165.07	1.72
	合计	4,616,776,803.97	83.76

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	601318	中国平安	4,451,254	245,219,582.86	4.45
2	601166	兴业银行	4,990,558	201,169,392.98	3.65
3	601169	北京银行	9,185,605	177,649,600.70	3.22
4	000983	西山煤电	3,839,697	153,165,513.33	2.78
5	600030	中信证券	4,335,077	137,725,396.29	2.50
6	000858	五 粮 液	4,302,661	136,222,247.26	2.47
7	600036	招商银行	6,620,380	119,497,859.00	2.17
8	000063	中兴通讯	2,480,925	111,319,104.75	2.02
9	600660	福耀玻璃	7,094,932	105,998,284.08	1.92
10	600019	宝钢股份	10,861,063	104,917,868.58	1.90

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	249,650,000.00	4.53
	其中：政策性金融债	249,650,000.00	4.53
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	–	–
7	其他	–	–
8	合计	249,650,000.00	4.53

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	090406	09农发 06	2,500,000	249,650,000.00	4.53

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,417,676.52
2	应收证券清算款	184,274,668.06
3	应收股利	–
4	应收利息	2,199,563.03
5	应收申购款	304,444.31
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	193,196,351.92

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.6 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	6,846,220,626.76
报告期期间基金总申购份额	238,803,140.31
报告期期间基金总赎回份额	312,726,729.53
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	6,772,297,037.54

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立中海优质成长证券投资基金的文件

2、中海优质成长证券投资基金基金合同

3、中国证监会批准更名为中海基金管理有限公司的文件

4、中海优质成长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

7.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 29 楼

7.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。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

公司网址：http://www.zhfund.com

中海基金管理有限公司

二〇一〇年一月二十二日

中海稳健收益债券型证券投资基金

2009年第四季度报告

2009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：二〇一〇年一月二十二日

§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 2010 年 1 月 20 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，但不保证本基金一定盈利。

本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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中海稳健收益债券
基金主代码	395001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年 4 月 10 日
报告期末基金份额总额	1,139,302,383.46 份
投资目标	在充分重视本金长期安全的前提下，力争为基金份额持有人创造较高的稳定收益。
投资策略	1、一级资产配置 一级资产配置主要采取自上而下的方式。比较固定收益品种与一级市场申购预期收益率，确定进行一级市场申购的资产比例，进行大类资产配置。 本基金在进行新股申购时，将结合金融工程数量化模型，使用中海基金估值模型等方法评估股票的内在价值，充分借鉴合作券商等外部资源的研究成果，对于拟发行上市新股（或增发新股）等权益类资产价值进行深入发掘，评估新股（或增发新股）等权益类资产一、二级市场价差。同时分析新股（或增发新股）等权益类资产融资规模、市场申购资金规模等条件，评估申购中签率水平，从而综合评估申购收益率，确定申购资金在不同品种之间、网上与网下之间的资金分配，对申购资金进行积极管理，制定相应申购和择时卖出策略以获取较好投资收益。 2、久期配置 / 期限结构配置 （1）久期配置：基于宏观经济趋势性变化，自上而下的资产配置。 （2）期限结构配置：基于数量化模型，自上而下的资产配置。 3、债券类别配置：主要依据信用利差分析，自上而下的资产配置。 4、做市策略：基于各个投资品种具体情况，自下而上的交易策略。 5、其它交易策略 （1）短期资金运用 （2）公司债跨市场套利
业绩比较基准	中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中国债券总指数收益率×100%
风险收益特征	本基金属债券型证券投资基金，为证券投资基金中的较低风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于混合型基金，高于货币市场基金。
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(2009 年 10 月 1 日 –2009 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	17,151,546.01
2.本期利润	24,053,129.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0449
4.期末基金资产净值	1,283,202,503.16
5.期末基金份额净值	1.126

注 1：本期指 2009 年 10 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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

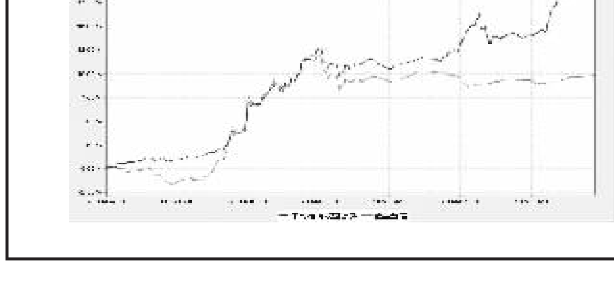
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	4.65%	0.31%	0.53%	0.04%	4.12%	0.27%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

中海稳健收益债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2008 年 4 月 10 日至 2009 年 12 月 31 日）



注：按相关法规规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
欧阳凯	本基金基金经理	2008–9–18	–	8	复旦大学经济学硕士，8 年证券从业经历。曾在国泰君安证券固定收益总部从事债券研究、投资工作。2006 年 5 月加入中海基金管理有限公司，历任固定收益部分析师，本基金基金助理。2008 年 9 月 18 日起任本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，中海基金管理有限公司作为中海稳健收益债券型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中海稳健收益债券型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为进一步完善公平交易管理，防范和杜绝不规范交易行为，保护基金份额持有人的合法权益，公司建立了有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

公司通过制定《中海基金研究部研究报告质量考评制度》，树立了研究导向的投资文化，强调投资应以研究作为依据，不断建立完善系统、科学的研究方法和流程，并认真地推行实施。

对于场内交易，公司制定了《中海基金管理有限公司交易管理制度》，所有的投资指令必须通过集中交易室下达，集中交易室与投资部门相隔离，规定多基金指令处理原则是：时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡，通过公司已有交易软件进行控制，不同基金同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配，同时禁止多基金之间的同日反向交易。对于场外交易，通过《固定收益证券投资管理办法》、《新股询价网下申购流程》以及《中海基金旗下基金投资流通受限证券管理办法》等规定对交易行为进行规范。

本报告期，本基金运作合法合规，不同投资组合的交易得到公平对待，未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易，无损害基金份额持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2009 年债券市场整体出现震荡下行，债券指数呈现逐阶下跌趋势。债券发行利率大幅上扬，浮动利率债券表现好于固定利率债券。2009 年 4 季度利率品种依然低迷，信用品种明显恢复，转债市场继续振荡。

对于未来半年的债券市场，我们保持谨慎的态度。近期央行发行的 600 亿 3 个月期央票利率意外上调 4 个基点，为时隔 4 个多月来的首次变动。同时，公开市场资金净回笼量亦骤升至近 11 周以来的新高达 1370 亿元。1 年期央票利率提升几乎无悬念，此举亦表明央行收紧流动性的意愿比较迫切。

因此未来的货币政策走向仍然是最为重要的影响因素，同时物价水平的变化也将深刻影响市场，对此我们要保持实时跟踪。未来的运作要坚持稳健的原则，首要是规避信用风险，其次规避流动性风险，保持适度的久期，应对市场变化带来的冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2009 年 12 月 31 日，本基金份额净值 1.126 元 (累计净值 1.186 元)。报告期内本基金净值增长率为 4.65%，高于业绩比较基准 4.12 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	20,978,937.94	1.55
	其中：股票	20,978,937.94	1.55
2	固定收益投资	1,160,073,195.37	85.50
	其中：债券	1,160,073,195.37	85.50
	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	120,138,331.02	8.85
6	其他资产	55,636,956.42	4.10
7	合计	1,356,827,420.75	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	588,255.06	0.05
B	采掘业	–	–
C	制造业	13,332,384.65	1.04
C0	食品、饮料	1,269,278.65	0.10
C1	纺织、服装、皮毛	–	–
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	–	–
C5	电子	1,292,731.30	0.10
C6	金属、非金属	–	–
C7	机械、设备、仪表	7,315,434.84	0.57
C8	医药、生物制品	3,454,939.86	0.27
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	2,710,908.88	0.21
F	交通运输、仓储业	1,361,234.46	0.11
G	信息技术业	33,000.00	0.00
H	批发和零售贸易	–	–
I	金融、保险业	–	–
J	房地产业	1,158,954.97	0.09
K	社会服务业	1,794,199.92	0.14
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	20,978,937.94	1.63

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	300039	上海凯宝	76,369	2,902,022.00	0.23
2	300011	鼎汉技术	30,120	2,108,400.00	0.16
3	300024	机器人	25,175	1,819,649.00	0.14
4	300012	华测检测	39,828	1,718,179.92	0.13
5	002307	北新路桥	60,106	1,646,904.40	0.13
6	300040	九洲电气	43,457	1,434,081.00	0.11
7	002320	海峡股份	26,597	1,361,234.46	0.11
8	300014	亿纬锂能	32,686	1,292,731.30	0.10
9	002304	洋河股份	11,135	1,269,278.65	0.10
10	002305	南国置业	59,221	1,158,954.97	0.09

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	63,438,906.00	4.94
2	央行票据	797,360,000.00	62.14
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	299,080,132.37	23.31
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	194,157.00	0.02
7	其他	–	–
8	合计	1,160,073,195.37	90.40

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	0901071	09央票 71	7,000,000	697,690,000.00	54.37
2	0901061	09央票 61	1,000,000	99,670,000.00	7.77
3	010110	21国债⑽	500,000	51,145,000.00	3.99
4	122033	09富力债	300,000	30,990,000.00	2.42
5	122939	09吉安债	200,000	20,700,000.00	1.61

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	3,835,656.42
5	应收申购款	51,551,300.00
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	55,636,956.42

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300039	上海凯宝	2,902,022.00	0.23	网下申购新股锁定
2	300011	鼎汉技术	2,108,400.00	0.16	网下申购新股锁定
3	300024	机器人	1,819,649.00	0.14	网下申购新股锁定
4	300012	华测检测	1,718,179.92	0.13	网下申购新股锁定
5	002307	北新路桥	1,646,904.40	0.13	网下申购新股锁定
6	300040	九洲电气	1,434,081.00	0.11	网下申购新股锁定
7	002320	海峡股份	1,361,234.46	0.11	网下申购新股锁定
8	300014	亿纬锂能	1,292,731.30	0.10	网下申购新股锁定
9	002304	洋河股份	1,269,278.65	0.10	网下申购新股锁定
10	002305	南国置业	1,158,954.97	0.09	网下申购新股锁定

5.8.6 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	633,231,135.06
报告期期间基金总申购份额	764,591,776.07
报告期期间基金总赎回份额	258,520,527.67
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	1,139,302,383.46

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立中海稳健收益债券型证券投资基金的文件

2、中海稳健收益债券型证券投资基金基金合同

3、中海稳健收益债券型证券投资基金财务报表及报表附注

4、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

7.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 29 楼

7.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。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

公司网址：http://www.zhfund.com

中海基金管理有限公司

二〇一〇年一月二十二日